

DÉCOMPOSITION DE CHOLESKI (A3)

(20 / 05 / 2020, © Monfort, Dicostat2005, 2005-2020)

Toute **matrice définie positive** $A \in M_n^{++}(\mathbf{R})$ admet une **décomposition de L.W.CHOLESKI** unique de la forme $T' T$, où T est une **matrice triangulaire** inférieure dont les éléments diagonaux sont positifs :

$$(1) \quad \forall A \in M_n^{++}(\mathbf{R}), \exists T \in T_n^-(\mathbf{K}) \text{ tq : } A = T' T.$$