

PREMIÈRE COMPOSITION DE MATHÉMATIQUES

(Durée : 4 heures)

L'utilisation des calculatrices n'est pas autorisée pour cette épreuve.

L'objet de ce problème est l'étude de systèmes régis par une équation différentielle dépendant d'une donnée appelée « commande » et la recherche de « commandes optimales ».

Pour tout $p \in \mathbf{N}^*$, on note $\|\cdot\|$ la norme euclidienne sur $\mathbf{R}^p$ et $(\cdot|\cdot)$ le produit scalaire euclidien. La *transposée* d'une matrice réelle M est notée M^* . On identifie un élément de $\mathbf{R}^p$ avec une matrice à p lignes et une colonne.

Dans ce problème, on appelle fonction *bien continue par morceaux* sur un intervalle $[0, T]$ de $\mathbf{R}$ toute fonction φ continue par morceaux, continue à gauche sur $[0, T]$ et continue à droite en 0, c'est-à-dire telle qu'il existe un nombre fini de points, $t_0 = 0 < t_1 < \dots < t_{k-1} < t_k = T$ tels que φ est continue sur $[0, t_1],]t_1, t_2], \dots,]t_{k-2}, t_{k-1}],]t_{k-1}, T]$ et que $\lim_{\substack{t \rightarrow t_\ell \\ t > t_\ell}} \varphi(t)$ existe pour $\ell = 1, 2, \dots, k-1$.

Preliminaires

Soit $\mathcal{M}_p$ l'espace vectoriel des matrices carrées réelles à p lignes. Pour $M \in \mathcal{M}_p$, on pose

$$|||M||| = \sup_{\substack{X \in \mathbf{R}^p \\ X \neq 0}} \frac{\|MX\|}{\|X\|}.$$

1.a) Vérifier que $M \in \mathcal{M}_p \mapsto |||M||| \in \mathbf{R}$ est une norme sur $\mathcal{M}_p$.

b) Montrer que, pour toutes matrices $M, N \in \mathcal{M}_p$,

$$|||MN||| \leq |||M||| \, |||N|||.$$

2.a) Pour $n \in \mathbf{N}$, on pose $S_n(M) = \sum_{k=0}^n \frac{1}{k!} M^k$. Montrer que la suite $(S_n(M))_{n \in \mathbf{N}}$ est convergente dans l'espace vectoriel $\mathcal{M}_p$ muni de la norme $|||\cdot|||$.

On pose

$$e^M = \lim_{n \rightarrow +\infty} S_n(M) = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{k!} M^k .$$

b) Montrer que la fonction $t \in \mathbf{R} \mapsto e^{tM} \in \mathcal{M}_p$ est continue, dérivable et que

$$\frac{d}{dt} e^{tM} = M e^{tM} .$$

c) Calculer $\frac{d}{dt}(e^{tM} e^{-tM})$ et, pour $s \in \mathbf{R}$, $\frac{d}{dt}(e^{(s+t)M} e^{-tM})$. En déduire que

$$e^{(s+t)M} = e^{sM} e^{tM} .$$

Première partie

Soit T un réel > 0 et soit $A \in \mathcal{M}_p$. Soit B une fonction bien continue par morceaux sur $[0, T]$ à valeurs dans $\mathbf{R}^p$, et soit $X_0 \in \mathbf{R}^p$. On pose, pour tout $t \in [0, T]$,

$$X(t) = e^{tA} X_0 + \int_0^t e^{(t-s)A} B(s) ds .$$

3.a) On suppose que B est continue. Montrer que $t \mapsto X(t)$ est l'unique fonction de classe C^1 sur $[0, T]$ à valeurs dans $\mathbf{R}^p$ telle que $X(0) = X_0$ et, pour tout $t \in [0, T]$,

$$\frac{d}{dt} X(t) = A X(t) + B(t) . \quad (1)$$

On suppose maintenant et dans toute la suite du problème que B est seulement bien continue par morceaux.

b) Montrer que $t \mapsto X(t)$ est l'unique fonction continue, dérivable en tout point où B est continue, et de classe C^1 par morceaux sur $[0, T]$ telle que $X(0) = X_0$ et que la condition (1) soit satisfaite en tout point où X est dérivable. *Par convention*, on dira encore que X est solution de l'équation différentielle (1) sur $[0, T]$.

Soit $q \in \mathbf{N}^*$ tel que $q \leq p$ et soit K une matrice réelle à p lignes et q colonnes. On désigne par $\mathcal{U}$ l'espace vectoriel des fonctions bien continues par morceaux sur $[0, T]$ à valeurs dans $\mathbf{R}^q$. A toute fonction $U \in \mathcal{U}$, on associe l'équation différentielle sur $[0, T]$

$$\frac{d}{dt} X(t) = A X(t) + K U(t) , \quad (2)$$

et l'on dit que U est la *commande du système* décrit par l'équation (2). On fixe $X_0 \in \mathbf{R}^p$. On désigne par X_U l'unique solution de (2) telle que $X_U(0) = X_0$.

4. Montrer que, pour tout $V \in \mathcal{U}$, il existe Y_V tel que, pour tout $U \in \mathcal{U}$ et tout $\lambda \in \mathbf{R}$, on ait $X_{U+\lambda V} - X_U = \lambda Y_V$. Préciser l'équation différentielle et la condition initiale satisfaites par Y_V .

Soient α, β, γ des réels ≥ 0 . On considère la fonction $\mathcal{C} : \mathcal{U} \rightarrow \mathbf{R}$ définie par

$$\mathcal{C}(U) = \int_0^T (\alpha \|X_U(t)\|^2 + \beta \|U(t)\|^2) dt + \gamma \|X_U(T)\|^2,$$

modélisant un coût que l'on cherche à rendre minimal. Soient $U, V \in \mathcal{U}$ et $\lambda \in \mathbf{R}$.

5. Montrer que $\mathcal{C}(U + \lambda V) - \mathcal{C}(U)$ est un polynôme du second degré en λ et donner des expressions des coefficients de ce polynôme. Que peut-on dire du signe du coefficient de λ^2 ?

6.a) Montrer qu'il existe une unique fonction $Z_U : [0, T] \rightarrow \mathbf{R}^p$, de classe C^1 , telle que $Z_U(T) = 2\gamma X_U(T)$ et

$$\frac{d}{dt} Z_U(t) = -A^* Z_U(t) - 2\alpha X_U(t).$$

b) Exprimer $(Z_U(T)|Y_V(T)) + 2\alpha \int_0^T (X_U(t)|Y_V(t)) dt$ par une intégrale de 0 à T faisant intervenir K, V et Z_U . [On rappelle que pour des fonctions Z et Y à valeurs vectorielles, $\frac{d}{dt}(Z(t)|Y(t)) = (\frac{dZ}{dt}(t)|Y(t)) + (Z(t)|\frac{dY}{dt}(t)).$]

7.a) Dédurre des questions précédentes que

$$\frac{d}{d\lambda} \Big|_{\lambda=0} \mathcal{C}(U + \lambda V) = \int_0^T (K^* Z_U(t) + 2\beta U(t)|V(t)) dt.$$

b) Montrer que $U_0 \in \mathcal{U}$ vérifie la condition $\mathcal{C}(U_0) = \inf_{U \in \mathcal{U}} \mathcal{C}(U)$, si et seulement si, $\forall t \in [0, T], K^* Z_{U_0}(t) + 2\beta U_0(t) = 0$.

Deuxième partie

On conserve les notations de la première partie.

Soit J un intervalle fermé et borné de $\mathbf{R}$, non réduit à un point, et soit J^q le cube qu'il définit dans $\mathbf{R}^q$. On considère l'ensemble $\widehat{\mathcal{U}}$ des commandes $U \in \mathcal{U}$ telles que $\forall t \in [0, T], U(t) \in J^q$.

8.a) L'ensemble $\widehat{\mathcal{U}}$ est-il un sous-espace vectoriel de $\mathcal{U}$?

b) Montrer que si $U, V \in \widehat{\mathcal{U}}, \lambda \in [0, 1]$, alors $U + \lambda(V - U) \in \widehat{\mathcal{U}}$.

9. Montrer que $U_0 \in \widehat{\mathcal{U}}$ vérifie la condition

$$\mathcal{C}(U_0) = \inf_{U \in \widehat{\mathcal{U}}} \mathcal{C}(U)$$

si et seulement si, $\forall t \in [0, T], \forall V \in \widehat{\mathcal{U}},$

$$(K^* Z_{U_0}(t) + 2\beta U_0(t)|V(t) - U_0(t)) \geq 0.$$

Dans l'application qui suit, on prend $p = 2$ et $q = 1$. On choisit $J = [-a, a]$, où $a > 0$. Soit k une constante réelle, $k > 0$.

Si $t \mapsto x(t)$ est une fonction deux fois dérivable, on pose

$$\dot{x} = \frac{dx}{dt} \quad , \quad \ddot{x} = \frac{d^2x}{dt^2} .$$

Pour toute fonction $u \in \widehat{\mathcal{U}}$, on étudie les fonctions $t \mapsto x(t)$ de $[0, T]$ dans $\mathbf{R}$, de classe C^1 , et de classe C^2 par morceaux telles que $\ddot{x}(t) = -k u(t)$ en tout point $t \in [0, T]$ où $\ddot{x}$ est définie.

10.a) Écrire ce problème sous la forme (2) avec des matrices A et K que l'on déterminera. Soient x_0 et v_0 des nombres réels. Montrer qu'il existe une unique fonction x_u solution de ce problème telle que $x_u(0) = x_0$ et $\dot{x}_u(0) = v_0$.

b) Trouver α, β, γ pour que $\mathcal{C}(u) = \left(x_u(T)\right)^2 + \left(\dot{x}_u(T)\right)^2$. Ces valeurs de α, β, γ sont choisies dans toute la suite du problème.

c) Montrer que Z_u est une fonction affine de t à valeurs dans $\mathbf{R}^2$.

11.a) Soit $u_0 \in \widehat{\mathcal{U}}$ tel que $x_{u_0}(T) = 0$ et $\dot{x}_{u_0}(T) = 0$. Montrer que $\mathcal{C}(u_0) = \inf_{u \in \widehat{\mathcal{U}}} \mathcal{C}(u)$.

b) Soit $u_0 \in \widehat{\mathcal{U}}$ tel que

(i) $x_{u_0}(T)$ et $\dot{x}_{u_0}(T)$ ne sont pas tous deux nuls ;

(ii) $\mathcal{C}(u_0) = \inf_{u \in \widehat{\mathcal{U}}} \mathcal{C}(u)$.

Montrer que la fonction u_0 est constante par morceaux.

12. On suppose que $x_0 = 1 + \frac{T^2}{2} \left(1 + \frac{ka}{2}\right)$, $v_0 = -\frac{T}{2}$.

a) On considère $u_0(t)$ telle que :

$$u_0(t) = a \text{ si } 0 \leq t \leq \frac{T}{2} \quad , \quad u_0(t) = -a \text{ si } \frac{T}{2} < t \leq T .$$

Calculer $x_{u_0}(T)$ et $\dot{x}_{u_0}(T)$.

b) Montrer que $\mathcal{C}(u_0) = \inf_{u \in \widehat{\mathcal{U}}} \mathcal{C}(u)$.

c) On considère le cas où $ka = \frac{1}{4}$ et $T = 4$. La fonction u_0 est-elle alors l'unique fonction de $\widehat{\mathcal{U}}$ telle que $\mathcal{C}(u_0) = \inf_{u \in \widehat{\mathcal{U}}} \mathcal{C}(u)$?

* *

*

4