Feuille 4

Exercice 1. Pour chacune des fonctions suivantes, dire si elle est convexe ou concave ou ni l'un ni l'autre

1. $f(x) = e^x - 1$ sur $\mathbb{R}$;
2. $f(x_1, x_2) = x_1 x_2$ sur $\mathbb{R}^2_{+*}$
3. $f(x_1, x_2) = 1/(x_1 x_2)$ sur $\mathbb{R}^2_{+*}$
4. $f(x_1, x_2) = x_1/x_2$ sur $\mathbb{R}^2_{+*}$
5. $f(x_1, x_2) = x_1^2/x_2$ sur $\mathbb{R} \times \mathbb{R}_{+*}$
6. $f(x_1, x_2) = x_1^\alpha x_2^{1-\alpha}$ sur $\mathbb{R}^2_{+*}$

Exercice 2. Trouver le rayon de la sphère de $\mathbb{R}^3$ centrée en $(1, 0, 2)$ tangente au plan d'équation $x_1 + x_2 + x_3 = 1$.

Exercice 3. Trouver la valeur maximale de $f(x, y, z) = x + z$ sur la sphère $x^2 + y^2 + z^2 = 1$ (par la méthode de Lagrange).

Exercice 4. On désire construire la plus grande boîte possible de surface donnée S. Trouver les dimensions de cette boîte (c'est un pavé). Et si on souhaite doubler le fond pour le renforcer ?

Exercice 5. La température sur la sphère $x^2 + y^2 + z^2 = 4$ est donnée par $T(x, y, z) = 2 + xz + y^2$.
Trouver les points les plus chauds et les points plus froids.

Exercice 6. Les revenus de trois ménages sont : 2, 1, 1. Leurs fonctions d'utilité sont toutes identiques : $x \mapsto \sqrt{x}$. On souhaite distribuer une unité de revenu supplémentaire. Comment faut-il la répartir entre les trois ménages pour que la somme des utilités soit la plus grande possible ?

Exercice 7. On considère un ensemble de n agents économiques. Ils ont tous la même fonction d'utilité $x \mapsto x^\alpha$. Pour quelle répartition des revenus la somme des fonctions d'utilité est-elle maximale ?

Exercice 8. On considère la fonction ϕ définie sur $\mathbb{R}^2$ par

$$\phi(x_1, x_2) = x_1^3 + 4x_1^2 - x_2^2 + 5x_1 + 4x_2.$$

Trouver les extrema de ϕ sur l'ensemble C défini par les contraintes

$$x_2 - x_1 \geq 2, \quad x_1 + x_2 \leq 3.$$

Exercice 9. Soit A une matrice définie positive de taille $d \times d$, D une matrice $r \times d$ de rang r (avec $r \leq d$) et b et un vecteur de $\mathbb{R}^d$ et v un vecteur de $\mathbb{R}^r$. Montrer que la fonction

$$J(x) = \frac{1}{2}\langle Ax, x\rangle - \langle b, x\rangle$$

sous la contrainte $Dx = v$ a un unique minimum global en un point que l'on déterminera. Que se passe-t-il si on change la contrainte en $Dx \leq v$?