

236 Illustrer par des exemples quelques méthodes de calcul d'intégrales de fonctions d'une ou plusieurs variables.

I - Méthodes de base pour les fonction d'une variable

1. Primitives

Théorème 1 (Fondamental de l'analyse). Soit $f : [a, b] \rightarrow E$ (où $[a, b] \subseteq \mathbb{R}$ est un segment et E un espace de Banach sur \mathbb{R} ou \mathbb{C}).

(i) L'application

$$F : \begin{array}{l} [a, b] \rightarrow E \\ x \rightarrow \int_a^x f(t) dt \end{array}$$

est \mathcal{C}^1 par morceaux, continue, dérivable à gauche et à droite sur $[a, b]$ telle que

$$F'_g(x) = \lim_{\substack{t \rightarrow x \\ t < x}} f'(t) \text{ et } F'_d(x) = \lim_{\substack{t \rightarrow x \\ t > x}} f'(t)$$

(ii) Si f est continue sur $[a, b]$, F est de classe \mathcal{C}^1 sur $[a, b]$ avec $F'(x) = f(x)$ pour tout $x \in [a, b]$.

[GOU20]
p. 127

Corollaire 2. Soit $[a, b] \subseteq \mathbb{R}$ un segment. Toute application continue $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ admet au moins une primitive, et pour toute primitive F de f sur $[a, b]$, on a

$$\int_a^b f(x) dx = [F(x)]_a^b = F(b) - F(a)$$

Exemple 3. Pour tout $n \in \mathbb{N}$, on note $W_n = \int_0^{\frac{\pi}{2}} \sin(x)^n dx$. Alors, $W_0 = \frac{\pi}{2}$ et $W_1 = 1$.

Proposition 4. Soit $F \in \mathbb{R}(X)$. Pour intégrer $x \mapsto F(x)$, on fait une décomposition en éléments simples de F , qui nous ramène à calculer des primitives de la forme

$$\int \frac{dx}{(x-a)^h} dx \text{ et } \int \frac{ax+b}{(x^2+cx+d)^h} dx$$

où $h \in \mathbb{N}^*$ et $c - 4d < 0$.

p. 137

Exemple 5.

$$\int^x \frac{1-x}{(x^2+x+1)^2} dx = \frac{x+1}{x^2+x+1} + \frac{2}{\sqrt{3}} \arctan\left(\frac{2x+1}{\sqrt{3}}\right) + k \text{ avec } k \in \mathbb{R}$$

2. Changement de variable

Théorème 6 (Changement de variable). Soit $[a, b] \subseteq \mathbb{R}$ un segment. Soit $\varphi : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ une application de classe \mathcal{C}^1 et $f : I \rightarrow E$ où I est un intervalle tel que $\varphi([a, b]) \subseteq I$. Alors,

p. 127

$$\int_a^b f(\varphi(t))\varphi'(t) dt = \int_{\varphi(a)}^{\varphi(b)} f(u) du$$

Exemple 7.

$$\int_0^{\frac{\pi}{2}} \ln(\sin(x)) dx = -\frac{\pi \ln(2)}{2}$$

p. 178

Proposition 8 (Règle de Bioche). Soit $R \in \mathbb{R}(X, Y)$. Pour calculer une primitive d'une fonction de la forme $f : x \rightarrow R(\sin(x), \cos(x))$, on peut utiliser la règle de Bioche :

p. 139

- (i) Si $f(x) dx$ reste inchangé en changeant x en $\pi - x$, on pose $t = \sin(x)$.
- (ii) Si $f(x) dx$ reste inchangé en changeant x en $-x$, on pose $t = \cos(x)$.
- (iii) Si $f(x) dx$ reste inchangé en changeant x en $\pi + x$, on pose $t = \tan(x)$.

Exemple 9.

$$\int^u \frac{\sin(x)^3}{1+\cos(x)^2} dx \stackrel{t=\cos(x)}{=} \int^{\cos(u)} \frac{1-t^2}{1+t^2} (-dt) = \cos(u) - 2 \arctan(\cos(u)) + k \text{ avec } k \in \mathbb{R}$$

3. Intégration par parties

Théorème 10 (Intégration par parties). Soit $[a, b] \subseteq \mathbb{R}$ un segment. Soient $u, v : [a, b] \rightarrow \mathbb{C}$ deux fonctions de classe \mathcal{C}^1 . Alors,

p. 127

$$\int_a^b u(x)v'(x) dx = [u(x)v(x)]_a^b - \int_a^b u'(x)v(x) dx$$

p. 162

Exemple 11 (Fonction Γ d'Euler). On pose

$$\forall x > 0, \Gamma(x) = \int_0^{+\infty} e^{-t} t^{x-1} dt$$

Alors,

$$\forall x > 0, \Gamma(x+1) = x\Gamma(x)$$

et en particulier, $\forall n \in \mathbb{N}, \Gamma(n) = n!$.

Exemple 12 (Intégrales de Wallis). En reprenant l'Exemple 3, on a

$$\forall p \in \mathbb{N}^*, W_{2p} = \frac{(2p-1)(2p-3)\dots 1}{2p(2p-2)\dots 2} \frac{\pi}{2} \text{ et } W_{2p+1} = \frac{2p(2p-2)\dots 2}{(2p-1)(2p-3)\dots 1}$$

p. 130

Application 13 (Intégrale de Gauss).

$$I = \int_0^{+\infty} e^{-t^2} dt = \frac{\sqrt{\pi}}{2}$$

p. 167

II - Méthodes pour les fonctions de plusieurs variables

1. Intégration sur un espace produit

Théorème 14 (Fubini-Tonelli). Soient (X, \mathcal{A}, μ) et (Y, \mathcal{B}, ν) deux espaces mesurés et $f : (X \times Y) \rightarrow \overline{\mathbb{R}^+}$. On suppose μ et ν σ -finies. Alors :

[B-P]
p. 237

- (i) $x \mapsto \int_Y f(x, y) d\nu(y)$ et $y \mapsto \int_X f(x, y) d\mu(x)$ sont mesurables.
- (ii) Dans $\overline{\mathbb{R}^+}$,

$$\int_{X \times Y} f d(\mu \otimes \nu) = \int_X \left(\int_Y f(x, y) d\nu(y) \right) = \int_Y \left(\int_X f(x, y) d\mu(x) \right)$$

Théorème 15 (Fubini-Lebesgue). Soient (X, \mathcal{A}, μ) et (Y, \mathcal{B}, ν) deux espaces mesurés et $f \in \mathcal{L}_1(\mu \otimes \nu)$. Alors :

- (i) Pour tout $y \in Y$, $x \mapsto f(x, y)$ et pour tout $x \in X$, $y \mapsto f(x, y)$ sont intégrables.
- (ii) $x \mapsto \int_Y f(x, y) d\nu(y)$ et $y \mapsto \int_X f(x, y) d\mu(x)$ sont intégrables, les fonctions étant définies pp.
- (iii) On a :

$$\int_{X \times Y} f d(\mu \otimes \nu) = \int_X \left(\int_Y f(x, y) d\nu(y) \right) = \int_Y \left(\int_X f(x, y) d\mu(x) \right)$$

Contre-exemple 16. On considère $f : (x, y) \mapsto 2e^{-2xy} - e^{-xy}$. Alors, $\int_{[0,1]} \left(\int_{\mathbb{R}^+} f(x, y) dx \right) dy = 0$, mais $\int_{\mathbb{R}^+} \left(\int_{[0,1]} f(x, y) dy \right) dx = \ln(2)$.

Exemple 17. Soient $f : (x, y) \mapsto xy$ et $D = \{(x, y) \in \mathbb{R}^2 \mid x, y \geq 0 \text{ et } x + y \leq 1\}$. Alors,

$$\iint_D f(x, y) dx dy = \int_0^1 x \frac{(1-x)^2}{2} dx = \frac{1}{24}$$

[GOU20]
p. 359

2. Changement de variable généralisé

Théorème 18. Soient E et F deux espaces de Banach et $U \subseteq E$ un ouvert. Soit $\varphi : U \rightarrow \mathbb{R}^n$ un difféomorphisme de classe \mathcal{C}^1 . Alors, $V = \varphi(U)$ est mesurable et toute fonction f appartient à L_1 si et seulement si $|\det \text{Jac}(\varphi)_a| f \circ \varphi$ appartient à L_1 . Dans ce cas,

$$\int_V f(x) dx = \int_U |\det \text{Jac}(\varphi)_a| f(\varphi(y)) dy$$

[BMP]
p. 9

Exemple 19 (Coordonnées polaires). L'application

$$\begin{aligned} \mathbb{R}^+ \times [0, 2\pi] &\rightarrow \mathbb{R} \times \mathbb{R} \\ (r, \theta) &\mapsto (r \cos(\theta), r \sin(\theta)) \end{aligned}$$

est un difféomorphisme de classe \mathcal{C}^1 donc le jacobien en $(r, \theta) \in \mathbb{R}^+ \times [0, 2\pi]$ vaut r .

[GOU20]
p. 355

Exemple 20 (Coordonnées sphériques). L'application

$$\begin{aligned} \mathbb{R}^+ \times [0, 2\pi] \times \left[-\frac{\pi}{2}, \frac{\pi}{2}\right] &\rightarrow \mathbb{R} \times \mathbb{R} \times \mathbb{R} \\ (r, \theta, \varphi) &\mapsto (r \cos(\varphi) \cos(\theta), r \cos(\varphi) \sin(\theta), r \sin(\varphi)) \end{aligned}$$

est un difféomorphisme de classe \mathcal{C}^1 donc le jacobien en $(r, \theta, \varphi) \in \mathbb{R}^+ \times [0, 2\pi] \times \left[-\frac{\pi}{2}, \frac{\pi}{2}\right]$ vaut $r^2 \cos(\varphi)$.

Application 21 (Intégrale de Gauss). En passant en coordonnées polaires,

$$\int_{\mathbb{R}} e^{-x^2} dx = \sqrt{\pi}$$

III - Utilisation des théorèmes d'intégration

Soit (X, \mathcal{A}, μ) et (Y, \mathcal{B}, ν) un espace mesuré.

1. Convergence dominée

Théorème 22 (Convergence dominée). Soit (f_n) une suite d'éléments de \mathcal{L}_1 telle que :

- (i) pp. en x , $(f_n(x))$ converge dans \mathbb{K} vers $f(x)$.
- (ii) $\exists g \in \mathcal{L}_1$ positive telle que

$$\forall n \in \mathbb{N}, \text{ pp. en } x, |f_n(x)| \leq g(x)$$

Alors,

$$\int_X f \, d\mu = \lim_{n \rightarrow +\infty} \int_X f_n \, d\mu \text{ et } \lim_{n \rightarrow +\infty} \int_X |f_n - f| \, d\mu = 0$$

[B-P]
p. 140

Exemple 23. Soit $\alpha > 1$. On pose $\forall n \geq 1, I_n(\alpha) = \int_0^n \left(1 + \frac{x}{n}\right)^n e^{-\alpha x} \, dx$. Alors,

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} I_n(\alpha) = \int_0^{+\infty} e^{(1-\alpha)x} \, dx = \frac{1}{\alpha - 1}$$

Exemple 24.

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} \int_0^{+\infty} \frac{x^n}{x^{2n} + 1} \, dx = 0$$

[AMR11]
p. 156

Exemple 25.

$$\sum_{n=0}^{+\infty} \frac{(-1)^n}{3n+1} = \int_0^1 \frac{dx}{x^3+1} \, dx = \frac{3 \ln(2) + \sqrt{3}\pi}{9}$$

[G-K]
p. 104

2. Régularité sous l'intégrale

Soit $f : E \times X \rightarrow \mathbb{C}$ où (E, d) est un espace métrique. On pose $F : t \mapsto \int_X f(t, x) \, d\mu(x)$.

Théorème 26 (Continuité sous le signe intégral). On suppose :

- (i) $\forall t \in E, x \mapsto f(t, x)$ est mesurable.
- (ii) pp. en $x \in X, t \mapsto f(t, x)$ est continue en $t_0 \in E$.
- (iii) $\exists g \in L_1(X)$ positive telle que

$$|f(t, x)| \leq g(x) \quad \forall t \in E, \text{ pp. en } x \in X$$

Alors F est continue en t_0 .

[Z-Q]
p. 312

Exemple 27. La fonction Γ de l'Exemple 11 est bien définie et continue sur \mathbb{R}_*^+ .

p. 318

On suppose maintenant que E est un intervalle I ouvert de \mathbb{R} .

p. 313

Théorème 28 (Dérivation sous le signe intégral). On suppose :

- (i) $\forall t \in I, x \mapsto f(t, x) \in L_1(X)$.
- (ii) pp. en $x \in X, t \mapsto f(t, x)$ est dérivable sur I . On notera $\frac{\partial f}{\partial t}$ cette dérivée définie presque partout.
- (iii) $\forall K \subseteq I$ compact, $\exists g_K \in L_1(X)$ positive telle que

$$\left| \frac{\partial f}{\partial t}(x, t) \right| \leq g_K(x) \quad \forall t \in I, \text{ pp. en } x$$

Alors $\forall t \in I, x \mapsto \frac{\partial f}{\partial t}(x, t) \in L_1(X)$ et F est dérivable sur I avec

$$\forall t \in I, F'(t) = \int_X \frac{\partial f}{\partial t}(x, t) d\mu(x)$$

Application 29 (Transformée de Fourier d'une Gaussienne). En résolvant une équation différentielle linéaire, on a

[GOU20]
p. 169

$$\forall \alpha > 0, \forall x \in \mathbb{R}, \int_{\mathbb{R}} e^{-\alpha t^2} e^{-itx} dt = \sqrt{\frac{\pi}{\alpha}} e^{-\frac{x^2}{4\alpha}}$$

[DEV]

Application 30 (Intégrale de Dirichlet). On pose $\forall x \geq 0$,

[G-K]
p. 107

$$F(x) = \int_0^{+\infty} \frac{\sin(t)}{t} e^{-xt} dt$$

alors :

- (i) F est bien définie et est continue sur \mathbb{R}^+ .
- (ii) F est dérivable sur \mathbb{R}_*^+ et $\forall x \in \mathbb{R}_*^+, F'(x) = -\frac{1}{1+x^2}$.
- (iii) $F(0) = \int_0^{+\infty} \frac{\sin(t)}{t} dt = \frac{\pi}{2}$.

IV - Utilisation de l'analyse complexe

1. Formule intégrale de Cauchy

Soit Ω un ouvert de \mathbb{C} . Soit $f : \Omega \rightarrow \mathbb{C}$.

[QUE]
p. 134

Théorème 31 (Cauchy homologique). Soit Γ un cycle homologue à zéro dans Ω (ie. tel que $z \notin \Omega \implies I(a, \Gamma) = 0$). On suppose $f \in \mathcal{H}(\Omega)$. Alors,

$$\int_{\Gamma} f(z) dz = 0$$

Corollaire 32 (Formule intégrale de Cauchy). Soit Γ un cycle homologue à zéro dans Ω . On suppose $f \in \mathcal{H}(\Omega)$. Alors,

$$z_0 \in \Omega \setminus \Gamma^* \implies \frac{1}{2i\pi} \int_{\Gamma} \frac{f(z)}{z - z_0} dz = I(z_0, \gamma) f(z_0)$$

Corollaire 33. On a $\mathcal{H}(\Omega) \subseteq \mathcal{A}(\Omega)$. De plus, si $a \in \Omega$ et que l'on pose $d = d(a, \mathbb{C} \setminus \Omega)$, on a

p. 85

$$f(a+h) = \sum_{n=0}^{+\infty} a_n h^n \text{ pour } |h| < d \text{ avec } a_n = \frac{f^{(n)}(a)}{n!} = \frac{1}{2i\pi} \int_{C^+(a,d)} \frac{f(z)}{(z-a)^{n+1}} dz$$

[BMP]
p. 64

[DEV]

Application 34 (Transformée de Fourier d'une gaussienne). On définit $\forall a \in \mathbb{R}_*^+$,

[AMR08]
p. 156

$$\gamma_a : \begin{array}{l} \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R} \\ x \mapsto e^{-ax^2} \end{array}$$

Alors,

$$\forall \xi \in \mathbb{R}, \widehat{\gamma_a}(\xi) = \sqrt{\frac{\pi}{a}} e^{-\frac{\xi^2}{4a}}$$

2. Théorème des résidus

Théorème 35 (des résidus). On suppose f méromorphe sur Ω et on note A l'ensemble de ses pôles. Soit γ une courbe homologue à zéro dans Ω et ne rencontrant pas A . Alors,

[QUE]
p. 169

$$\int_{\gamma} f(z) dz = 2i\pi \sum_{a \in A} I(a, \gamma) \text{Res}(f, a)$$

p. 173

Exemple 36.

$$\int_0^{2\pi} \frac{1}{3 + 2 \cos(t)} dt = \frac{2\pi}{\sqrt{5}}$$

Exemple 37 (Intégrale de Dirichlet).

$$\int_0^{+\infty} \frac{\sin(x)}{x} dx = \frac{\pi}{2}$$

V - Calcul approché d'intégrales

Soit f une fonction réelle continue sur un intervalle $[a, b]$. On se donne $n + 1$ points $x_0, \dots, x_n \in [a, b]$ distincts deux-à-deux.

[DEM]
p. 21

Définition 38. Pour $i \in \llbracket 0, n \rrbracket$, on définit le i -ième **polynôme de Lagrange** associé à x_1, \dots, x_n par

$$\ell_i : x \mapsto \prod_{\substack{j=0 \\ j \neq i}}^n \frac{x - x_j}{x_i - x_j}$$

Théorème 39. Il existe une unique fonction polynômiale p_n de degré n telle que $\forall i \in \llbracket 0, n \rrbracket, p_n(x_i) = f(x_i)$:

$$p_n = \sum_{i=0}^n f(x_i) \ell_i$$

Théorème 40. On note $\pi_{n+1} : x \mapsto \prod_{j=0}^n (x - x_j)$ et on suppose f $n + 1$ fois dérivable $[a, b]$. Alors, pour tout $x \in [a, b]$, il existe un réel $\xi_x \in \min(x, x_i), \max(x, x_i)[$ tel que

$$f(x) - p_n(x) = \frac{\pi_{n+1}(x)}{(n+1)!} f^{(n+1)}(\xi_x)$$

Corollaire 41.

$$\|f - p_n\|_\infty \leq \frac{1}{(n+1)!} \|\pi_{n+1}\|_\infty \|f^{(n+1)}\|_\infty$$

Application 42 (Calculs approchés d'intégrales). On note $I(f) = \int_a^b f(t) dt$. L'objectif est d'approximer $I(f)$ par une expression $P(f)$ et de majorer l'erreur d'approximation $E(f) = |I(f) - P(f)|$.

- (i) Méthode des rectangles. On suppose f continue. Avec $P(f) = (b-a)f(a)$, on a $E(f) \leq \frac{(b-a)^2}{2} \|f'\|_\infty$.
- (ii) Méthode du point milieu. On suppose f de classe \mathcal{C}^2 . Avec $P(f) = (b-a)f\left(\frac{a+b}{2}\right)$, on

[DAN]
p. 506

$$a E(f) \leq \frac{(b-a)^3}{24} \|f''\|_{\infty}.$$

(iii) Méthode des trapèzes. On suppose f de classe \mathcal{C}^2 . Avec $P(f) = \frac{b-a}{2}(f(a) + f(b))$, on

$$a E(f) \leq \frac{(b-a)^3}{12} \|f''\|_{\infty}.$$

(iv) Méthode de Simpson. On suppose f de classe \mathcal{C}^4 . Avec $P(f) =$

$$\frac{b-a}{6} \left(f(a) + f(b) + 4f\left(\frac{a+b}{2}\right) \right), \text{ on a } E(f) \leq \frac{(b-a)^3}{2880} \|f^{(4)}\|_{\infty}.$$