

Feuille de TD $n^{\circ}2$

Exercice 1. On note $\mathcal{I}(f) = \int_a^b f(t)dt$ et $\mathcal{I}_Q(f) = \sum_{i=0}^n \omega_i f(t_i)$.

1. On choisit $\omega_i = \int_a^b L_i(t)dt$, avec L_i est le i -ème polynôme de Lagrange associé aux points t_0, t_1, \dots, t_n .

Montrer que $\mathcal{I}(p) = \mathcal{I}_Q(p)$, $\forall p \in \mathbb{P}_n$.

2. Réciproquement, on suppose que $\mathcal{I}(p) = \mathcal{I}_Q(p)$, $\forall p \in \mathbb{P}_n$, montrer que $\omega_i = \int_a^b L_i(t)dt$.

3. Si on note $\{p_0, p_1, \dots, p_n\}$ la base canonique de \mathbb{P}_n , montrer que

$$\mathcal{I}(p) = \mathcal{I}_Q(p), \quad \forall p \in \mathbb{P}_n \quad \Leftrightarrow \quad \mathcal{I}(p_i) = \mathcal{I}_Q(p_i), \quad i = 0, 1, \dots, n.$$

Exercice 2. Soit $0 < \alpha \leq 1$ un nombre réel donné, soit $t_1 = -\alpha$, $t_2 = 0$ et $t_3 = \alpha$ et soit $\omega_1, \omega_2, \omega_3$, trois nombres réels. Nous considérons la formule de quadrature définie par

$$\mathcal{I}_Q(g) = \sum_{j=1}^3 \omega_j g(t_j),$$

où g est une fonction continue sur $[-1, 1]$.

1. Trouver ω_1 , ω_2 , et ω_3 en fonction de α de sorte que \mathcal{I}_Q soit exacte sur les polynômes de degré 2.

2. Montrer qu'avec de tels poids, \mathcal{I}_Q est exacte sur les polynômes de degré 3.

3. Existe-t-il α tel que la formule \mathcal{I}_Q soit exacte sur les polynômes de degré 5? Si oui, calculer ce α .

Exercice 3. On souhaite obtenir une approximation de $\ln(2)$ à l'aide de la formule suivante

$$\ln(2) = \int_1^2 \frac{dt}{t}.$$

1. a. Ecrire l'approximation obtenue par la formule de trapèze simple.

b. Pourquoi la valeur numérique obtenue à la question précédente est-elle supérieure à $\ln(2)$?

c. Comparer le résultat obtenu à la première question avec celui obtenu par la formule de Simpson.

2. Montrer que la méthode de trapèze composée conduit à une approximation :

$$\ln 2 \simeq \mathcal{A}(n) = \frac{\alpha}{n} + \sum_{1 \leq k \leq n-1} \frac{\beta}{n+k},$$

où α et β sont deux constantes à déterminer.

3. Montrer que l'erreur associée à la formule de trapèze composite est donnée par

$$\left| \int_1^2 f(t)dt - \mathcal{A}(n) \right| \leq \frac{M}{12n^2} \quad \text{avec } M = \max_{x \in [1,2]} |f^{(2)}(x)|.$$

4. Quelle valeur de n faudrait-il choisir pour obtenir une approximation de $\ln(2)$ avec 5 décimales précises ?

Exercice 4. On considère la formule de quadrature sur l'intervalle $[-1, 1]$ suivante

$$\mathcal{I}_Q(f) = a_0 f(x_0) + a_0 f(-x_0) + a_1 f(1) + a_1 f(-1).$$

- Déterminer a_0, a_1 et x_0 pour que la formule soit exacte sur les polynômes de degré 5.
- Appliquer ce résultat à la fonction $f(x) = \frac{1}{1+x^2}$. Quelle approximation de π obtient-on ?

Exercice 5. Soit f une fonction de classe $\mathcal{C}^1([-1, 1])$ et p le polynôme d'interpolation d'Hermite de f vérifiant :

$$p(-1) = f(-1), \quad p'(-1) = f'(-1), \quad p(1) = f(1) \quad \text{et} \quad p'(1) = f'(1).$$

- Écrire le polynôme p .
- En déduire la formule de quadrature des trapèzes-Hermite suivante :

$$\int_{-1}^1 f(t)dt \simeq f(-1) + f(1) + \frac{1}{3} (f'(-1) - f'(1)).$$

3. Connaissant la formule sur $[-1, 1]$, en déduire la formule de quadrature des trapèzes-Hermite sur l'intervalle $[a, b]$.

Exercice 6. Soient les formules de quadrature

$$\int_0^1 f(t)dt \simeq a_1 f(0) + a_2 f(1) + b_1 f'(0) + b_2 f'(1), \quad (1)$$

$$\int_a^b f(t)dt \simeq \alpha [f(a) + f(b)] + \beta [f'(a) - f'(b)]. \quad (2)$$

- Déterminer les coefficients a_1, a_2, b_1 et b_2 pour que la formule de quadrature (1) soit exacte pour les polynômes de degré le plus élevé possible. Quelle est alors son degré de précision ?
- Par un changement de variable, écrire (1) pour un intervalle $[a, b]$ quelconque.
- Sachant que la formule (1) a été obtenue en intégrant sur $[0, 1]$ la relation :

$$f(t) = p(t) + \frac{f^{(4)}(\alpha_t)}{24} t^2 (t-1)^2,$$

où $\alpha_t \in]0, 1[$, donner alors l'expression de l'erreur dans la formule (1).

- Retrouver le résultat de la question 2 en déterminant les coefficients α et β pour que la formule de quadrature (2) soit exacte pour les polynômes de degré le plus élevé possible.
- En déduire la formule composite associée à (2).

Solution 1. $\mathcal{I}(f) = \int_a^b f(t)dt$ et $\mathcal{I}_Q(f) = \sum_{i=0}^n \omega_i f(t_i)$.

1. Soit $p \in \mathbb{P}_n$, on a $p(t) = \sum_{i=0}^n p(t_i)L_i(t)$, alors

$$\begin{aligned}\mathcal{I}(p) &= \int_a^b p(t)dt = \sum_{i=0}^n p(t_i) \int_a^b L_i(t)dt \\ &= \sum_{i=0}^n \omega_i p(t_i) = \mathcal{I}_Q(p).\end{aligned}$$

2. $\mathcal{I}(p) = \mathcal{I}_Q(p)$, $\forall p \in \mathbb{P}_n \Rightarrow \mathcal{I}(L_j) = \mathcal{I}_Q(L_j)$, $\forall j = 0, 1, \dots, n$.

Or, $\mathcal{I}(L_j) = \int_a^b L_j(t)dt$ et $\mathcal{I}_Q(L_j) = \sum_{i=0}^n \omega_i L_j(t_i) = \omega_j$,
d'où le résultat.

3. $\mathcal{I}(p) = \mathcal{I}_Q(p)$, $\forall p \in \mathbb{P}_n \Rightarrow \mathcal{I}(p_i) = \mathcal{I}_Q(p_i)$, $i = 0, 1, \dots, n$.

Réciproquement, on suppose que $\mathcal{I}(p_i) = \mathcal{I}_Q(p_i)$, $i = 0, 1, \dots, n$.

Soit $p \in \mathbb{P}_n$ alors $p(t) = \sum_{i=0}^n \alpha_i p_i(t)$. Ainsi,

$$\begin{aligned}\mathcal{I}(p) &= \int_a^b p(t)dt = \sum_{i=0}^n \alpha_i \int_a^b p_i(t)dt \\ &= \sum_{i=0}^n \alpha_i \mathcal{I}(p_i) = \sum_{i=0}^n \alpha_i \mathcal{I}_Q(p_i) \\ &= \mathcal{I}_Q\left(\sum_{i=0}^n \alpha_i p_i\right) = \mathcal{I}_Q(p).\end{aligned}$$

Solution 2.

1. D'après l'exercice 1, \mathcal{I}_Q est exacte sur \mathbb{P}_2 ssi $\omega_j = \int_{-1}^1 L_j(t)dt$, $j = 1, 2, 3$.

On a

$$\begin{aligned}L_1(t) &= \frac{t(t-\alpha)}{-\alpha(-\alpha-\alpha)} = \frac{t(t-\alpha)}{2\alpha^2}, \\ L_2(t) &= \frac{(t+\alpha)(t-\alpha)}{\alpha(0-\alpha)} = -\frac{(t+\alpha)(t-\alpha)}{\alpha^2}, \\ L_3(t) &= \frac{(t+\alpha)t}{(\alpha+\alpha)\alpha} = \frac{t(t+\alpha)}{2\alpha^2}.\end{aligned}$$

D'où

$$\begin{aligned}\omega_1 &= \int_{-1}^1 L_1(t)dt = \frac{1}{2\alpha^2} \left[\frac{t^3}{3} - \alpha \frac{t^2}{2} \right]_{-1}^1 = \frac{1}{3\alpha^2}, \\ \omega_2 &= \int_{-1}^1 L_2(t)dt = -\frac{1}{\alpha^2} \left[\frac{t^3}{3} - \alpha^2 t \right]_{-1}^1 = \frac{-2}{3\alpha^2} + 2.\end{aligned}$$

Pour raison de symétrie $\omega_3 = \omega_1$.

2. On a

$$\mathcal{I}_Q(p_3) = \omega_1(-\alpha)^3 + \omega_1 0 + \omega_3 \alpha^3 = 0 = \int_{-1}^1 p_3(t)dt.$$

D'où l'exactitude sur \mathbb{P}_3 .

3. La formule $\mathcal{I}_Q(\cdot)$ est exacte sur \mathbb{P}_4 ssi $\mathcal{I}_Q(p_4) = \int_{-1}^1 p_4(t)dt$, c-à-d

$$\omega_1(-\alpha)^4 + \omega_1 0 + \omega_3 \alpha^4 = \frac{2}{5} \Leftrightarrow \alpha = \sqrt{\frac{3}{5}}.$$

Finalement, on vérifie facilement que :

$$\mathcal{I}_Q(p_5) = \int_{-1}^1 p_5(t)dt = 0.$$

D'où l'exactitude sur \mathbb{P}_5 .

Solution 3. On pose $f(t) = \frac{1}{t}$, $a = 1$ et $b = 2$, on a

$$\ln(2) = \int_1^2 \frac{dt}{t} = \int_a^b f(t)dt.$$

1. a. Avec la formule de trapèze simple, on a

$$\int_1^2 \frac{dt}{t} \simeq \frac{(b-a)}{2} (f(a) + f(b)) = \frac{1}{2} \left(\frac{1}{2} + 1 \right) = \frac{3}{4} = 0.75.$$

Soit une erreur de 0.0569.

b. La valeur numérique obtenue à la question précédente est supérieure à $\ln(2)$, car la fonction $f(x) = \frac{1}{x}$ est convexe. On peut se convaincre à l'aide d'un dessin que le trapèze est au-dessus de la courbe $y = f(x)$. D'où, l'aire du trapèze sera supérieure à l'aire de la courbe.

c. Avec la formule de simpson, on a

$$\int_1^2 \frac{dt}{t} \simeq \frac{(b-a)}{2} \left(f(a) + 4f\left(\frac{a+b}{2}\right) + f(b) \right) = \frac{25}{36} = 0.6944.$$

Soit une erreur de 0.0013.

D'où, la formule de simpson est plus précise que celle du trapèze.

2. Soit $x_k = 1 + \frac{k}{n}$, $k = 0, 1, \dots, n$, la méthode de trapèze composée est :

$$\begin{aligned} \ln 2 \simeq \mathcal{A}(n) &= \sum_{k=0}^{n-1} \frac{(x_{k+1} - x_k)}{2} (f(x_k) + f(x_{k+1})) \\ &= \frac{f(1) + f(2)}{2n} + \frac{1}{n} \sum_{k=1}^{n-1} \frac{1}{1 + \frac{k}{n}} \\ &= \frac{3}{4n} + \sum_{k=1}^{n-1} \frac{1}{n+k} \Rightarrow \alpha = \frac{3}{4}, \beta = 1. \end{aligned}$$

3. L'erreur associée à la formule de trapèze composite est donnée par

$$\begin{aligned} \left| \int_a^b f(t)dt - \mathcal{A}(n) \right| &\leq \sum_{k=0}^{n-1} \left| \int_{x_k}^{x_{k+1}} \frac{f^{(2)}(\xi_t^k)}{2!} (t - x_k)(t - x_{k+1})dt \right| \\ &\leq \frac{M}{2} \sum_{k=0}^{n-1} \frac{(x_{k+1} - x_k)^3}{6} \\ &\leq \frac{M}{12n^2} \quad \text{avec } M = \max_{x \in [1,2]} |f^{(2)}(x)| \end{aligned}$$

4. Pour que l'approximation $\ln(2)$ soit en 10^{-5} , il suffit que

$$\frac{M}{12n^2} \leq 10^{-5}.$$

On a

$$f^{(2)}(x) = \frac{2}{x^3} \text{ avec } 1 < x < 2 \Rightarrow M \leq 2.$$

D'où $\frac{1}{6n^2} \leq 10^{-5} \Rightarrow n \geq 130$.

Solution 4.

$$\mathcal{I}_Q(f) = a_0 f(x_0) + a_0 f(-x_0) + a_1 f(1) + a_1 f(-1).$$

1. Cette formule est exacte sur \mathbb{P}_5 , cela est équivalent à :

$$\begin{cases} a_0 + a_0 + a_1 + a_1 = 2, \\ a_0 x_0 - a_0 x_0 + a_1 - a_1 = 0, \\ a_0 x_0^2 + a_0 x_0^2 + a_1 + a_1 = \frac{2}{3}, \\ a_0 x_0^3 - a_0 x_0^3 + a_1 - a_1 = 0, \\ a_0 x_0^4 + a_0 x_0^4 + a_1 + a_1 = \frac{2}{5}, \\ a_0 x_0^5 - a_0 x_0^5 + a_1 - a_1 = 0. \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} a_0 + a_1 = 1, \\ a_0 x_0^2 + a_1 = \frac{1}{3}, \\ a_0 x_0^4 + a_1 = \frac{1}{5}. \end{cases}$$

$$\Leftrightarrow \begin{cases} a_1 = 1 - a_0, \\ a_0 - a_0 x_0^2 = \frac{2}{3}, \\ a_0 - a_0 x_0^4 = \frac{4}{5}. \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} a_1 = 1 - a_0, \\ a_0(1 - x_0^2) = \frac{2}{3}, \\ 1 + x_0^2 = \frac{6}{5}. \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} a_0 = \frac{5}{6}, \\ a_1 = \frac{1}{6}, \\ x_0 = \pm \frac{1}{\sqrt{5}}. \end{cases}$$

2. Si on applique cette formule à la fonction $f(x) = \frac{1}{1+x^2}$, on obtient

$$\int_{-1}^1 \frac{1}{1+t^2} dt = \frac{\pi}{2} \simeq \frac{1}{6} \left(f(-1) + 5f\left(-\frac{1}{\sqrt{5}}\right) + 5f\left(\frac{1}{\sqrt{5}}\right) + f(1) \right) = \frac{14}{9}.$$

D'où

$$\pi \simeq \frac{28}{9} = 3.1111.$$

Solution 5.

1. Le polynôme interpolation d'Hermite p s'écrit comme suit :

$$p(x) = \alpha + \beta x + \gamma x^2 + \delta x^3,$$

tel que

$$\begin{cases} p(-1) = f(-1), \\ p(1) = f(1), \\ p'(-1) = f'(-1), \\ p'(1) = f'(1). \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} \alpha - \beta + \gamma - \delta = f(-1), \\ \alpha + \beta + \gamma + \delta = f(1), \\ \beta - 2\gamma + 3\delta = f'(-1), \\ \beta + 2\gamma + 3\delta = f'(1). \end{cases}$$

On obtient,

$$\begin{cases} \alpha = \frac{1}{4} [2f(-1) + 2f(1) + f'(-1) - f'(1)], \\ \beta = \frac{1}{4} [-3f(-1) + 3f(1) - f'(-1) - f'(1)], \\ \gamma = \frac{1}{4} [-f'(-1) + f'(1)], \\ \delta = \frac{1}{4} [f(-1) - f(1) + f'(-1) + f'(1)]. \end{cases}$$

2. En intégrant le polynôme ainsi trouvé on en déduit

$$\begin{aligned} \int_{-1}^1 f(x)dx &\simeq \int_{-1}^1 p(x)dx = \left[\alpha x + \frac{\beta}{2}x^2 + \frac{\gamma}{3}x^3 + \frac{\delta}{4}x^4 \right]_{-1}^1 \\ &= 2\alpha + \frac{2}{3}\gamma \\ &= \frac{1}{2} [2f(-1) + 2f(1) + f'(-1) - f'(1)] + \frac{1}{6} [-f'(-1) + f'(1)] \\ &= f(-1) + f(1) + \frac{1}{3} (f'(-1) - f'(1)). \end{aligned}$$

Remarque 1. la formule est au moins exacte de degré 3 par construction. Elle n'est pas exacte de degré supérieure à 3 car pour $f(x) = x^4$, on a

$$\int_{-1}^1 f(x)dx = \left[\frac{1}{5}x^5 \right]_{-1}^1 = \frac{6}{15}$$

et

$$f(-1) + f(1) + \frac{1}{3} (f'(-1) - f'(1)) = 1 + 1 + \frac{1}{3} (4 + 4) = \frac{70}{15}.$$

3. Connaissant la formule sur $[-1, 1]$, on en déduit la formule sur un intervalle $[a, b]$ quelconque par le changement de variable $y = \frac{b-a}{2}x + \frac{a+b}{2}$ qui donne

$$\begin{aligned} \int_a^b f(y)dy &= \frac{b-a}{2} \int_{-1}^1 f\left(\frac{b-a}{2}x + \frac{a+b}{2}\right) dx \\ &= \frac{b-a}{2} \left[f(a) + f(b) + \frac{b-a}{6} (f'(a) - f'(b)) \right] \\ &= \frac{b-a}{2} (f(a) + f(b)) + \frac{(b-a)^2}{12} (f'(a) - f'(b)). \end{aligned}$$

Solution 6. On pose

$$\begin{aligned} \mathcal{I}_Q(f) &= a_1 f(0) + a_2 f(1) + b_1 f'(0) + b_2 f'(1), \\ \mathcal{J}_Q(f) &= \alpha [f(a) + f(b)] + \beta [f'(a) - f'(b)]. \end{aligned}$$

1. \mathcal{I}_Q est exacte sur \mathbb{P}_3 ssi $\mathcal{I}_Q(p_i) = \int_0^1 p_i(x)dx$, $i = 0, 1, 2, 3$, c-à-d

$$\begin{cases} a_1 + a_2 = 1, \\ a_2 + b_1 + b_2 = \frac{1}{2}, \\ a_2 + 2b_2 = \frac{1}{3}, \\ a_2 + 3b_2 = \frac{1}{4}. \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} a_1 + a_2 = 1, \\ a_2 + b_1 + b_2 = \frac{1}{2}, \\ a_2 + 2b_2 = \frac{1}{3}, \\ b_2 = -\frac{1}{12}. \end{cases} \Leftrightarrow \begin{cases} a_1 = \frac{1}{2}, \\ a_2 = \frac{1}{2}, \\ b_1 = \frac{1}{12}, \\ b_2 = -\frac{1}{12}. \end{cases}$$

D'où

$$\mathcal{I}_Q(f) = \frac{1}{2} [f(0) + f(1)] + \frac{1}{12} [f'(0) - f'(1)].$$

La formule \mathcal{I}_Q est exacte sur \mathbb{P}_4 ssi $\mathcal{I}_Q(p_4) = \int_0^1 p_4(x)dx$. Or,

$$\begin{aligned} \mathcal{I}_Q(f) &= \frac{1}{2} [0 + 1] + \frac{1}{12} [0 - 4] \\ &= \frac{1}{6} \neq \int_0^1 p_4(x)dx = \frac{1}{5}. \end{aligned}$$

Alors, le degré de précision de \mathcal{I}_Q est 3.

2. On pose $x = a + (b - a)t$, $t \in [0, 1]$. On a

$$\begin{aligned} \int_a^b f(x)dx &= (b - a) \int_0^1 f(a + (b - a)t)dt \\ &= (b - a) \int_0^1 g(t)dt, \quad \text{avec } g(t) = f(a + (b - a)t). \\ &\simeq (b - a) \left\{ \frac{1}{2} [g(0) + g(1)] + \frac{1}{12} [g'(0) - g'(1)] \right\}, \\ &= \frac{(b - a)}{2} [f(a) + f(b)] + \frac{(b - a)^2}{12} [f'(a) - f'(b)]. \end{aligned}$$

3. On a

$$f(t) = p(t) + \frac{f^{(4)}(\alpha_t)}{24} t^2(t - 1)^2, \quad \alpha_t \in]0, 1[.$$

Alors,

$$\begin{aligned} \int_0^1 f(t)dt - \int_0^1 p(t)dt &= \int_0^1 \frac{f^{(4)}(\alpha_t)}{24} \underbrace{t^2(t - 1)^2}_{\geq 0} dt \\ &= \frac{f^{(4)}(\xi)}{24} \int_0^1 t^2(t - 1)^2 dt, \quad \xi \in]0, 1[\quad (\text{1ère formule de la moyenne}) \\ &= \frac{1}{720} f^{(4)}(\xi). \end{aligned}$$

4. La formule \mathcal{J}_Q est exacte sur \mathbb{P}_1 ssi

$$\begin{cases} \mathcal{J}_Q(p_0) = \int_a^b p_0(x)dx = b - a, \\ \mathcal{J}_Q(p_1) = \int_a^b p_1(x)dx = \frac{b^2 - a^2}{2}. \end{cases} \Leftrightarrow \alpha = \frac{b - a}{2}, \quad \beta \in \mathbb{R}.$$

Cette formule est exacte sur \mathbb{P}_2 ssi $\mathcal{J}_Q(p_2) = \int_a^b p_2(x)dx = \frac{b^3 - a^3}{3}$, c-à-d

$$\begin{aligned} \alpha [a^2 + b^2] + \beta [2a - 2b] &= \frac{b^3 - a^3}{3} \Leftrightarrow \\ \frac{b - a}{2} [a^2 + b^2] + 2\beta [a - b] &= \frac{b^3 - a^3}{3} \Leftrightarrow \\ \beta &= \frac{(b - a)^2}{12}. \end{aligned}$$

Finalement, on vérifie facilement que :

$$\mathcal{J}_Q(p_3) = \int_a^b p_3(x)dx \quad \text{et que} \quad \mathcal{J}_Q(p_4) \neq \int_a^b p_4(x)dx.$$

D'où l'exactitude sur \mathbb{P}_3 .

5. D'après la question précédente,

$$\mathcal{J}_Q(f) = \frac{b - a}{2} [f(a) + f(b)] + \frac{(b - a)^2}{12} [f'(a) - f'(b)].$$

Soit $x_i = a + ih$, $i = 0, 1, \dots, n$ et $h = \frac{b-a}{n}$. On a

$$\begin{aligned}\int_a^b f(x)dx &= \sum_{i=0}^{n-1} \int_{x_i}^{x_{i+1}} f(x)dx \\ &\simeq \sum_{i=0}^{n-1} \left\{ \frac{x_{i+1} - x_i}{2} [f(x_i) + f(x_{i+1})] + \frac{(x_{i+1} - x_i)^2}{12} [f'(x_i) - f'(x_{i+1})] \right\} \\ &= \frac{h}{2} \sum_{i=0}^{n-1} [f(x_i) + f(x_{i+1})] + \frac{h^2}{12} \sum_{i=0}^{n-1} [f'(x_i) - f'(x_{i+1})] \\ &= \frac{h}{2} [f(a) + f(b)] + \frac{h^2}{12} [f'(a) - f'(b)] + h \sum_{i=1}^{n-1} f(x_i).\end{aligned}$$