

CHAPITRE 6

ESPACES COMPACTS

Soit (E, d) un espace métrique et $A \subset E$ un sous-ensemble.

Définition: on appelle recouvrement ouvert de l'ensemble A , toute famille $(O_i)_{i \in I}$ d'ouverts de E telle que $A \subset \bigcup_{i \in I} O_i$.

Définition: un sous-ensemble $K \subset E$ est dit compact si pour tout recouvrement ouvert de K $K \subset \bigcup_{i \in I} O_i$, il existe un sous recouvrement fini i.e.:

il existe un nombre fini d'indices $\{i_1, \dots, i_k\} \subset I$ tels que: $K \subset O_{i_1} \cup \dots \cup O_{i_k}$

Exemple: Tout ensemble fini est compact

Grosse exemple: \mathbb{R} (avec sa métrique usuelle) n'est pas compact car du recouvrement $O_i =]i-2, i+2[$ on ne peut extraire de sous recouvrement fini $i \in \mathbb{Z}$

Proposition: Toute réunion finie $K_1 \cup \dots \cup K_p$ de compacts de (E, d) est un compact.

dém: si $p=2$ $K = K_1 \cup K_2$. Soit $(O_i)_{i \in I}$ un recouvrement ouvert de K . C'est aussi un recouvrement ouvert de K_1 (resp. de K_2) donc il existe un sous recouvrement fini de K_1

$$K_1 \subset O_{i_1} \cup \dots \cup O_{i_m}$$

(sup. un sous recouvrement fini de K_2 :
 $K_2 \subset O_{j_1} \cup \dots \cup O_{j_m}$)

Mais alors $O_{i_1} \cup \dots \cup O_{i_m} \cup O_{j_1} \cup \dots \cup O_{j_m}$ est un sous recouvrement fini de K donc K est compact. On raisonne réciproquement par récurrence sur p .

Attention: une réunion quelconque de compacts n'est pas forcément un compact! Par exemple si $E = \mathbb{R}$, pour tout entier $n \geq 0$, l'ensemble fini $A_n = \{0, 1, 2, \dots, n\}$ est compact mais $\bigcup_{n=0}^{\infty} A_n = \mathbb{N}$ n'est pas compact!

(A) Propriétés générales des compacts.

Dans ce paragraphe (E, d) est un espace métrique quelconque.

Théorème 1: Tant compact est un ensemble fermé

dém: Soit $K \subset E$ un compact. On va prouver que K^c est ouvert :

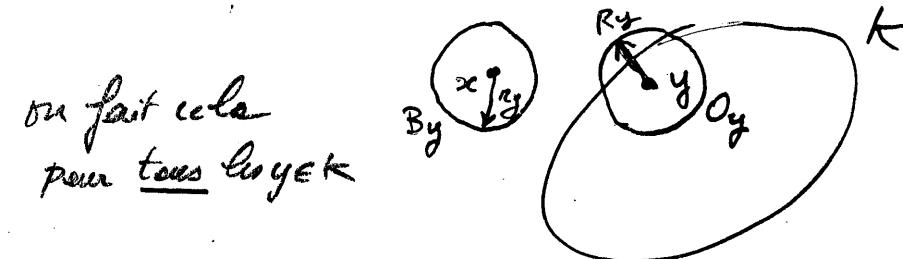
Soit $x \in K^c$ un point fixe.

Pour tout $y \in K$, on considère des boules ouvertes

$B_y = B(x, r_y)$ de centre x et de rayon r_y

$O_y = B(y, R_y)$ de centre y et de rayon R_y

tels que $r_y < \frac{1}{2}d(x, y)$ et $R_y < \frac{1}{2}d(x, y)$



on fait cela pour tous les $y \in K$

Lorsque y décrit K , les $(O_y)_{y \in K}$ forment un recouvrement

³ ouvert de K . Comme K est compact, il existe un nombre fini de points $y_1, \dots, y_m \in K$ t.q. :

$$K \subset O_{y_1} \cup O_{y_2} \cup \dots \cup O_{y_m} = W$$

Considérons $V = B_{y_1} \cap B_{y_2} \cap \dots \cap B_{y_m}$. C'est un voisinage ouvert de x qui (par construction des B_y) n'intersecte pas W . Donc $V \subset K^c$, ce qui prouve que tout point $x \in K^c$ possède un voisinage ouvert entièrement inclus dans K^c

$\Rightarrow K^c$ est ouvert cqd.

Théorème 2: Tant fermé inclus dans un compact est lui-même compact.

dém: Soient $F \subset K \subset E$ avec K compact et F fermé. Soit $(O_i)_{i \in I}$ un recouvrement ouvert de F . Si on adjoint l'ensemble ouvert F^c à la famille $(O_i)_{i \in I}$ on obtient un recouvrement ouvert de K dont on peut extraire un sous recouvrement fini qui recouvre aussi F

Si le recouvrement contient F^c , on peut enlever F^c (qui ne contient aucun point de F) et on obtient un sous-recouvrement fini d'ouverts qui recouvrent F . Donc F est compact cqd.

Corollaire: Une intersection quelconque $\bigcap_{j \in J} K_j$ de compacts de (E, d) , est un compact.

dém^m: $\bigcap_{j \in J} K_j$ est un fermé (comme intersection quelconque de fermés) qui est inclus dans le compact K_j . Donc $\bigcap_{j \in J} K_j$ est compact d'après le théorème.

Il y a encore une autre propriété importante des compacts : la bornitude comme on va le voir maintenant.

Définition: Un ensemble $A \subset E$ est borné si il est inclus dans une boule $B(x_0, R)$ de rayon fini.

On notera que cette définition est indépen-

5
dante du centre $x_0 \in E$ de la boule. En effet si on prend un autre point $y_0 \in E$, on a

$$\forall x \in A, d(y_0, x) \leq d(y_0, x_0) + \underbrace{d(x_0, x)}_{< R},$$

donc $A \subset B(y_0, R')$, avec $R' = d(y_0, x_0) + R$.

Exemple: dans \mathbb{R} , un sous-ensemble est borné si et seulement s'il est majoré et minoré (i.e. s'il existe m et $M \in \mathbb{R}$ tels que $\forall x \in A, m \leq x \leq M$)

Théorème 3: Tout compact est un ensemble borné

dém^m: Soit $x_0 \in E$ un point fixe. S'il n'existe pas de $R > 0$ tel que $A \subset B(x_0, R)$, alors il existe une suite (x_n) de points de A tels que

$$d(x_0, x_n) \xrightarrow{n \rightarrow \infty} +\infty$$

En passant éventuellement à une sous-suite, on peut supposer $d(x_{n+1}, x_n) > 1$ pour tout n .

Si on considère le recouvrement ouvert de A par les boules $(B(x, \frac{1}{z}))_{z \in A}$, on ne peut manifestement pas en extraire un recouvrement fini car les boules $B(x_n, \frac{1}{z})$ sont disjointes 2 à 2 et contiennent chacune au moins un point de A cqd.

Corollaire: Tout compact est un ensemble fermé et borné.

dém: décale directement des Thm 1 et 3 cqd

Remarque: On verra au prochain paragraphe que dans un espace normé de dimension finie, la réciproque est vraie : tout ensemble fermé borné est compact. Mais ceci est faux en dimension infinie. Par exemple :

Exercice: Considérons l'espace $\ell^1(\mathbb{R})$ des $x = (x_n)_{n \geq 0}$ avec la norme $\|x\|_1 = \sum_{n=1}^{\infty} |x_n|$. La boule unité fermée $B'(0, 1) = \{x \in \ell^1(\mathbb{R}); \|x\|_1 \leq 1\}$ est un fermé borné. Mais prouver que $B'(0, 1)$ n'est pas compact (indication : considérer les vecteurs $x^{(k)} = (0, \dots, 0, 1, 0, \dots)$ tels que k place

C Compactité et propriété de Bolzano-Weierstrass.

Théorème 4 (Bolzano-Weierstrass): Soit (E, d) un e.m. et $K \subseteq E$. Les propriétés suivantes sont équivalentes:

- 1) K est compact
- 2) De toute suite $(x_n) \subset K$ de points de K , on peut extraire une sous-suite convergente dans K .

Notons d'abord que dire que $x \in K$ est limite d'une sous-suite extraite de (x_n) équivaut à : $\forall k \in \mathbb{N}^*$, il existe une infinité d'indices n tels que

$$x_n \in B(x, \frac{1}{k}) \quad \textcircled{*}$$

dém du Thm:

(1 \Rightarrow 2) : Supposons K compact. Par l'absurde supposons qu'il existe une suite $(x_n) \subset K$ sans aucun sous-suite convergente dans K . En mantenant la propriété $\textcircled{*}$ on a :

$\forall x \in K, \exists k_x \in \mathbb{N}^*$ et $N_x \in \mathbb{N}$ tels que

$$\forall m \geq N_x, x_m \notin B(x, \frac{1}{k_x})$$

Mais $\left(B(x, \frac{1}{k_x})\right)_{x \in K}$ est un recouvrement ouvert de K .

qui est compact ; donc il existe une sous-recouvrement fini :

$$K \subset B(x_1, \frac{1}{k_{x_1}}) \cup \dots \cup B(x_i, \frac{1}{k_{x_i}})$$

Posons $N = \max(N_{x_1}, \dots, N_{x_i})$. Alors pour tout $n \geq N$, x_n n'appartient à aucune des $B(x_j, \frac{1}{k_{x_j}})$ donc n'appartient pas à K , c'est qui est absurde. Donc (x_n) a une sous-suite convergente dans K .

$\Rightarrow 1)$: Ce sens est difficile à démontrer.
Nous l'admettrons.

Exercice (solution de l'exo p. 5) : De la suite $(x^{(k)})_{k \in \mathbb{N}}$, on ne peut extraire aucune sous-suite convergente car $\forall n \neq m, \|x^{(n)} - x^{(m)}\|_1 = 2$

B) Compacts et fonctions continues

Soient (E, d) et (F, d') des e.m.

Théorème 5 (image continue d'un compact) : Soit $f: E \rightarrow F$ une application continue. Alors pour tout compact $K \subset E$, $f(K)$ est un compact de F .

Dém : soit $(V_i)_{i \in I}$ un recouvrement ouvert de l'ensemble $f(K)$:

$$f(K) \subset \bigcup_{i \in I} V_i$$

comme f est continue, les $f^{-1}(V_i)$ sont des ouverts de E et on a

$$K \subset \bigcup_{i \in I} f^{-1}(V_i) \quad \textcircled{*}$$

(car pour tout $x \in K$, $\exists i \in I$ t.q. $f(x) \in V_i$ donc $x \in f^{-1}(V_i)$ d'où l'inclusion $\textcircled{*}$).

Comme K est compact il existe un nombre fini d'indices i_1, i_2, \dots, i_m tels que

$$K \subset f^{-1}(V_{i_1}) \cup \dots \cup f^{-1}(V_{i_m})$$

mais alors $f(K) \subset V_{i_1} \cup \dots \cup V_{i_m}$ donc $f(K)$ est compact. exercice : trouver une autre dém avec B.W.

Théorème 6 (de Heine) : Si l'application $f: E \rightarrow F$ est continue sur E et si E est compact, alors f est uniformément continue sur E .

dém: Soit $\varepsilon > 0$. Pour chaque $x \in E$, il existe $\delta_x > 0$ tel que

$$d_E(x, y) < \delta_x \Rightarrow d_F(f(x), f(y)) < \frac{\varepsilon}{2}$$

Rais alors pour tous y et $z \in B(x, \delta_x)$, on a

$$\begin{aligned} d_F(f(y), f(z)) &\leq d_F(f(y), f(x)) + d_F(f(x), f(z)) \\ &< \frac{\varepsilon}{2} + \frac{\varepsilon}{2} = \varepsilon. \quad (1) \end{aligned}$$

La famille des boules ouvertes $(B(x, \frac{1}{2}\delta_x))_{x \in E}$ recouvre E (compact par hypothèse) donc il existe un nombre fini de points $x_1, \dots, x_n \in E$ t.q. :

$$E \subset B(x_1, \frac{1}{2}\delta_{x_1}) \cup \dots \cup B(x_n, \frac{1}{2}\delta_{x_n}) \quad \textcircled{*}$$

$$\text{Posons } \delta = \min\left(\frac{1}{2}\delta_{x_1}, \dots, \frac{1}{2}\delta_{x_n}\right) (> 0)$$

Si $y, z \in E$ sont tels que $d_E(y, z) < \delta$ alors étant donné $\textcircled{*}$, il existe $i \in \{1, \dots, n\}$ t.q. $y \in B(x_i, \frac{1}{2}\delta_{x_i})$ donc y et $z \in B(x_i, \delta_{x_i})$ et

d'après (1) on a donc

$$d_F(f(y), f(z)) < \varepsilon$$

On a donc montré qu'étant donné $\varepsilon > 0$, il existe $\delta > 0$ tel que :

$$y, z \in E \text{ et } d_E(y, z) < \delta \Rightarrow d_F(f(y), f(z)) < \varepsilon$$

Donc f est uniformément continue CQFD.

D) Compacts des espaces normés de dimension finie.

On commence par étudier les compacts de \mathbb{R} et de \mathbb{C} munis de leur métrique usuelle.

Théorème 6 : tout intervalle $[a, b]$ fermé et borné est un compact de \mathbb{R}

dém: supposons par l'absurde qu'il existe une famille d'ouverts $(Q_\alpha)_{\alpha \in \Theta}$ qui recouvre $[a, b]$ et telle que aucune sous-famille finie ne permet de recouvrir $[a, b]$.

Alors au moins l'un des intervalles $[a, \frac{a+b}{2}]$ $[\frac{a+b}{2}, b]$ n'est pas recouvert par une sous-famille finie des $(O_\alpha)_{\alpha \in \Theta}$. Soit I_1 cet intervalle. On le subdivise en 2 sous intervalles de même longueur :

Alors pour la même raison, l'un de ces intervalles, notons-le I_2 , n'est pas recouvert par une sous-famille finie des $(O_\alpha)_{\alpha \in \Theta}$.

En répétant cette opération, on obtient une suite (I_m) d'intervalles fermés telle que :

$$[a, b] \supset I_1 \supset I_2 \supset \dots \supset I_m \supset I_{m+1} \supset \dots$$

$$\text{et } |I_m| \leq \frac{b-a}{2^m}.$$

Par le théorème des segments-en-boîtes, $\bigcap_m I_m = \{x\}$ est réduit à un point $x \in [a, b]$.

Il existe donc un ouvert O_x du recouvrement tel que $x \in O_x$ donc un rayon $r > 0$ tel que $B(x, r) \subset O_x$.

Mais pour m assez grand on a $\frac{b-a}{2^m} < r$ donc $I_m \subset B(x, r) \subset O_x$, ce qui montre que l'ouvert O_x suffit à recouvrir I_m : contradiction. Donc $[a, b]$ est compact.

Corollaire : Les compacts de \mathbb{R} sont les ensembles fermés bornés.

dém : Soit $K \subset \mathbb{R}$ un compact. On sait déjà que K est forcément fermé et borné (d'après le corollaire des Thm 1 et 3).

Inversement soit C un ensemble fermé et borné dans \mathbb{R} . Comme C est borné, il existe un intervalle fermé borné $[a, b]$ tel que $C \subset [a, b]$.

Mais alors C est fermé et contenu dans le compact $[a, b]$ donc C est compact d'après le Thm 2 cqd.

Remarque : Avec la même méthode "dichotomie"

que" on montre que dans \mathbb{R}^2 (avec la distance euclidienne) les pavés fermés bornés $[a,b] \times [c,d]$ sont des ensembles compacts puis par un raccordement analogique à celui du Thm 6, on voit que

Corollaire : Un sous-ensemble K de \mathbb{R}^2 (resp. de \mathbb{C}) est compact si et seulement si il est fermé et borné. Ce résultat est vrai aussi si on munît \mathbb{R}^2 de l'une quelconque des métriques associées aux normes $\|\cdot\|_p$ ($\|x\|_p = \left(\sum_{i=1}^n |x_i|^p \right)^{1/p}$, $p \geq 0$)

(Noter que toutes ces métriques sont équivalentes et définissent donc la même topologie donc les ensembles compacts sont les mêmes pour toutes les métriques).

Plus généralement :

Théorème 7 : Un sous-ensemble K de \mathbb{R}^n (resp. \mathbb{C}^n) est compact si et seulement si il est fermé et borné' (la métrique sur \mathbb{R}^n étant l'une quelconque de celles associées à une norme $\|\cdot\|_p$).

15

Remarque sur le Théorème de Bolzano - Weierstrass dans \mathbb{R}^m :

le 2) \Rightarrow 1) du Théorème 4 et une démonstration simple dans \mathbb{R}^m :

Supposons que $K \subset \mathbb{R}^m$ est un sous-ensemble tel que toute suite $(x_n) \subset K$ possède une sous-suite convergente dans K .

a) Disons d'abord que K est borné : si K n'est pas borné, il existe une suite (x_n) de points de K telle que $\|x_n\|_2 > n$ pour tout n . Mais de cette suite on ne peut extraire aucune sous-suite convergente puisque une suite extraite (x_{n_k}) convergeant vers $x \in K$ devrait vérifier

$$\|x_{n_k}\|_2 \rightarrow \|x\|_2 \quad k \rightarrow +\infty,$$

ce qui n'est pas puisque $\|x_{n_k}\|_2 \rightarrow +\infty$.
Donc K est borné.

b) Disons que K est fermé : par l'absurde, si \bar{K} n'est pas égal à K , il existe $x \in \bar{K}$

avec $x \notin K$. Mais on sait par la caractérisation de l'adhérence qu'il existe une suite $(x_n) \subset K$ telle que $x = \lim_{n \rightarrow \infty} x_n$. Mais alors toute suite extraite (x_{n_k}) est aussi telle que $x = \lim_{k \rightarrow \infty} x_{n_k}$ donc $x \in K$ par hypothèse contradictoire. Donc $K = \overline{K}$.

Conclusion: K est fermé borné i.e. compact cqd.

E Application aux extrêma des fonctions numériques :

Soit (E, d) un espace métrique et $f: E \rightarrow \mathbb{R}$ une application continue (\mathbb{R} est muni de sa métrique usuelle).

Théorème 8: Pour tout compact $K \subset E$, il existe $a \in K$ et $b \in K$ tels que

$$f(a) = \sup_{x \in K} f(x); \quad f(b) = \inf_{x \in K} f(x)$$

(i.e. f atteint ses bornes sup et inf sur tout compact).

Théorème 7: $f(K)$ est compact (par le Thm 5) donc est fermé borné dans \mathbb{R} (corollaire du Thm F). Par définition du Sup, il existe une suite $(x_n) \subset K$ telle que

$$\sup_{x \in K} f(x) = \lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n)$$

mais il existe une suite extraite (x_{n_k}) qui converge vers un point $a \in K$ (Bolzano-Wierstrass).

$$\text{Donc } \lim_{n \rightarrow \infty} f(x_n) = \lim_{k \rightarrow \infty} f(x_{n_k}) = f(a).$$

→ car f est continue
→ si une suite converge toute suite extraite converge

D'où le résultat pour le Sup. Même méthode pour l'inf CQFD.

F Application à l'équivalence des normes en dimension finie :

Théorème 9: Soit E un espace vectoriel (fini ou C) de dimension finie. Alors toutes les normes sur E sont équivalentes.

Dém: Fixons une base e_1, e_2, \dots, e_n de E .
Alors tout $x \in E$ s'écrit $x = x_i e_i + \dots + x_n e_n$
avec $x_i \in \mathbb{K}$, de manière unique. On a donc
 $E \cong \mathbb{K}^n$. Considérons la norme $\|\cdot\|_1$ sur E i.e.

$$\|x\|_1 = \sum_{i=1}^n |x_i|$$

Il soit $x \mapsto \|x\|$ une autre norme. On va montrer que $\|\cdot\|$ et $\|\cdot\|_1$ sont équivalentes car ce qui compte tenu de la transitivité de l'équivalence donne le résultat du Thm:

a) Pour tout $x \in E$, on a

$$\begin{aligned}\|x\| &= \left\| \sum_{i=1}^n x_i e_i \right\| \leq \sum_{i=1}^n |x_i| \|e_i\| \\ &\leq C \|x\|_1,\end{aligned}$$

$$\text{si } C = \max_{1 \leq i \leq n} \|e_i\|.$$

On démontre que l'application $x \mapsto \|x\|$ de $(\mathbb{K}^n, \|\cdot\|_1)$ dans $(\mathbb{R}, |\cdot|)$ est continue puisque

$$|\|x\| - \|y\|| \leq \|x-y\| \leq C \|x-y\|_1$$

ce montre que l'application est même Lipschitzienne de constante de Lipschitz C .

considérons la sphère unité de $(\mathbb{K}^n, \|\cdot\|_1)$:

$$S = \{x \in \mathbb{K}^n ; \|x\|_1 = 1\}$$

L'ensemble S est fermé et borné dans $(E, \|\cdot\|_1)$ borné c'est clair ! fermé car $S = f_1^{-1}(1)$ où $f_1 : x \mapsto \sum_{i=1}^n |x_i|$ est une application continue de \mathbb{K}^n dans \mathbb{R}_+ .

Donc S est compact (Thm 7).

L'application continue $x \mapsto \|x\|$ admet une borne inférieure m sur S qu'elle atteint en un point $x_0 \in S$ (Thm 8) et $x_0 \neq 0$ car $\|x_0\|_1 = 1$ donc $m > 0$

b) Pour tout $x \in \mathbb{K}^n \setminus \{0\}$, on a

$$\frac{x}{\|x\|_1} \in S \text{ donc}$$

$$\left\| \frac{x}{\|x\|_1} \right\| \geq m (> 0)$$

$$\Leftrightarrow m \|x\|_1 \leq \|x\|$$

$$\text{ou encore } \|x\|_1 \leq \frac{1}{m} \|x\|$$

inégalité vraie même si $x = 0$. QED avec

Corollaire: Sur un espace vectoriel de dimension finie, toutes les topologies d'espace normé coïncident.

En particulier dans tout espace normé de dimension finie les compacts sont les fermés-bornés.

G Compléments sur la compacité

Les points examinés dans ce paragraphe sont de niveau plus avancé et indispensables pour le le Reader ou la préparation à l'Aggregation.

G1 Produits de compacts

Soient $(E_1, d_1), \dots, (E_m, d_m)$ des espaces métriques. On munît le produit cartésien

$$E = E_1 \times \dots \times E_m$$

de la métrique produit:

$$d(x, y) = \max_{1 \leq i \leq m} d_i(x_i, y_i)$$

$$x = (x_1, \dots, x_m)$$

$$y = (y_1, \dots, y_m)$$

22
Pour $i = 1, \dots, m$, soit K_i un compact de (E_i, d_i)

Proposition: l'ensemble $K_1 \times K_2 \times \dots \times K_m$ est un sous-ensemble compact de l'espace métrique (E, d)

dém: exercice sur une voie en TD.

G2 Compacts et topologie induite

Soit (E, d) un espace métrique et $A \subset E$ un sous-ensemble qu'on munît de la métrique d_A induite par d . (A, d_A) est alors un sous-espace métrique de E .

Considérons un sous-ensemble K de E tel que:

$$K \subset A \subset E$$

Théorème: K est un compact de (E, d) si et seulement si K est un compact de (A, d_A) .

dim:

1) \Rightarrow 2): Supposons K compact dans (E, d) et soit $(V_i)_{i \in I}$ une famille d'ouverts de (A, d_A) qui recouvre K :

$$K \subset \bigcup_{i \in I} V_i$$

tout V_i est de la forme $A \cap O_i$ avec O_i ouvert de (E, d) donc

$$K \subset \bigcup_{i \in I} (A \cap O_i) \subset \bigcup_{i \in I} O_i$$

Par hypothèse $\exists i_1, \dots, i_m \in I$ (mb fini) tels que

$$K \subset O_{i_1} \cup \dots \cup O_{i_m}$$

mais $K = K \cap A \subset (A \cap O_{i_1}) \cup \dots \cup (A \cap O_{i_m})$

i.e. $K \subset V_{i_1} \cup \dots \cup V_{i_m}$ donc K est compact dans (A, d_A)

2) \Rightarrow 1): Supposons K compact dans (A, d_A) et $(O_i)_{i \in I}$ un recouvrement ouvert de K avec

13

O_i ouvert de (E, d) . Alors

$$K = K \cap A \subset \left(\bigcup_{i \in I} O_i \right) \cap A = \bigcup_{i \in I} (O_i \cap A)$$

les $V_i = O_i \cap A$ sont des ouverts de (A, d_A)

Par hypothèse, il existe un nb fini d'indices $i_1, \dots, i_m \in I$ tels que

$$\begin{aligned} K &\subset \underbrace{(O_{i_1} \cap A) \cup \dots \cup (O_{i_m} \cap A)}_{(O_{i_1} \cup \dots \cup O_{i_m}) \cap A} \\ &\subset O_{i_1} \cup \dots \cup O_{i_m} \end{aligned}$$

donc K est compact dans (E, d) .

Remarque: Dans le théorème précédent, on peut prendre $A = K$

Consequence: La compacité de K est une propriété de sa propre topologie, et non pas de la topologie sous-jacente de l'espace plongé dans lequel il est plongé.

Exercice: le théorème p.20 est-il vrai si on remplace le mot "compact" par le mot "ouvert" ou par "fermé"?

14