

Objectifs et présentation du cours –Pré requis

Le pré requis de ce cours est le cours de Mathématiques1 (niveau L1). Il se place dans sa continuité.

L'objectif de ce cours est le même que celui de L1, l'acquisition de l'outil mathématique nécessaire pour aborder les statistiques et résoudre les problèmes liés à l'économie et la gestion.

Il y a deux parties essentielles : l'analyse et l'algèbre linéaire.

La partie **analyse** figure dans les leçons 1 à 3, 6 et 7. L'objectif en est l'approfondissement des fonctions de deux variables et une généralisation naturelle à plusieurs variables dans le but d'optimiser celles-ci avec ou sans contrainte. Les problèmes d'optimisation économiques se présentant souvent dans un contexte de convexité facilitant la résolution, cette notion de convexité est présentée le plus simplement possible.

Les problèmes économiques se présentent souvent sous forme séquentielle lorsque le temps est envisagé comme discret et non continu. D'où les deux chapitres 1 et 6 sur les suites.

La partie **algèbre linéaire** est traitée dans les leçons 4 et 5. C'est là encore un approfondissement du cours de L1. L'objectif est de maîtriser le calcul matriciel et d'aborder la réduction d'une matrice en vue de résoudre des systèmes linéaires séquentiels d'ordre 1 et plus tard des systèmes différentiels.

Voici une présentation des différentes leçons destinée à guider l'étudiant et le tuteur et à aider à dégager les points fondamentaux.

Leçon 1 : "Suites" présente la notion de suite et les généralités s'y rattachant en s'attardant sur les suites récurrentes d'ordre 1 ou u_{n+1} est une fonction de u_n (ne pas confondre avec les suites de la forme $u_n = f(n)$!). On donne un rappel sur les suites dont on doit savoir parfaitement les propriétés, les suites arithmétiques (et le raisonnement par récurrence qui est très important), et les suites géométriques (et le calcul financier en application).

Leçon 2 : traite des "fonctions à plusieurs variables". Elle reprend des notions déjà vues en L1 et les approfondit. La maîtrise des dérivées partielles est indispensable. Il faut savoir utiliser convenablement le théorème des fonctions implicites. La notion de fonction homogène et ses propriétés sont importantes car de telles fonctions sont couramment utilisées en économie.

Leçon 3 : est fondamentale puisqu'elle traite de l'optimisation avec et sans contrainte. Tout ce qui figure dans ce chapitre est important et il faut savoir résoudre tous les problèmes d'optimisation proposés et maîtriser les notions d'extremum local et d'extremum global. Parfois, pour la recherche de points stationnaires les calculs sont difficiles, c'est un problème technique qui ne doit pas arrêter. D'ailleurs souvent les exercices sont posés sous la forme "montrer que "tel point" est un point stationnaire" pour éviter les complications dues aux calculs. Dans le cas d'une optimisation sous contrainte on précisera alors le multiplicateur de Lagrange associé.

Dans le cas de l'optimisation sous contrainte la condition du second ordre est difficile à vérifier, on ne le fera que si c'est explicitement demandé et dans ce cas les calculs seront simples et feront parfois appel aux développements limités.

Leçons 4 et 5 : sont les deux leçons d'algèbre. Il faut bien sûr bien maîtriser les opérations sur les matrices. La technique d'inversion de matrice n'est pas à connaître (de simple calculatrice permettent de le faire aisément) mais on doit savoir mettre en place le système permettant de le faire. Il faut savoir déterminer une matrice de passage entre deux bases d'un même espace vectoriel et l'utiliser pour passer de la matrice d'une application linéaire dans une base à celle de la même application dans une autre base.

Tout le paragraphe concernant la diagonalisation des matrices est important. Il faut aussi savoir reconnaître un vecteur propre et le déterminer ainsi que les valeurs propres.

Leçon 6 : traite des suites linéaires récurrentes d'ordre 1 et 2. Les techniques décrites dans ce chapitre sont à savoir. On n'oubliera de connaître la méthode à utiliser en cas de résonance.

Leçon 7 : introduit la notion de fonctions à plusieurs variables concaves et convexes qui sont souvent utilisées en économie. La difficulté réside dans la détermination de la convexité de ces fonctions. On se limitera aux cas simples. Dans ce cadre la recherche d'extremum se simplifie dans la mesure où l'étude de la condition du premier ordre suffit. C'est l'essentiel à retenir.