



DIRO
IFT 2425

DÉMONSTRATION N° 7

Max Mignotte

DIRO, Département d'Informatique et de Recherche Opérationnelle, local 2384.

[http : //www.iro.umontreal.ca/~mignotte/ift2425/](http://www.iro.umontreal.ca/~mignotte/ift2425/)
E-mail : mignotte@iro.umontreal.ca

CORRECTION DE L'INTRA

I	Mesure d'incertitude.
II	Méthode du point fixe et de Newton-Raphson.
III	Convergence linéaire et quadratique.
IV	Norme de Matrice.
V	Factorisation P^tLU avec élimination Gaussienne.
VI	Interpolation de lagrange et Newton.

I. Mesure d'incertitude (15 pts)

Calculer l'erreur absolue et relative sur la durée des oscillations d'un pendule simple de longueur l . La période est donnée par la formule

$$T = 2\pi \sqrt{\frac{l}{g}},$$

si $\pi = 3.141$ à 10^{-3} près (i.e., $\Delta\pi = 10^{-3}$), $l = 1$ m à 10^{-3} près, et $g = 9.81 \text{ ms}^{-2}$ à 10^{-2} près. Donner l'approximation de T et arrondir au nombre de cse adéquat.

Réponse

On a pour valeur approchée

$$T = \frac{6,282}{\sqrt{9.81}} \approx 2.006 \text{ s},$$

On obtient la différentielle suivante

$$\Delta T = \left| 2\sqrt{\frac{l}{g}} \right| \Delta\pi + \left| \frac{\pi}{\sqrt{lg}} \right| \Delta l + \left| -\frac{\pi}{g} \sqrt{\frac{l}{g}} \right| \Delta g.$$

$$\begin{aligned} \text{soit } \Delta T &= \left| 2\sqrt{\frac{1}{9.81}} \right| 10^{-3} + \left| \frac{3.141}{\sqrt{9.81}} \right| 10^{-3} + \left| -\frac{3.141}{9.81} \sqrt{\frac{1}{9.81}} \right| 10^{-2}, \\ \Delta T &\approx 6.39 \cdot 10^{-4} + 1.00 \cdot 10^{-3} + 1.01 \cdot 10^{-3}, \\ \Delta T &\approx 2.65 \cdot 10^{-3}. \end{aligned}$$

On obtient aussi l'erreur relative

$$\frac{\Delta T}{T} = 1.32 \cdot 10^{-3}.$$

On trouve donc (2 cse après la virgule sont conservés) :

$$T = 2.00 \text{ s} \quad \text{avec} \quad \Delta T = 2.65 \cdot 10^{-3}.$$

II. Méthode du point fixe et de Newton-Raphson (25 pts)

On se propose de trouver des valeurs approchées de la racine r de l'équation

$$f(x) = x^3 + x - 1 = 0.$$

1. Méthode du point fixe.

- (a) En remarquant que l'équation proposée est équivalente à $g_1(x) = x$ avec $g_1(x) = \frac{1}{1+x^2}$, montrer que l'intervalle $J_1 = [0, 1]$ est un intervalle sur lequel la convergence vers une solution unique est assurée.
- (b) Déterminer analytiquement un majorant de $|r_n - r|$, où r_n désigne la valeur approchée, à la n ème itération, de cette racine par la méthode itérative du point fixe.
- (c) En déduire une valeur approchée de r à 10^{-3} près en partant de $r_0 = 1$ et arrondir au nombre adéquat de cse.

2. Méthode de Newton-Raphson.

- (a) Soit $g_2(x)$, la fonction intervenant dans la méthode itérative de Newton pour la résolution de cette équation. Donner $g_2(x)$.
- (b) Montrer que pour $x > 0$, on a l'inégalité suivante
- $$|g'_2(x)| \leq 1.125 |f(x)|.$$
- (c) Montrer que l'on a une solution unique sur l'intervalle $J_2 = [0.5, 0.75]$ et que le choix de cet intervalle permet d'assurer la convergence de la méthode de Newton.
- (d) Trouver analytiquement une majoration du type

$$|r_{n+1} - r| \leq K |r_{n+1} - r_n|.$$

- (e) En déduire une valeur approchée de r à 10^{-6} près en partant de $r_0 = 1$ et arrondir au nombre adéquat de cse.

Réponse

1.

a. L'étude des variations de la fonction $f(x)$ sur $[0, 1]$ montre que la fonction est continue et croissante sur cet intervalle. De plus, on $f(0) = -1$ et $f(1) = 1$. Il existe donc une racine r unique dans cet intervalle. Les dérivées premières et secondes de $g_1(x)$ s'écrivent

$$g'_1 = -\frac{2x}{(1+x^2)^2}, \quad g''_1 = 2 \frac{3x^2 - 1}{(1+x^2)^3}.$$

Il est clair que pour tout $x \in J_1$, on a $|g'_1(x)| < 1$ (car : $2x \leq 1 + x^2 \leq (1 + x^2)^2$). Donc la convergence est assurée.

b. De manière plus précise, en étudiant les variations de $g'_1(x)$, on voit que : $\forall x \in J_1$, $|g'_1(x)| < 0.65$. En effet, on a,

x	0	$\frac{\sqrt{3}}{3}$	1
$g''_1(x)$	-	0	+
$g'_1(x)$	0	\searrow	\nearrow -0.5

avec $m = -\frac{3\sqrt{3}}{8} \approx -0.6495$. On a donc la majoration suivante de l'erreur commise en prenant la valeur approchée r_n de r (cf. Cours).

$$|r_n - r| \leq 0.65^n.$$

c. En utilisant la précédente majoration, on aura $|r_n - r| < 10^{-3}$, si $0.65^n < 10^{-3}$, ou $n > \frac{\ln(10^{-3})}{\ln(0.65)}$, soit pour $n \geq 17$. On obtient,

$$\begin{aligned} r_0 &= 1, \\ r_1 &= 0.5, \\ r_2 &= 0.8, \\ r_3 &= 0.60, \\ r_4 &= 0.72, \\ r_5 &= 0.65, \\ r_6 &= 0.70, \\ r_7 &= 0.67, \\ r_8 &= 0.68, \\ r_9 &= 0.67, \\ r_{10} &= 0.685, \\ r_{11} &= 0.680, \\ r_{12} &= 0.683, \\ r_{13} &= 0.681, \\ r_{14} &= 0.6828, \\ r_{15} &= 0.6820, \\ r_{16} &= 0.6825, \\ r_{17} &= 0.6822. \end{aligned}$$

On a $|r_n - r| < 10^{-3} < 0.5 \times 10^{-2}$ et donc le résultat s'exprime avec 2 cse après la virgule par $r_{17} = 0.68$.

2.

a. On a

$$g_2(x) = x - \frac{f(x)}{f'(x)} = \frac{2x^3 + 1}{3x^2 + 1}.$$

b. $g_2(x)$ a pour dérivée

$$g'_2(x) = \frac{6x(x^3 + x - 1)}{(3x^2 + 1)^2} = \frac{6x}{(3x^2 + 1)^2} f(x).$$

La fonction $h(x) = \frac{6x}{(3x^2 + 1)^2}$ atteint un maximum égal à 1.125 (pour $x = \frac{1}{3}$), par suite, pour $x > 0$,

$$|g'_2(x)| \leq 1.125 |f(x)|.$$

c. L'étude des variations de la fonction $f(x)$ sur $J_2 = [0.5, 0.75]$ montre que la fonction est continue et croissante sur cet intervalle. De plus, on a $f(0.5) = -0.375$ et $f(0.75) = 0.171875$. Il existe donc une racine r unique dans cet intervalle. On a sur J_2 :

$$-0.375 \leq f(x) \leq 0.172,$$

et par suite,

$$|g'_2(x)| < 0.43,$$

ce qui assure la convergence de cette méthode vers une solution unique.

d. Par suite, on obtient,

$$\frac{1}{|1 - g'_2(x)|} < 1.76 \quad \text{sur } J_2.$$

On obtient une majoration du type (cf. Démo 2, exercice 2) :

$$|r_{n+1} - r| \leq 1.76 |r_{n+1} - r_n|.$$

e. En utilisant la précédente majoration, on obtient,

$$\begin{aligned} r_0 &= 1, \\ r_1 &= 0.75, \\ r_2 &= 0.6860465116, \\ r_3 &= 0.6823395826, \\ r_4 &= 0.6823278039, \\ r_5 &= 0.6823278038. \end{aligned}$$

On doit arrêter à la cinquième itération (car $|r_5 - r| \leq 1.76 |r_5 - r_4| = 1.76 \times 10^{-10} < 10^{-6}$) et on trouve, en arrondissant au nombre de cse adéquat $r_5 = 0.68232$.

III. Convergence linéaire et quadratique (15 pts)

Soit deux méthodes itératives dont la constante asymptotique est $C = 0.75$ et convergeant linéairement pour la première et quadratiquement pour la seconde. Calculer le nombre d'itération minimal pour que l'erreur d'approximation n'excède pas 10^{-8} dans les deux cas sachant que l'erreur à la première itération n'excède pas 0.5 (i.e., $e_0 = 0.5$).

Réponse

On a pour la première et la deuxième méthode respectivement,

$$\frac{|e_{n+1}|}{|e_n|} \approx 0.75, \quad \text{et} \quad \frac{|e_{n+1}|}{|e_n|^2} \approx 0.75.$$

Pour la méthode de convergence linéaire, on a,

$$|e_n| \approx 0.75 |e_{n-1}| \approx (0.75)^2 |e_{n-2}| \approx \dots \approx (0.75)^n |e_0|.$$

Pour la méthode de convergence quadratique, on a

$$|e_n| \approx 0.75 |e_{n-1}|^2 \approx (0.75)(0.75 |e_{n-2}|^2)^2 = (0.75)^3 |e_{n-2}|^4 \approx \dots \approx (0.75)^{2n-1} |e_0|^{2n}.$$

L'énoncé nous demande de supposer que $|e_0| = 0.5$ dans les deux cas. Pour la méthode de convergence linéaire on a,

$$e_n = (0.75)^n(0.5) \leq 10^{-8} \quad \text{pour } n \geq \frac{\ln 2 - 8 \ln 10}{\ln(0.75)} \approx 62.$$

Pour la méthode quadratique on a,

$$\begin{aligned} e_n &= (0.75)^{2n-1}(0.5)^{2n} \leq 10^{-8}, \\ e_n &= (0.75)^{-1}(0.375)^{2n} \leq 10^{-8}. \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} 2n &\geq \frac{\ln(0.75) - 8 \ln 10}{\ln(0.375)}, \\ n &\geq 10. \end{aligned}$$

On peut remarquer que la méthode de convergence quadratique demande beaucoup moins d'itération que la méthode de convergence linéaire.

IV. Norme de Matrice (5 pts)

Montrer que pour une matrice symétrique A , on a l'égalité suivante,

$$\text{cond}(A)_1 = \text{cond}(A)_\infty.$$

Réponse

Par définition, on a,

$$\text{cond}(A) = \|A\| \cdot \|A^{-1}\|.$$

Pour une matrice symétrique, $A = A^t$, et

$$\|A\|_1 = \|A^t\|_1 = \|A\|_\infty.$$

De plus on a,

$$\|A^{-1}\|_1 = \|(A^t)^{-1}\|_1 = \|(A^{-1})^t\|_1 = \|A^{-1}\|_\infty.$$

Par conséquent, si la matrice est symétrique,

$$\text{cond}(A)_1 = \text{cond}(A)_\infty.$$

V. Factorisation P^tLU avec élimination Gaussienne (20 pts)

1. Décomposer la matrice A en produit P^tLU où P est la matrice de permutation par la méthode d'élimination de Gauss et pivotage partiel.
2. Calculer le déterminant de A .
3. Résoudre le système $Ax = b$ pour $b = (1, 2, 3)^t$.

$$A = \begin{pmatrix} 2 & -1 & 0 \\ 4 & -1 & 2 \\ -6 & 2 & 0 \end{pmatrix}.$$

Réponse

1.

On intervertit la ligne 1 et la ligne 3 ce qui donne

$$A = \begin{pmatrix} -6 & 2 & 0 \\ 4 & -1 & 2 \\ 2 & -1 & 0 \end{pmatrix}.$$

L'opération ligne₂ = ligne₂ - (-2/3)ligne₁ et ligne₃ = ligne₃ - (-1/3)ligne₁ donne,

$$A = \begin{pmatrix} -6 & 2 & 0 \\ 0 & (1/3) & 2 \\ 0 & (-1/3) & 0 \end{pmatrix}.$$

L'opération ligne₃ = ligne₃ - (-1)ligne₂ donne,

$$A = \begin{pmatrix} -6 & 2 & 0 \\ 0 & (1/3) & 2 \\ 0 & 0 & 2 \end{pmatrix}.$$

On a donc la décomposition suivante :

$$A = \underbrace{\begin{pmatrix} -6 & 2 & 0 \\ 4 & -1 & 2 \\ 2 & -1 & 0 \end{pmatrix}}_{P^t} = \underbrace{\begin{pmatrix} 0 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \end{pmatrix}}_L \underbrace{\begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ (-2/3) & 1 & 0 \\ (-1/3) & -1 & 1 \end{pmatrix}}_U \underbrace{\begin{pmatrix} -6 & 2 & 0 \\ 0 & (1/3) & 2 \\ 0 & 0 & 2 \end{pmatrix}}_U.$$

2.

$$\begin{aligned} \det(A) &= \det(P) \times \det(L) \times \det(U), \\ &= -1 \times 1 \times (-6 \times (1/3) \times 2), \\ &= 4. \end{aligned}$$

3.

On doit résoudre le système suivant

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ (-2/3) & 1 & 0 \\ (-1/3) & -1 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} -6 & 2 & 0 \\ 0 & (1/3) & 2 \\ 0 & 0 & 2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 3 \\ 2 \\ 1 \end{pmatrix}.$$

Par substitution avant puis arrière on trouve, $Ly = b$ avec $y = (3, 4, 6)^t$, puis $Ux = y$ avec finalement $x = ((-15/6), -6, 3)^t$.

VI. Interpolation de lagrange et Newton (20 pts)

Soit les points suivants

x_k	0	1	4	6
y_k	1	-1	1	-1

1. Appliquez la formule de Lagrange pour trouver un polynôme de degré trois qui passe par ces points. Evaluatez ensuite ce polynôme pour $x = 2, 3, 5$.
2. Appliquez la formule de Newton pour trouver un polynôme de degré trois qui passe par ces points. Evaluatez ensuite ce polynôme pour $x = 2, 3, 5$.

Réponse

1.

On trouve par Lagrange :

$$P_3(x) = \frac{(x-1)(x-4)(x-6)}{-24} - \frac{x(x-4)(x-6)}{15} + \frac{x(x-1)(x-6)}{-24} - \frac{x(x-1)(x-4)}{60}.$$

Pour l'interpolation on trouve,

$$\begin{aligned} P(2) &= -1, \\ P(3) &= 0, \\ P(5) &= 1. \end{aligned}$$

2.

Le tableau des différences divisées s'écrit,

x	y	Δy	$\Delta^2 y$	$\Delta^3 y$
0	1	-2		
1	-1	(2/3)	2/3	-(1/6)
4	1	-1	-1/3	
6	-1			

On obtient le polynome suivant :

$$P_3(x) = 1 - 2x + (2/3)x(x - 1) - (1/6)x(x - 1)(x - 4).$$

Pour l'interpolation on trouve la même chose que pour lagrange car le polynome de collocation de degré trois est unique.

$$\begin{aligned} P(2) &= -1, \\ P(3) &= 0, \\ P(5) &= 1. \end{aligned}$$