

SVM 201

FONCTIONS DE PLUSIEURS VARIABLES

Alain Yves LE ROUX

Remarque préliminaire : Nous nous limiterons dans cette étude au cas de deux variables réelles, la généralisation à plusieurs variables réelles étant immédiate à partir des résultats exposés ici.

1 La continuité

Soit K une partie de \mathbb{R}^2 , et f une fonction définie sur K et à valeurs dans \mathbb{R} . En pratique, K correspond au domaine de définition de la fonction f . Soit $(x_0, y_0) \in K$.

Définition 1.1 La fonction f est continue en (x_0, y_0) lorsque

$$\forall \epsilon > 0 \quad \exists \eta > 0 \text{ si } (x, y) \in K \text{ et } \sqrt{(x - x_0)^2 + (y - y_0)^2} \leq \eta \text{ alors } |f(x, y) - f(x_0, y_0)| \leq \epsilon. \quad (1.1)$$

Si f est continue en tout point de K , on dit que f est continue sur K .

Exemples : La fonction f définie sur $K = \mathbb{R}^2$ par

$$f(x, y) = \begin{cases} \frac{x^3 - y^3}{x^2 + y^2} & \text{si } (x, y) \neq (0, 0), \\ 0 & \text{si } (x, y) = (0, 0), \end{cases}$$

est continue sur K .

La fonction f définie sur $K = \mathbb{R}^2$ par

$$f(x, y) = \begin{cases} \frac{x^2 - y^2}{x^2 + y^2} & \text{si } (x, y) \neq (0, 0), \\ 0 & \text{si } (x, y) = (0, 0), \end{cases}$$

n'est pas continue sur K . En effet, en passant en coordonnées polaires, on obtient, pour $(x, y) \neq (0, 0)$, $f(x, y) = \cos^2 \theta - \sin^2 \theta = \cos(2\theta)$ qui ne tend pas vers zéro lorsque $r = \sqrt{x^2 + y^2}$ tend vers zéro. On trouve par exemple la valeur 1 pour $\theta = 0$.

La fonction f définie sur $K = \{(x, y) \in \mathbb{R}^2 \mid (x, y) \neq (0, 0)\}$ par

$$f(x, y) = \frac{x^2 - y^2}{x^2 + y^2}$$

est continue sur K . En effet, le point $(0, 0) \notin K$.

2 La dérivabilité

Soit $(x_0, y_0) \in K$, domaine de définition de la fonction f . On fixe y_0 , et on considère la fonction $x \rightarrow f(x, y_0)$, en tant que fonction d'une seule variable, à savoir x . On peut définir, lorsque cette limite existe, la quantité

$$\frac{\partial f}{\partial x}(x_0, y_0) = \lim_{h \rightarrow 0, (x_0+h, y_0) \in K} \left(\frac{f(x_0+h, y_0) - f(x_0, y_0)}{h} \right) \quad (2.1)$$

qu'on appellera dérivée partielle de f par rapport à sa première variable (à savoir x), au point (x_0, y_0) .

En fixant x_0 , on peut aussi considérer la fonction d'une seule variable $y \rightarrow f(x_0, y)$ et définir quand la limite existe

$$\frac{\partial f}{\partial y}(x_0, y_0) = \lim_{k \rightarrow 0, (x_0, y_0+k) \in K} \left(\frac{f(x_0, y_0+k) - f(x_0, y_0)}{k} \right) \quad (2.2)$$

qu'on appellera dérivée partielle de f par rapport à sa seconde variable (à savoir y), au point (x_0, y_0) .

Définition 2.1 Lorsque les dérivées partielles $\frac{\partial f}{\partial x}$ et $\frac{\partial f}{\partial y}$ sont définies et continues sur K , on dit que la fonction f est continuellement dérivable sur K . Dans ce cas, on peut écrire, en tout point $(x_0, y_0) \in K$ tel qu'il existe $\eta > 0$ pour lequel $\{(x_0+h, y_0+k) \mid \sqrt{h^2+k^2} \leq \eta\} \subset K$,

$$f(x_0+h, y_0+k) = f(x_0, y_0) + h \frac{\partial f}{\partial x}(x_0, y_0) + k \frac{\partial f}{\partial y}(x_0, y_0) + \sqrt{h^2+k^2} \epsilon(h, k), \quad (2.3)$$

où $\epsilon(h, k)$ tend vers zéro lorsque $\sqrt{h^2+k^2}$ tend vers zéro.

2.1 La dérivation de fonctions composées

Soit $A \subset \mathbb{R}^2$, et w une application de A dans K . Ceci signifie que w est la donnée de deux fonctions u et v , définies sur A , telle que pour $(t, s) \in A$, on ait $(u(t, s), v(t, s)) \in K$. On peut donc définir la fonction $g = f \circ w$ sur A par

$$g(t, s) = f(u(t, s), v(t, s)).$$

On évalue les dérivées partielles de g . On a pour $(t + \Delta t, s) \in A$

$$\begin{aligned} g(t + \Delta t, s) &= f(u(t + \Delta t, s), v(t + \Delta t, s)) = \\ &= f(u(t, s) + \Delta t \frac{\partial u}{\partial t}(t, s) + \Delta t \epsilon_1(\Delta t, 0), v(t, s) + \Delta t \frac{\partial v}{\partial t}(t, s) + \Delta t \epsilon_2(\Delta t, 0)) \\ &= f(u(t, s), v(t, s)) + \Delta t \frac{\partial u}{\partial t}(t, s) \frac{\partial f}{\partial x}(u, v) + \Delta t \frac{\partial v}{\partial t}(t, s) \frac{\partial f}{\partial y}(u, v) + \Delta t \epsilon(\Delta t) \end{aligned}$$

où $\epsilon_1(\Delta t, 0)$, $\epsilon_2(\Delta t, 0)$ et $\epsilon(\Delta t)$ tendent vers zéro lorsque Δt tend vers zéro. On en déduit

$$\lim_{\Delta t \rightarrow 0} \frac{g(t + \Delta t, s) - g(t, s)}{\Delta t} = \frac{\partial f}{\partial x}(u, v) \frac{\partial u}{\partial t}(t, s) + \frac{\partial f}{\partial y}(u, v) \frac{\partial v}{\partial t}(t, s).$$

d'où la formule

$$\frac{\partial g}{\partial t}(t, s) = \frac{\partial f}{\partial x}(u, v) \frac{\partial u}{\partial t}(t, s) + \frac{\partial f}{\partial y}(u, v) \frac{\partial v}{\partial t}(t, s). \quad (2.4)$$

De la même façon, en développant $g(t, s + \Delta s) = f(u(t, s + \Delta s), v(t, s + \Delta s))$ pour $(t, s + \Delta s) \in A$, on obtient

$$\lim_{\Delta s \rightarrow 0} \frac{g(t, s + \Delta s) - g(t, s)}{\Delta s} = \frac{\partial f}{\partial x}(u, v) \frac{\partial u}{\partial s}(t, s) + \frac{\partial f}{\partial y}(u, v) \frac{\partial v}{\partial s}(t, s).$$

d'où la formule

$$\frac{\partial g}{\partial s}(t, s) = \frac{\partial f}{\partial x}(u, v) \frac{\partial u}{\partial s}(t, s) + \frac{\partial f}{\partial y}(u, v) \frac{\partial v}{\partial s}(t, s). \quad (2.5)$$

De façon générale, on utilise un abus de langage consistant à noter $x = u(t, s)$ et $y = v(t, s)$, pour écrire les formules (2.4) et (2.5) ainsi

$$\frac{\partial g}{\partial t} = \frac{\partial f}{\partial x} \frac{\partial x}{\partial t} + \frac{\partial f}{\partial y} \frac{\partial y}{\partial t}; \quad \frac{\partial g}{\partial s} = \frac{\partial f}{\partial x} \frac{\partial x}{\partial s} + \frac{\partial f}{\partial y} \frac{\partial y}{\partial s}.$$

Par exemple, pour $x = r \cos \theta$, $y = r \sin \theta$ (coordonnées polaires) on obtient les formules

$$\frac{\partial g}{\partial r} = \frac{\partial f}{\partial x} \cos \theta + \frac{\partial f}{\partial y} \sin \theta, \quad \frac{\partial g}{\partial \theta} = -r \frac{\partial f}{\partial x} \sin \theta + r \frac{\partial f}{\partial y} \cos \theta.$$

2.2 La formule des accroissements finis

La formule des accroissements finis pour une fonction d'une seule variable se généralise simplement.

Théorème 2.2 Soit $(x, y) \in K$, tel qu'il existe $\eta > 0$ pour lequel $\{(x+h, y+k) \mid \sqrt{h^2+k^2} \leq \eta\} \subset K$, et f une fonction continuellement dérivable sur K . Alors il existe $\theta \in]0, 1[$ tel que

$$f(x+h, y+k) = f(x, y) + h \frac{\partial f}{\partial x}(x+\theta h, y+\theta k) + k \frac{\partial f}{\partial y}(x+\theta h, y+\theta k) \quad (2.6)$$

où $\epsilon(h, k)$ tend vers zéro lorsque $\sqrt{h^2+k^2}$ tend vers zéro.

Démonstration : On utilise la formule des accroissements finis sur la fonction g d'une seule variable t définie sur $[0, 1]$ par

$$g(t) = f(x+th, y+tk).$$

On a $g(1) = f(x+h, y+k)$ et $g(0) = f(x, y)$. Donc il existe $\theta \in]0, 1[$ tel que

$$g(1) = g(0) + g'(\theta),$$

et comme, d'après (2.4),

$$g'(t) = h \frac{\partial f}{\partial x}(x+th, y+tk) + k \frac{\partial f}{\partial y}(x+th, y+tk),$$

on obtient exactement (2.6).

2.3 La dérivée partielle dans une direction donnée

On se donne un vecteur directeur $n = (n_1, n_2)$, (donc avec $n_1^2 + n_2^2 = 1$). Soit $(x, y) \in K$ tel qu'il existe $\eta > 0$ pour lequel $\{(x+h, y+k) \mid \sqrt{h^2+k^2} \leq \eta\} \subset K$. On veut la dérivée partielle de f dans la direction n , en (x, y) , comme on l'a déjà fait pour $n = (1, 0)$ (c'est $\frac{\partial f}{\partial x}$) et pour $n = (0, 1)$ (c'est $\frac{\partial f}{\partial y}$). On la notera $\frac{\partial f}{\partial n}(x, y)$. En développant $f(x + n_1h, y + n_2k)$, il vient

$$f(x + n_1h, y + n_2k) = f(x, y) + n_1h \frac{\partial f}{\partial x}(x, y) + n_2k \frac{\partial f}{\partial y}(x, y) + \sqrt{h^2+k^2} \epsilon(h, k)$$

d'où

$$\frac{\partial f}{\partial n}(x, y) = n_1 \frac{\partial f}{\partial x}(x, y) + n_2 \frac{\partial f}{\partial y}(x, y). \quad (2.7)$$

On remarque qu'il s'agit en fait du produit scalaire de n par $(\frac{\partial f}{\partial x}, \frac{\partial f}{\partial y})$, le vecteur gradient de f .

3 Les dérivées partielles d'ordre deux

On a vu que, lorsqu'elles existent, $\frac{\partial f}{\partial x}$ et $\frac{\partial f}{\partial y}$ sont des fonctions définies sur K , à valeurs dans \mathbb{R} ; on peut aussi envisager de les dériver à leur tour. On notera

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x^2}(x, y) = \frac{\partial(\frac{\partial f}{\partial x})}{\partial x}(x, y), \quad \frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x}(x, y) = \frac{\partial(\frac{\partial f}{\partial x})}{\partial y}(x, y),$$

et

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y}(x, y) = \frac{\partial(\frac{\partial f}{\partial y})}{\partial x}(x, y), \quad \frac{\partial^2 f}{\partial y^2}(x, y) = \frac{\partial(\frac{\partial f}{\partial y})}{\partial y}(x, y).$$

Théorème 3.1 (Théorème de Schwarz) *Si les fonctions $\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y}$ et $\frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x}$ sont continues en (x, y) , on a l'égalité*

$$\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y}(x, y) = \frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x}(x, y). \quad (3.1)$$

Démonstration Soit $(x, y) \in K$; on évalue de deux façons différentes la quantité

$$A(h, k) = \frac{1}{hk} (f(x+h, y+k) - f(x+h, y) - f(x, y+k) + f(x, y))$$

pour h, k tels que $(x+h, y+k) \in K$. On a dans un premier temps, par deux applications successives de la formule des accroissements finis (d'abord sur x , et ensuite sur y),

$$A(h, k) = \frac{1}{k} \left(\frac{\partial f}{\partial x}(x + \theta_1 h, y+k) - \frac{\partial f}{\partial x}(x + \theta_1 h, y) \right) = \frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x}(x + \theta_1 h, y + \theta_2 k),$$

qui tend vers $\frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x}(x, y)$ lorsque $\sqrt{h^2+k^2} \rightarrow 0$. Dans un deuxième temps, on a, en inversant les applications de ces formules d'accroissements finis, (donc d'abord sur y , et ensuite sur x)

$$A(h, k) = \frac{1}{h} \left(\frac{\partial f}{\partial y}(x + h, y + \theta'_2 k) - \frac{\partial f}{\partial x}(x, y + \theta'_2 k) \right) = \frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y}(x + \theta'_1 h, y + \theta'_2 k),$$

qui tend vers $\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y}(x, y)$ lorsque $\sqrt{h^2 + k^2} \rightarrow 0$. D'où l'identité.

Remarquons a posteriori que $\theta_1 = \theta'_1$, $\theta_2 = \theta'_2$.

Définition Lorsque les fonctions $\frac{\partial^2 f}{\partial x^2}$, $\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y}$ et $\frac{\partial^2 f}{\partial y^2}$ existent et sont continues sur une partie B de K , on dit que f est deux fois continuellement dérivable sur B .

3.1 La formule de Taylor

On a le résultat suivant.

Théorème 3.2 Soit $(x, y) \in K$, et $\eta > 0$ tel que $B_\eta(x, y) = \{(x + h, y + k) \mid \sqrt{h^2 + k^2} \leq \eta\} \subset K$, et f une fonction deux fois continuellement dérivable sur $B_\eta(x, y)$. Alors

$$\begin{aligned} f(x + h, y + k) &= f(x, y) + h \frac{\partial f}{\partial x}(x, y) + k \frac{\partial f}{\partial y}(x, y) + \\ &+ \frac{h^2}{2} \frac{\partial^2 f}{\partial x^2}(x, y) + hk \frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y}(x, y) + \frac{k^2}{2} \frac{\partial^2 f}{\partial y^2}(x, y) + (h^2 + k^2)\epsilon(h, k), \end{aligned} \quad (3.2)$$

où $\epsilon(h, k)$ tend vers zéro lorsque $\sqrt{h^2 + k^2}$ tend vers zéro.

Démonstration On développe successivement

$$\begin{aligned} f(x, y) &= f(x, y + k) + h \frac{\partial f}{\partial x}(x, y + k) + \frac{h^2}{2} \frac{\partial^2 f}{\partial x^2}(x, y + k) + h^2 \epsilon_1(h) \\ &= \left(f(x, y) + k \frac{\partial f}{\partial y}(x, y) + \frac{k^2}{2} \frac{\partial^2 f}{\partial y^2}(x, y) + k^2 \epsilon_2(k) \right) + h \left(\frac{\partial f}{\partial x}(x, y) + k \frac{\partial^2 f}{\partial y \partial x}(x, y) + k^2 \epsilon_3(k) \right) + \\ &\quad + \left(\frac{h^2}{2} \frac{\partial^2 f}{\partial x^2}(x, y) + h^2 \epsilon_4(k) \right) + h^2 \epsilon_1(h). \end{aligned}$$

d'où (3.2) après un regroupement des termes, en ayant remarqué que $|hk| \leq \frac{1}{2}(h^2 + k^2)$, ce qu'on obtient en écrivant $(|h| - |k|)^2 \geq 0$.

4 Analyse d'un extrémum local

Soit $(x_0, y_0) \in K$ tel qu'il existe $\eta > 0$ pour lequel $B_\eta(x_0, y_0) = \{(x + h, y + k) \mid \sqrt{h^2 + k^2} \leq \eta\} \subset K$, et f une fonction deux fois continuellement dérivable sur $B_\eta(x_0, y_0)$. Le point (x_0, y_0) correspond à un minimum local strict lorsque

$$\forall (h, k) \text{ si } 0 < \sqrt{h^2 + k^2} < \eta \text{ alors } f(x_0 + h, y_0 + k) > f(x_0, y_0).$$

A partir de la formule de Taylor, on obtient, en posant

$$A = \frac{\partial^2 f}{\partial x^2}(x_0, y_0), \quad B = \frac{\partial^2 f}{\partial x \partial y}(x_0, y_0), \quad C = \frac{\partial^2 f}{\partial y^2}(x_0, y_0),$$

l'inégalité

$$h \frac{\partial f}{\partial x}(x_0, y_0) + k \frac{\partial f}{\partial y}(x_0, y_0) + \frac{1}{2} (h^2 A + 2hkB + k^2 C) + (h^2 + k^2)\epsilon(h, k) > 0. \quad (4.1)$$

On prend $k = 0, h > 0$. En divisant par h puis en faisant $h \rightarrow 0$, il vient $\frac{\partial f}{\partial x}(x_0, y_0) \geq 0$. En prenant toujours $k = 0$, mais maintenant $h < 0$, on obtient, en faisant tendre h vers zéro, $\frac{\partial f}{\partial x}(x_0, y_0) \leq 0$.

On en déduit immédiatement que $\frac{\partial f}{\partial x}(x_0, y_0) = 0$.

De façon analogue, on reprend (4.1) où on prend $h = 0, k > 0$. En divisant par k puis en faisant $k \rightarrow 0$, il vient $\frac{\partial f}{\partial y}(x_0, y_0) \geq 0$. En prenant toujours $h = 0$, mais maintenant $k < 0$, on obtient, en faisant tendre k vers zéro, $\frac{\partial f}{\partial y}(x_0, y_0) \leq 0$. On en déduit immédiatement que $\frac{\partial f}{\partial y}(x_0, y_0) = 0$.

La formule (4.1) se réduit donc maintenant à

$$\frac{1}{2} (h^2 A + 2hkB + k^2 C) + (h^2 + k^2)\epsilon(h, k) > 0$$

En introduisant un paramètre λ tel que $h = \lambda k$, il vient

$$\frac{k^2}{2} (\lambda^2 A + 2\lambda B + C) + k^2(\lambda^2 + 1) \epsilon(\lambda k, k) > 0.$$

On divise par k^2 (qui est positif), pour obtenir, après passage à la limite lorsque $k \rightarrow 0$,

$$\lambda^2 A + 2\lambda B + C > 0. \quad (4.2)$$

Ce polynôme du second degré en λ n'a aucune racine réelle, et donc son discriminant réduit est strictement négatif, c'est à dire

$$B^2 - AC < 0. \quad (4.3)$$

On a réuni les conditions pour qu'un point (x_0, y_0) soit un minimum : (avec les notations précédentes)

$$\frac{\partial f}{\partial x}(x_0, y_0) = 0, \quad \frac{\partial f}{\partial y}(x_0, y_0) = 0, \quad B^2 - AC < 0, \quad A > 0. \quad (4.4)$$

En effet, si $A < 0$, on a nécessairement $C < 0$ pour satisfaire (4.3), et le polynôme (4.2) va devenir négatif pour les petites valeurs de λ .

On procède de façon similaire pour caractériser un maximum local. Le point (x_0, y_0) correspond à un maximum local strict lorsque

$$\forall(h, k) \text{ si } 0 < \sqrt{h^2 + k^2} < \eta \text{ alors } f(x_0 + h, y_0 + k) < f(x_0, y_0).$$

d'où l'inégalité, avec les mêmes notations que précédemment,

$$h \frac{\partial f}{\partial x}(x_0, y_0) + k \frac{\partial f}{\partial y}(x_0, y_0) + \frac{1}{2} (h^2 A + 2hkB + k^2 C) + (h^2 + k^2)\epsilon(h, k) > 0. \quad (4.5)$$

On prend $k = 0, h > 0$. En divisant par h puis en faisant $h \rightarrow 0$, il vient $\frac{\partial f}{\partial x}(x_0, y_0) \leq 0$. En prenant toujours $k = 0$, mais maintenant $h < 0$, on obtient, en faisant tendre h vers zéro, $\frac{\partial f}{\partial x}(x_0, y_0) \geq 0$.

On en déduit immédiatement que $\frac{\partial f}{\partial x}(x_0, y_0) = 0$.

De façon analogue, on reprend (4.5) et on prend $h = 0, k > 0$. En divisant par k puis en faisant $k \rightarrow 0$, il vient $\frac{\partial f}{\partial y}(x_0, y_0) \leq 0$. En prenant toujours $h = 0$, mais maintenant $k < 0$, on obtient, en faisant tendre k vers zéro, $\frac{\partial f}{\partial y}(x_0, y_0) \geq 0$. On en déduit immédiatement que $\frac{\partial f}{\partial y}(x_0, y_0) = 0$.

La formule (4.5) se réduit donc maintenant à

$$\frac{1}{2} (h^2 A + 2hkB + k^2 C) + (h^2 + k^2)\epsilon(h, k) < 0$$

En introduisant un paramètre λ tel que $h = \lambda k$, il vient

$$\frac{k^2}{2} (\lambda^2 A + 2\lambda B + C) + k^2(\lambda^2 + 1) \epsilon(\lambda k, k) < 0 .$$

On divise par k^2 (qui est positif), pour obtenir, après passage à la limite lorsque $k \rightarrow 0$,

$$\lambda^2 A + 2 \lambda B + C > 0 . \quad (4.6)$$

Ce polynôme du second degré en λ n'a aucune racine réelle, et donc son discriminant réduit est strictement négatif, c'est à dire

$$B^2 - AC < 0 . \quad (4.7)$$

On a réuni les conditions pour qu'un point (x_0, y_0) soit un maximum strict : (avec les notations précédentes)

$$\frac{\partial f}{\partial x}(x_0, y_0) = 0 , \frac{\partial f}{\partial y}(x_0, y_0) = 0 , B^2 - AC < 0 , A < 0 . \quad (4.8)$$

En effet, si $A > 0$, on a nécessairement $C > 0$ pour satisfaire (4.7), et le polynôme (4.6) va devenir positif pour les petites valeurs de λ .

Lorsque le point (x_0, y_0) est tel que

$$\frac{\partial f}{\partial x}(x_0, y_0) = 0 , \frac{\partial f}{\partial y}(x_0, y_0) = 0 , B^2 - AC > 0 ,$$

on est en présence d'un point selle, ou d'un col.

Enfin, lorsque le point (x_0, y_0) est tel que

$$\frac{\partial f}{\partial x}(x_0, y_0) = 0 , \frac{\partial f}{\partial y}(x_0, y_0) = 0 , B^2 - AC = 0 ,$$

il convient de procéder à une étude particularisée pour conclure.