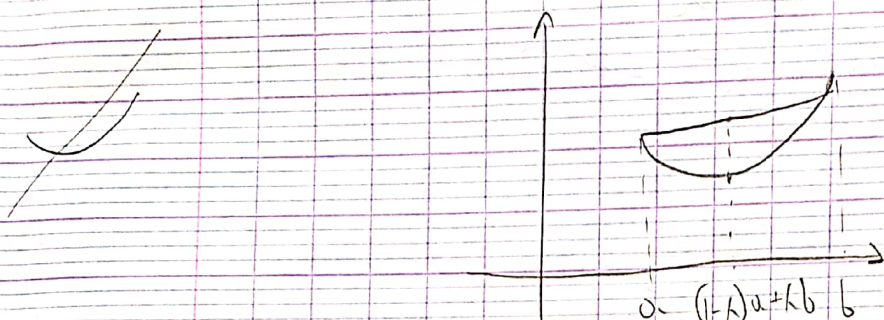


Fonctions convexes

I Définitions, pentes, régularité:

Données: I est un intervalle de \mathbb{R} , non trivial

si $(a, b) \in \mathbb{R}^2$ $[a, b] = \{(1-t)a + tb \mid t \in [0, 1]\}$
 Def: On dit que la fonction f est convexe lorsque:
 $\forall (a, b) \in I^2 \forall \lambda \in [0, 1]: f((1-\lambda)a + \lambda b) \leq (1-\lambda)f(a) + \lambda f(b)$



La droite qui joint $(a, f(a))$ à $(b, f(b))$ a pour eq
 $\Delta: x \mapsto \frac{f(b) - f(a)}{b - a} (x - a) + f(a)$

$$\Delta((1-\lambda)a + \lambda b) = (1-\lambda)f(a) + \lambda f(b)$$

✓ Ex: Maq f est convexe $\Leftrightarrow \text{Epi}(f) = \{(x, y) \in I \times \mathbb{R} \mid f(x) \leq y\}$

Th (3-pentes): si $a \in I, b \in I, P$ est convexe
 Soit $(a, b, c) \in I^3$ avec $a < b < c$, si f est convexe
 On a $P_{ab}(f) \leq P_{ac}(f) \leq P_{bc}(f)$

D) on écrit $b = (1-\lambda)a + \lambda c$ / $\lambda = \frac{b-a}{c-a}$
 alors on a $f(b) \leq (1-\lambda)f(a) + \lambda f(c)$

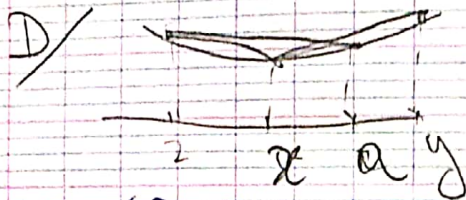
$$f(b) - f(a) \leq \lambda (f(c) - f(a)) = \frac{b-a}{c-a} (f(c) - f(a))$$

$$\text{d'où } \frac{f(b) - f(a)}{b-a} \leq \frac{f(c) - f(a)}{c-a}$$

✓ Ex pro: prouver les autres (écrire et vérifier)

condition de b. prouve: si f vérifie $(*)$, elle est *convexe*

Cor: Si $a \in I$, $P_a: (I \setminus \{a\}) \rightarrow \mathbb{R}$
 $x \mapsto \frac{f(x) - f(a)}{x - a}$ est *croissante*

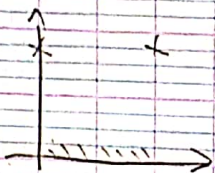


$$P_a(z) \leq P_{ay} \leq P_{ax} = P_a(x) \text{ avec } P_a \text{ tr}$$

Régularité:

$$\Delta \quad f = 0 \text{ sur }]0,1[\quad , \quad f(0) = f(1) = 1$$

f est convexe sur $[0,1]$.



Soit $f: I \rightarrow \mathbb{R}$ une fonction convexe, et a un point intérieur à I . Alors (1) f possède des dérivées à droite et à gauche et

$$(2) \quad f'_-(a) \leq f'_+(a)$$

(3) f est C^0 en a

D/ On regarde la fonction $x \mapsto P_a(x)$ $I \setminus \{a\} \rightarrow \mathbb{R}$
 Comme a est intérieur à I , on peut trouver $b \in I$ tel que $b > a$.

il vient avec le th des 3 pentes $\frac{f(b) - f(a)}{b - a} \leq P_a(b) \leq P_a(b)$, pour $x < a$

Or P_a est croissante majorée sur $]-\infty, a[\cap I$

elle possède une limite en a . $\exists f'_g(a)$. De m $\exists f'_g(a)$

En fait, si $x, y \in I$ et $x < a < y$, on a

$$P_a(x) \leq P_a(y) \quad \left| \begin{array}{l} x \rightarrow a \\ y \rightarrow a \end{array} \right. \quad f'_g(a) \leq f'_g(b)$$

Continuité ; à droite en a . il existe $\eta > 0$ tel $\forall x \in]a, a+\eta[$

$$\left| \frac{f(x) - f(a)}{x - a} - f'_g(a) \right| < \epsilon$$

$$|f(x) - f(a)| < \underbrace{(1 + |f'_g(a)|)}_{\rightarrow 0} (x - a)$$

Cor: Si la fct $f: I \rightarrow \mathbb{R}$ est convexe et dérivable sur I , sa dérivée f' est croissante

(Vérifier pour les extrêmes de I)

D/ Soit $a < b$ dans I
soit $x \in]a, b[$

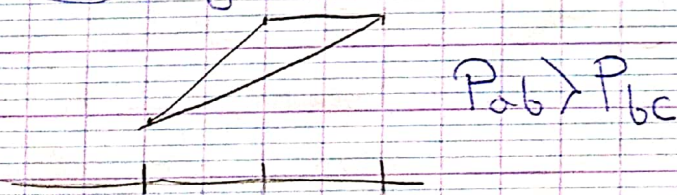
il vient $f'_g(a) = f'_g(x) = \inf_{y \in]a, x[} P_a(y) \leq P_a(x) \leq P_a(b) \leq \sup_{y \in]x, b[} P_b(y) = f'_g(b)$

(lim monotone inf)

✓ Ex pers: f'_g et f'_b sont croissantes sur I $\Rightarrow f'_g(b) = f'_b(b)$

Th: Soit $f: I \rightarrow \mathbb{R}$, dérivable. Si f' est croissante alors f est convexe.

D/ (ABS) si f n'est pas convexe: $\exists a < b < c$ tq



TAF: $\exists a' \in]a, b[$ tq $f'(a') = \frac{f(b) - f(a)}{b - a} = P_{ab}$

$$\exists b' \in]b, c[\text{ tel } f'(b') = \frac{f(c) - f(b)}{c - b}$$

De là $a' < b'$ et $f'(a') > f'(b')$, absurde

Cor: si $f \in \Delta^2(I, \mathbb{R})$, fait convexe si $f'' \geq 0$

D/ fait convexe $\Leftrightarrow f' \nearrow \Leftrightarrow f'' \geq 0$

th: (Pos pour tout a-b tangente) Soit $f \in \Delta^2(I, \mathbb{R})$
alors $\forall a \in I \forall x \in I \quad f(x) \geq f(a) + f'(a)(x-a)$

$$\text{D/ Si } x < a \quad \frac{f(a) - f(x)}{a - x} = P_a(x) \leq \sup_{y \in]x, a} P_a(y) = f'(a)$$

$$f(a) - f(x) \leq f'(a)(a - x)$$

$$\text{Si } x > a \quad \frac{f(x) - f(a)}{x - a} \geq \inf_{y \in]a, x} P_a(y) = f'(a) \text{ et donc } f(x) - f(a) \geq f'(a)(x - a)$$

Conséquence: Si $f'(a) = 0$, a est un min absolu
 $[f(a) = \min_{x \in I} f(x)]$

II Inégalités de convexité

a- Fonctions strictement convexes

Def: La fonction $f: I \rightarrow \mathbb{R}$ est dite strictement convexe lorsque $\forall (a, b) \in I^2 \quad \forall \lambda \in]0, 1[\quad a < b$
 $\Rightarrow f((1-\lambda)a + \lambda b) < (1-\lambda)f(a) + \lambda f(b)$

Critère Caractérisation: si $f \in \Delta^2(I, \mathbb{R})$ et si f' est strictement croissante, f est strictement convexe
 Si $f \in \Delta^2(I, \mathbb{R})$ et si $f'' > 0$, f est strictement convexe

~~⚠ g croissante \Leftrightarrow f strictement convexe si $f \in \mathcal{C}^2(I, \mathbb{R})$ et si $f'' > 0$, f est strict convexe~~

⚠ g \nearrow g croissante $\Leftrightarrow g' \geq 0$ (IAF)
 g strictement croissante $\Leftrightarrow g' > 0$ et (2)

(2) $Z(g) = \{x \in I \mid g'(x) = 0\}$ est d'intérieur vide
 ie $Z(g)$ ne contient aucun intervalle non trivial

(F fermé non-conv. $F = [a, b]$; $f(x) = \int_a^x (g, F) dy$)

En effet: si $[a, b] \subset Z(g')$ avec $a < b$, g' est nulle sur $[a, b]$ donc g est constante sur $[a, b]$

si g n'est pas strict. croissante: $\exists a < b$ tq $g(a) = g(b)$

donc g | $[a, b]$ est constante $[a, b] \subset Z(g')$

b. inégalité fondamentale:

Th: Soit $f: I \rightarrow \mathbb{R}$ convexe, $m \in \mathbb{N} \setminus \{1, 0\}$ $x_1, \dots, x_m \in I$

$\lambda_1, \dots, \lambda_m \in \mathbb{R}^+$ tq $\lambda_1 + \dots + \lambda_m = 1$

Alors $f(\sum_{i=1}^m \lambda_i x_i) \leq \sum_{i=1}^m \lambda_i f(x_i)$ (*)

si de plus f est strict. convexe et $\lambda_1 > 0, \dots, \lambda_m > 0$
 l'égalité (*) implique $x_1 = \dots = x_m$

D/ Récurrence: $m=2$, c'est la convexité de la f et g

$m \geq 3$: si $\lambda_m = 1$, $x_1 = \dots = x_{m-1} = \odot \in I$

On suppose $\lambda_m < 1$, d'où $1 - \lambda_m = \sum_{i=1}^{m-1} \lambda_i > 0$

$$f(\lambda_1 x_1 + \dots + \lambda_m x_m) = f\left((1 - \lambda_m) \left(\frac{\lambda_1}{1 - \lambda_m} x_1 + \dots + \frac{\lambda_{m-1}}{1 - \lambda_m} x_{m-1}\right) + \lambda_m x_m\right)$$

$$\leq (1 - \lambda_m) f\left(\frac{\lambda_1}{1 - \lambda_m} x_1 + \dots + \frac{\lambda_{m-1}}{1 - \lambda_m} x_{m-1}\right) + \lambda_m f(x_m)$$

(HR) \Rightarrow

$$\sum_{i=1}^m \lambda_i f(x_i) + \dots + \lambda_m f(x_m)$$

\rightarrow Si f est strictement convexe :

On suppose WLOG : $\lambda_1 \leq \dots \leq \lambda_m$

On examine la preuve $x = \mu_1 x_1 + \dots + \mu_m x_m$

$$\text{si } x < x_m \text{ il vient } f((1-t)x + tx_m) < (1-t)f(x) + tf(x_m)$$

$$\left(\lambda_1 f(x_1) + \dots + \lambda_m f(x_m) \right)$$

Pos d'égalité

Donc s'il y a égalité $x = x_m$

si x_1, \dots, x_m ne sont pas tous égaux

$$f(\mu_1 x_1 + \dots + \mu_{m-1} x_{m-1}) < \mu_1 f(x_1) + \dots + \mu_{m-1} f(x_{m-1})$$

(HR)

\rightarrow inégalité stricte donc $\lambda_1 = \dots = \lambda_m = \lambda = \lambda_n$

APPL: IAG

Soient $x_1, \dots, x_m \in \mathbb{R}^+$, On a $\sqrt[m]{x_1 \dots x_m} \leq \frac{1}{m}(x_1 + \dots + x_m)$
égalité ssi $x_1 = \dots = x_m$

D/ On suppose $x_1 > 0, \dots, x_m > 0$
on pose alors $y_i = \log x_i, i = 1, \dots, m$

$$\sqrt[m]{x_1 \dots x_m} = e^{\frac{1}{m} \sum_{i=1}^m \log x_i} = \frac{1}{m} (e^{y_1} + \dots + e^{y_m}) = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m x_i$$

20

le cas d'égalité provient de la structure convexe de exp.

Ex: (Min) $a, b, c > 0$ données (Sol: AMGM)
 Etudier $\inf_{\substack{x > 0 \\ y > 0}} (ax + by + \frac{c}{xy})$

Compléments: Méthode de Cauchy

Archimède: $\sqrt{x_1 x_2} \leq \frac{1}{2} (x_1 + x_2)$

$$\sqrt[2^m]{x_1 x_2 x_3 \dots x_m} \leq \frac{1}{2} (\sqrt{x_1 x_2} + \sqrt{x_3 x_4}) \leq \frac{1}{4} (x_1 + x_2 + x_3 + x_4)$$

$$\sqrt[2^m]{x_1 \dots x_m} \leq \frac{1}{2^m} (x_1 + \dots + x_m)$$

Soit $N \in \mathbb{N}$ puis $m: 2^m > N = y$

On prend $x_{N+1} = \dots = x_{2^m} = \frac{y}{2^m - N}$ il vient

$$\sqrt[2^m]{x_1 \dots x_N \underbrace{y \dots y}_{2^m - N}} \leq \frac{1}{2^m} (x_1 + \dots + x_N + (2^m - N)y)$$

$$y \leq \frac{2^m - N}{2^m} y + \frac{1}{2^m} (x_1 + \dots + x_N)$$

$$\frac{N}{2^m} y \leq \frac{1}{2^m} (x_1 + \dots + x_N) \quad \sqrt[2^m]{x_1 \dots x_N} \leq \frac{1}{N} (x_1 + \dots + x_N)$$

Autre: $x_i > 0$

$$x_1 \dots x_m = 1 \Rightarrow x_1 + \dots + x_m \geq m$$

il y a au moins 1 terme ≥ 1 et 1 terme ≤ 1

On peut esp $x_1 \leq 1, x_2 \geq 1$

Suffisant
 $y_i \rightarrow x_i$
 $k = \frac{1}{\sqrt[2^m]{x_1 \dots x_m}}$

Récurrente
d'où $(1-\lambda_1)(\lambda_2-1) \geq 0$ et donc $\lambda_1 \lambda_2 \geq 1 + \lambda_1 \lambda_2$

$$(\lambda_1 \lambda_2)(\lambda_3 \dots \lambda_m) = 1 \Rightarrow \lambda_1 \lambda_2 + \lambda_3 + \dots + \lambda_m \geq m-1 \quad (*)$$

$$\Rightarrow \lambda_1 + \lambda_2 + \dots + \lambda_m \geq 1 + \lambda_1 \lambda_2 + \dots + \lambda_2 \lambda_m$$

→ COMPLÈMENTS:

1. Soit $f \in \mathcal{C}(\mathbb{R}, \mathbb{R})$ on suppose :

$$\forall (x, y) \in \mathbb{R}^2 \quad f\left(\frac{x+y}{2}\right) \leq \frac{1}{2}(f(x) + f(y)) \quad (*)$$

Mq f est convexe

S/ On montre que $\forall k \in [0, 1]$ toujours on a

$$f((1-k)a + kb) \leq (1-k)f(a) + kf(b)$$

$k = \frac{1}{2}$ OK (hyp) $k = \frac{1}{4}$ on veut mq $f\left(\frac{3}{4}a + \frac{1}{4}b\right) \leq \frac{3}{4}f(a) + \frac{1}{4}f(b)$

$$\frac{1}{a} \quad \frac{1}{c} \quad \frac{1}{\frac{a+b}{2}}$$

$$c = \frac{1}{2}a + \frac{1}{2}\left(\frac{a+b}{2}\right)$$

$$f(c) \leq \frac{1}{2}f(a) + \frac{1}{2}f\left(\frac{a+b}{2}\right) \leq \frac{3}{4}f(a) + \frac{1}{4}f(b)$$

1. Suite: $\frac{1}{(1-k)a + kb} \leq \frac{2^{p+1}}{2^m}, m \geq 3, 2^{p+1} > 2^{m-1}$

2. Ex (X-ENS) : On suppose $(*)$ vérifiée, et que f est bornée en tout segment. Mq f convexe (on sait que f est \mathcal{C}^1)

S/ Réduction du problème.

On peut supposer $x=0$ (translation sur x)

$f(0)=0$ (translation sur y)

Soit f Mm convexe de f sur $(-1, 1)$

Pour tout $x \in (-1, 1)$

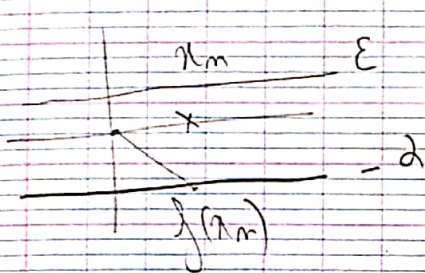
$$f\left(\frac{x}{2}\right) = f\left(\frac{0+x}{2}\right) \leq \frac{1}{2}(f(0) + f(x)) = \frac{1}{2}f(x)$$

Pour récurrence inverse: $\forall x \in [-\frac{1}{2^m}, \frac{1}{2^m}] f(x) \leq \frac{M}{2^m}$

Soit $\varepsilon > 0 \exists m \frac{M}{2^m} < \varepsilon$ et donc

$\exists \eta > 0, \forall x \in [-\eta, \eta] f(x) < \varepsilon$

Négation de la ϵ - δ : $\exists \alpha > 0 \exists (x_m) \rightarrow 0 \forall m f(x_m) \geq \alpha$



$$\exists \alpha > 0 \exists (x_m) \rightarrow 0 \forall m f(x_m) \geq \alpha$$

$$f\left(\frac{-x_m + x_m}{2}\right) \leq \frac{1}{2}(f(x_m) + f(-x_m))$$

$$-f(x_m) \leq f(-x_m)$$

$$\alpha \leq f(-x_m) \quad \text{ABS}$$

2. Inégalité de Hölder et Minkowski

Exposants conjugués: $p > 0, q > 0, \frac{1}{p} + \frac{1}{q} = 1$

$$\forall (x_i), (y_i) \in \mathbb{R}^m \quad \left| \sum_{i=1}^m x_i y_i \right| \leq \left(\sum_{i=1}^m |x_i|^p \right)^{1/p} \left(\sum_{i=1}^m |y_i|^q \right)^{1/q}$$

S/ On se souvient que $x_i > 0, y_i > 0, i = 1 \dots m$

(i) $\forall (x, y) \in]0, +\infty[$, $xy \leq \frac{1}{p} x^p + \frac{1}{q} y^q$

$$\left. \begin{array}{l} x = e^{\alpha t} \\ y = e^{\beta t} \end{array} \right\} xy = e^{\alpha t + \beta t} = e^{\frac{1}{p}(p\alpha) + \frac{1}{q}(q\beta)} \leq \frac{1}{p} (e^{\alpha t})^p + \frac{1}{q} (e^{\beta t})^q$$

$$= \frac{1}{p} x^p + \frac{1}{q} y^q$$

(ii) On pose $A = \left(\sum_{i=1}^m |x_i|^p \right)^{1/p}$ $B = \left(\sum_{i=1}^m |y_i|^q \right)^{1/q}$

normalisation $\left\{ \frac{x_i}{A} \times \frac{y_i}{B} \leq \frac{1}{p} \frac{x_i^p}{A^p} + \frac{1}{q} \frac{y_i^q}{B^q} \right.$

On pose $\frac{1}{AB} \sum_{i=1}^m x_i y_i \leq \frac{1}{A^p} \sum_{i=1}^m x_i^p + \frac{1}{B^q} \sum_{i=1}^m y_i^q$

Passage aux intégrales Somme de Riemann

On peut aussi poser $A = \left(\int_a^b |f|^p \right)^{1/p}$ $B = \left(\int_a^b |g|^q \right)^{1/q}$

→ supposer $A > 0, B > 0$

$$\frac{\int_a^b |f| |g|}{AB} \leq \frac{1}{A^p} \int_a^b |f|^p + \frac{1}{B^q} \int_a^b |g|^q$$

3 - Quasi linéarisation, Minkowski

Soient L une fonction $\mathbb{R}^m \times \mathbb{R}^m \rightarrow \mathbb{R} \cup \{+\infty\}$ bornée sur les fonctions bornées

↳ $\forall y \in \mathbb{R}^m, x \mapsto L(x, y)$ est linéaire

Soit $B \subset \mathbb{R}^m$ bornée Alors $f(x) = \sup_{y \in B} L(x, y)$ est

convexe additive $y \in B$

$g(x) = \inf_{y \in B} L(x, y)$ est concave additive

D/ Soit $u, u' \in (\mathbb{R}^m)^2$ et soit $y \in B$

On a $L(u+u', y) \leq L(u, y) + L(u', y) \leq f(u) + f(u')$
 $L(u+u', y) = L(u, y) + L(u', y) \leq f(u) + f(u')$

$$\sup_{y \in B} L(u+u', y) \leq f(u) + f(u')$$

$$f(u+u')$$

$p > 1$
 On va voir $\forall q \forall (x_1, \dots, x_m) \in]0, +\infty[{}^m \mid \left(\sum_{i=1}^m (x_i + y_i)^p \right)^{1/p}$
 $\forall (y_1, \dots, y_m) \in]0, +\infty[{}^m \mid \left(\sum_{i=1}^m y_i^p \right)^{1/p} + \left(\sum_{i=1}^m x_i^p \right)^{1/p}$

i) Soit $q > 0$ tq $\frac{1}{p} + \frac{1}{q} = 1$. soit $A = \left\{ \left(\sum_{i=1}^m x_i^p \right)^{1/p} \mid \sum_{i=1}^m x_i^q = 1 \right\}$

Alors $\sup_{z_i \in A} \sum_{i=1}^m x_i z_i = \left(\sum_{i=1}^m x_i^p \right)^{1/p}$ (?)

D/ $\sum_{i=1}^m x_i z_i < \left(\sum_{i=1}^m x_i^p \right)^{1/p} \times \left(\sum_{i=1}^m z_i^q \right)^{1/q} = \left(\sum_{i=1}^m x_i^p \right)^{1/p}$

$z_i = k x_i^{p-1} \quad k > 0$

$z_i^q = k^q x_i^{(p-1)q} \quad k > 0 \mid \sum_{i=1}^m z_i^q = 1$

$z_i^q = k^q x_i^{(p-1)q} = k^q x_i^p \mid$ on prend $k = \frac{1}{\left(\sum_{i=1}^m x_i^p \right)^{1/q}}$

il vient $\sum_{i=1}^m x_i z_i = \sum_{i=1}^m k x_i^p = \frac{\sum_{i=1}^m x_i^p}{\left(\sum_{i=1}^m x_i^p \right)^{1/q}} = \left(\sum_{i=1}^m x_i^p \right)^{1/p}$

(cc) il en résulte que $\forall x_1, \dots, x_m \geq 0 \rightarrow \left(\sum_{i=1}^m x_i^p \right)^{1/p}$ est sous-additif.

4 - inégalité de Jensen (AHP)

Soit $g \in \mathcal{C}(\mathbb{R}, \mathbb{R})$, convexe, $f \in \mathcal{C}([a, b], \mathbb{R})$ alors

① il existe une famille $\{\varphi_k\}_{k \in \mathbb{N}}$ de fonctions affines tq $g = \sup_{k \in \mathbb{N}} \varphi_k$

② $g\left(\frac{1}{b-a} \int_a^b f\right) \leq \frac{1}{b-a} \int_a^b g \circ f$

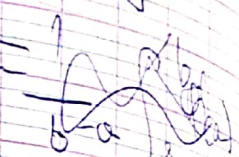
① Soit $\varphi_a: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R} + \mathbb{R}_0^+(x-a)$
 si $x=a$ $\varphi_a(x) = g(x)$

Si $x < a$ $\frac{g(x)-g(a)}{x-a} = \varphi_a(x) < g'(a)$

si $x > a$ $\frac{g(x)-g(a)}{x-a} > g'(a)$

Ainsi $\varphi_a \leq g$ | et si $h \in \mathcal{G}$ continue les φ_a sont
 Soit $h = \sup_{a \in \mathbb{R}} \varphi_a$ | et si Soit $a \in \mathbb{R}$ $h(a) = \varphi_a(a) = g(a)$

φ_a étant affine $\varphi_a\left(\frac{1}{b-a} \int_a^b g\right) = \frac{1}{b-a} \int_a^b \varphi_a(g(t)) dt$



de là $\varphi_a\left(\frac{1}{b-a} \int_a^b g\right) \leq \frac{1}{b-a} \int_a^b \varphi_a(g(t)) dt$ (par la propriété de majoration)
 $\sup g\left(\frac{1}{b-a} \int_a^b g\right) \leq \frac{1}{b-a} \int_a^b g(f(t)) dt$

Inégalité et variables aléatoires $X: \Omega \rightarrow E$
~~Inégalité et variables aléatoires~~ \mathbb{P} probabilité sur \mathcal{F}

$\forall x \in E \ X^{-1}(x) = \{\omega \in \Omega \mid X(\omega) = x\}$

on pose $P(x) = P(X^{-1}(x))$

$E(X) = \sum_{x \in E} P(x) \cdot x$

si f est convexe: $f(E(X)) = f\left(\sum_{x \in E} P(x) \cdot x\right)$

$$\mathbb{E} \left[\sum_{x \in \mathbb{Z}} P(X=x) g(x) \right] = \mathbb{E}(g \circ X)$$

Commutativ

⊛⊛ X, Y densc $\forall A, a' \text{ volem } \in \mathbb{E}(C, \mathbb{R})$

$$|\mathbb{E}(XY)| \leq \mathbb{E}(X^2)^{1/2} \mathbb{E}(Y^2)^{1/2}$$

Hölder

$$\mathbb{E}(|x|^p)^{1/p} \leq \mathbb{E}(|y|^q)^{1/q}$$

$$p, q > 0 \quad \frac{1}{p} + \frac{1}{q} = 1$$