

Chapitre 4 : Méthodes itératives pour la résolution des systèmes linéaires et non-linéaires

Équipe de Mathématiques Appliquées

UTC

Septembre 2021



Chapitre 4

Méthodes itératives

4.1	Méthodes itératives de résolution des systèmes linéaires	3
4.2	Résolution d'une équation non-linéaire à une inconnue	14
4.3	Résolution d'un système d'équations non-linéaires	33

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

4.1 Méthodes itératives de résolution des systèmes linéaires

4.1.1	Principes généraux	4
4.1.2	La méthode de Jacobi	6
4.1.3	La méthode de Gauss-Seidel	9
4.1.4	Étude de la convergence des méthodes itératives	11

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

4.1.1 Principes généraux

Les méthodes itératives sont utilisées soit pour la résolution de systèmes linéaires de très grande taille, soit lorsque l'on dispose d'une estimation de la solution que l'on veut améliorer.

Une méthode itérative consiste à construire une suite de vecteurs $x^{(0)}, x^{(1)}, \dots, x^{(k)}, \dots$ qui, on l'espère, ou mieux on le démontre, convergera vers la solution du système linéaire à résoudre.

Soit $A \in \mathcal{M}_{nn}(\mathbb{R})$ une matrice régulière et $b \in \mathbb{R}^n$ donnés. On se propose de résoudre le problème

$$f(x) = Ax - b = 0$$

par une méthode itérative de la forme suivante :

$$\begin{cases} x^{(0)} \text{ donné} \\ Mx^{(k+1)} = Nx^{(k)} + b \end{cases}$$

où les matrices $M, N \in \mathcal{M}_{nn}(\mathbb{R})$, M inversible, sont convenablement choisies.

Si cette méthode itérative converge, c'est-à-dire si la suite $x^{(k)}$ converge vers \bar{x} alors on a, à la limite,

$$(M - N)\bar{x} = b,$$

ce qui correspondra à la résolution de $Ax = b$ si

$$A = M - N.$$

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents

Il y a une infinité de choix possibles pour M et N vérifiant $A = M - N$, nous allons en donner deux à titre d'exemples. L'idée est bien sûr de choisir une matrice M particulièrement facile à inverser, par exemple diagonale, ou bien triangulaire inférieure. Ces deux choix correspondent respectivement à la *méthode de Jacobi* et à la *méthode de Gauss-Seidel*.

Principes généraux

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

4.1.2 La méthode de Jacobi

Exercices :

[Exercice B.1.1](#)

[Exercice B.1.2](#)

Le système linéaire $Ax = b$ s'écrit

$$\left\{ \begin{array}{l} \sum_{j=1}^n a_{1j}x_j = b_1, \\ \dots \\ \sum_{j=1}^n a_{ij}x_j = b_i, \text{ pour } 2 \leq i \leq n-1, \\ \dots \\ \sum_{j=1}^n a_{nj}x_j = b_n. \end{array} \right.$$

La méthode de Jacobi consiste, à chaque itération k , à résoudre chaque équation par rapport à l'une des variables, les autres étant fixées à leurs valeurs obtenues à l'itération précédente. Soit donc le vecteur $x^{(k)}$ donné, alors on détermine successivement les

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

composantes de $x^{(k+1)}$ par les formules :

$$\left\{ \begin{array}{l} a_{11}x_1^{(k+1)} = b_1 - \sum_{j=2}^n a_{1j}x_j^{(k)}, \\ \dots \\ a_{ii}x_i^{(k+1)} = b_i - \sum_{j=1, j \neq i}^n a_{ij}x_j^{(k)}, \text{ pour } 2 \leq i \leq n-1, \\ \dots \\ a_{nn}x_n^{(k+1)} = b_n - \sum_{j=1}^{n-1} a_{nj}x_j^{(k)}. \end{array} \right.$$

Les formules précédentes ne définissent effectivement $x^{(k+1)}$ que si les coefficients diagonaux de A sont tous non nuls. Ceci n'est pas une restriction, car on peut démontrer que si une matrice est inversible, il existe une permutation de ses lignes telle que tous les éléments de la diagonale de la matrice ainsi obtenue soient non nuls (voir exercice).

On peut écrire les relations précédentes sous forme matricielle. Pour cela introduisons la décomposition suivante de A :

$$A = D - E - F,$$

avec

- D matrice diagonale contenant la diagonale de A ,
- E matrice triangulaire inférieure (triangle inférieur de $-A$),
- F matrice triangulaire supérieure (triangle supérieur de $-A$),

La méthode de Jacobi

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Avec ces notations on peut écrire le système $Ax = b$ sous la forme

$$Dx = (E + F)x + b,$$

La méthode de Jacobi s'écrit

$$\begin{cases} x^{(0)} \text{ donné,} \\ Dx^{(k+1)} = (E + F)x^{(k)} + b. \end{cases}$$

La méthode de Jacobi

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

4.1.3 La méthode de Gauss-Seidel

Exercices :

[Exercice B.1.3](#)

Cours :

[Jacobi](#)

Il s'agit d'une modification de la méthode de Jacobi qui consiste à utiliser pour chaque équation les composantes de $x^{(k+1)}$ déjà calculées, ceci conduit aux formules

$$\left\{ \begin{array}{l} a_{11}x_1^{(k+1)} = b_1 - \sum_{j=2}^n a_{1j}x_j^{(k)}, \\ \vdots \\ a_{ii}x_i^{(k+1)} = b_i - \sum_{j=1}^{i-1} a_{ij}x_j^{(k+1)} - \sum_{j=i+1}^n a_{ij}x_j^{(k)}, \text{ pour } 2 \leq i \leq n-1, \\ \vdots \\ a_{nn}x_n^{(k+1)} = b_n - \sum_{j=1}^{n-1} a_{nj}x_j^{(k+1)}. \end{array} \right.$$

Sous forme matricielle cela revient à écrire le système $Ax = b$ sous la forme

$$(D - E)x = Fx + b,$$

où les matrices D , E et F ont été données dans le paragraphe référencé sur la méthode de Jacobi.

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

La méthode de Gauss-Seidel s'écrit donc

$$\begin{cases} x^{(0)} \text{ donné,} \\ (D - E)x^{(k+1)} = (Fx^{(k)} + b), \end{cases}$$

A chaque itération la matrice du système à résoudre est triangulaire inférieure.

On observe que les méthodes de Jacobi et Gauss-Seidel que nous venons de voir peuvent se mettre sous la forme $Mx^{(k+1)} = Nx^{(k)} + b$:

- $M = D$, $N = E + F$, pour la méthode de Jacobi,
- $M = D - E$, $N = F$, pour la méthode de Gauss-Seidel.

La méthode de Gauss-Seidel

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

4.1.4 Étude de la convergence des méthodes itératives

Exercices :
[Exercice B.1.4](#)

Commençons par étudier la convergence de la méthode itérative

$$\begin{cases} x^{(0)} \text{ donné,} \\ x^{(k+1)} = Cx^{(k)} + d. \end{cases} \quad (4.1.1)$$

Proposition 4.1.1. *S'il existe une norme matricielle subordonnée telle que*

$$\|C\| < 1$$

la méthode (4.1.1) est convergente quel que soit le choix de $x^{(0)}$ et elle converge vers la solution de

$$(I - C)\bar{x} = d.$$

Démonstration - Tout d'abord la solution \bar{x} du système d'équations $(I - C)\bar{x} = d$ existe et elle est unique, car la matrice $I - C$ est inversible. En effet

$$x \in \ker(I - C) \Leftrightarrow x = Cx \Rightarrow \|x\| = \|Cx\| \leq \|C\| \|x\|,$$

Sommaire
 Concepts

Exemples
 Exercices
 Documents

si $\|x\| \neq 0$, on aurait, après simplification $1 \leq \|C\|$, ce qui est contraire à l'hypothèse, donc $\|x\| = 0$, donc $x = 0$. On vient de montrer que $\ker(I - C) = \{0\}$, ce qui est équivalent à $I - C$ inversible, car la matrice $I - C$ est carrée.

Montrons maintenant que $x^{(k)}$ converge vers \bar{x} solution de $(I - C)\bar{x} = d$. On a

$$x^{(k)} - \bar{x} = C(x^{(k-1)} - \bar{x}) = C^2(x^{(k-2)} - \bar{x}) = \dots = C^k(x^{(0)} - \bar{x}),$$

d'où

$$\|x^{(k)} - \bar{x}\| \leq \|C\|^k \|x^{(0)} - \bar{x}\| \leq \|C\|^k \|x^{(0)} - \bar{x}\|.$$

Passons à la limite quand k tend vers l'infini. Puisque $\|C\| < 1$, $\|C\|^k$ tend vers 0 et donc $x^{(k)}$ tend vers \bar{x} .

Définition 4.1.1. *On dit que la matrice A est à diagonale strictement dominante si*

$$|a_{ii}| > \sum_{j \neq i} |a_{ij}|, \quad \forall i, 1 \leq i \leq n. \tag{4.1.2}$$

Proposition 4.1.2. *Si la matrice A est à diagonale strictement dominante alors les méthodes de Jacobi et Gauss-Seidel sont convergentes.*

Démonstration - Démontrons cette proposition pour la méthode de Jacobi. La démonstration sera faite en travaux dirigés pour la méthode de Gauss-Seidel.

La méthode de Jacobi s'écrit

$$x^{(k+1)} = D^{-1}[b + (E + F)x^{(k)}],$$

Étude de la convergence des méthodes itératives

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents

et donc la matrice d'itération est

$$C = D^{-1}(E + F).$$

Puisque A est à diagonale dominante, on a

$$\|D^{-1}(E + F)\|_{\infty} = \max_{1 \leq i \leq n} \left(\frac{1}{|a_{ii}|} \sum_{j \neq i} |a_{ij}| \right) < 1$$

et donc la méthode est convergente.

Un autre résultat intéressant pour les applications est le suivant (nous l'admettrons sans démonstration) :

Proposition 4.1.3. *Si la matrice A est symétrique définie positive, alors la méthode de Gauss-Seidel est convergente.*

Un résultat intéressant et admis sur la convergence des méthodes itératives donne une caractérisation à partir du rayon spectral de la matrice C .

Théorème 4.1.2. *Une condition nécessaire et suffisante pour que la méthode itérative (4.1.1) soit convergente est que*

$$\rho(C) < 1.$$

Étude de la convergence des méthodes itératives

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

4.2 Résolution d'une équation non-linéaire à une inconnue

4.2.1	Méthode de la dichotomie	15
4.2.2	Le principe des méthodes de point fixe	17
4.2.3	Convergence des méthodes de point fixe	19
4.2.4	Méthode de Newton pour résoudre une équation	25
4.2.5	Convergence de la méthode de Newton pour résoudre une équation	28
4.2.6	La méthode de la sécante	30

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

4.2.1 Méthode de la dichotomie

Exercices :

[Exercice B.1.5](#)

On veut résoudre $f(x) = 0$, où f est une fonction de \mathbb{R} dans \mathbb{R} non linéaire (sinon c'est évident!). On recherche donc un nombre réel x^* tel que $f(x^*) = 0$. Comme pour toute méthode itérative, on va donc construire une suite de nombres réels $x^{(0)}, x^{(1)}, \dots, x^{(k)}, \dots$ qui converge vers x^* . Puisqu'ici les termes de la suite sont des nombres réels, on les notera plus simplement $x_0, x_1, \dots, x_k, \dots$

Le principe de la dichotomie est très simple. On suppose que $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ est continue et que $f(a)f(b) < 0$, c'est-à-dire qu'il y a au moins une racine réelle de f dans $[a, b]$. On prend alors le milieu de l'intervalle $c = \frac{a+b}{2}$. Si $f(c) = 0$ (ou numériquement très proche de 0) on considère que l'on a résolu le problème. Autrement deux cas peuvent se présenter. Si $f(a)f(c) < 0$, alors f a une racine réelle dans $[a, c]$ (au moins une, en tous cas, un nombre impair de racines), autrement $f(a)f(c) > 0$ et donc $f(a)f(b)f(a)f(c) < 0$, ce qui donne $f(b)f(c) < 0$ et f a une racine réelle dans $[c, b]$. On itère alors le processus avec l'intervalle qui contient au moins une racine.

La méthode de dichotomie s'écrit :

$$a_0 = a, \quad b_0 = b, \quad x_0 = \frac{a_0 + b_0}{2},$$

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

si $f(x_k)f(a_k) < 0$ alors $a_{k+1} = a_k$ et $b_{k+1} = x_k$ sinon $a_{k+1} = x_k$ et $b_{k+1} = b_k$.

$$x_{k+1} = \frac{a_{k+1} + b_{k+1}}{2},$$

Il est clair qu'à chaque itération la longueur l_k de l'intervalle de localisation de la racine x^* est divisée par 2. On sait de plus que $|x_k - x^*| \leq l_k$, d'où le résultat de convergence de la suite (x_k) vers x^* si on montre que l_k tend vers 0

Proposition 4.2.1. *La suite de segments $([a_k, b_k])_{k \geq 0}$ est telle que*

$$l_k = b_k - a_k = \frac{b - a}{2^k}, \quad k \geq 1.$$

Cette proposition est utile sur le plan numérique; en effet elle renseigne sur le nombre minimal d'itérations nécessaires pour calculer la racine à ϵ près, $\epsilon > 0$ étant une précision fixée à l'avance par l'utilisateur (test d'arrêt). En effet, on peut montrer (en exercice) que ce nombre n doit vérifier

$$n \geq \log_2 \left(\frac{b - a}{\epsilon} \right).$$

Méthode de la dichotomie

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

4.2.2 Le principe des méthodes de point fixe

Exercices :

[Exercice B.1.6](#)

Pour résoudre $f(x) = 0$, on peut se ramener à un problème équivalent de la forme $g(x) = x$ (par exemple en posant $g(x) = f(x) + x$). Mais il y a beaucoup de choix possibles pour définir g ! La résolution de $g(x) = x$ s'appelle recherche des points fixes de g .

Par exemple, pour calculer la racine carrée d'un nombre réel $a > 0$, on résout $x^2 = a$. Il existe alors différentes manières de se ramener à un problème de point fixe :

—

$$x = \frac{a}{x}, \text{ et } g_1(x) = \frac{a}{x},$$

—

$$2x = x + \frac{a}{x} \text{ soit } x = 2x - \frac{a}{x} \text{ et } g_2(x) = 2x - \frac{a}{x},$$

—

$$x = \frac{x}{2} + \frac{a}{2x}, \text{ et } g_3(x) = \frac{x}{2} + \frac{a}{2x}.$$

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Pour résoudre $g(x) = x$, problème équivalent à $f(x) = 0$, les méthodes dites de point fixe, consistent à construire la suite $x_0, x_1, \dots, x_k, \dots$ de la façon suivante :

$$\begin{cases} x_0 \text{ donné,} \\ x_{k+1} = g(x_k), k > 0 \end{cases}$$

Si la suite (x_k) converge, la continuité de g implique qu'elle converge vers un point fixe x^* de g . En effet

$$x^* = \lim_{k \rightarrow \infty} x_{k+1} = g(\lim_{k \rightarrow \infty} x_k) = g(x^*).$$

Vous verrez en exercice comment se comportent graphiquement les différentes suites dans le cas des exemples cités plus haut. Vous vous apercevrez qu'elles ne convergent pas toujours et qu'il faut donc choisir soigneusement la fonction g . Le paragraphe suivant donne quelques conditions sur la fonction g pour que la suite converge.

Le principe des méthodes de point fixe

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

4.2.3 Convergence des méthodes de point fixe

Exercices :

[Exercice B.1.7](#)[Exercice B.1.8](#)[Exercice B.1.9](#)[Exercice B.1.10](#)

Cours :

[Point fixe/ Principe](#)

Définition 4.2.1. Soit I un intervalle non vide de \mathbb{R} . Soit g une fonction de I dans \mathbb{R} .

— g est dite lipschitzienne si il existe $k \geq 0$ tel que $\forall y, z \in I$,

$$|g(y) - g(z)| \leq k|y - z|.$$

— g est dite contractante si g est lipschitzienne avec une constante $k < 1$.

On remarque que toute fonction lipschitzienne est continue sur I .

La proposition qui suit est une version simplifiée du **Théorème 4.3.2 du point fixe** (qui est énoncé sur \mathbb{R}^n , $n \geq 1$). La proposition reste valide sur un intervalle de \mathbb{R} fermé non vide et non borné (de type $] -\infty, b]$ ou $[a, \infty[$ ou \mathbb{R}), mais la démonstration est alors différente.

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Proposition 4.2.2. Soit a et b dans \mathbb{R} , tels que $a < b$.

Soit une fonction $g : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$.

On suppose de plus que $g([a, b]) \subset [a, b]$ et que g est contractante sur $[a, b]$.

Alors g possède un point fixe unique $x^* \in [a, b]$ et la suite

$$\begin{cases} x_0 \text{ donné dans } [a, b], \\ x_{n+1} = g(x_n), n > 0 \end{cases}$$

converge vers x^* .

Démonstration - On note que $[a, b]$ est un intervalle fermé, borné et non vide.

La première partie est une conséquence immédiate du théorème des valeurs intermédiaires. En effet, si l'on n'est pas dans les cas évidents $g(a) = a$ ou $g(b) = b$, la fonction continue $H(x) = g(x) - x$ est telle que $H(a) (= g(a) - a) > 0$ (car $g(a) \in [a, b]$) et $H(b) (= g(b) - b) < 0$ (car $g(b) \in [a, b]$). Il existe donc un point x^* de $]a, b[$ tel que $H(x^*) = 0$, c'est-à-dire un point fixe de g . On montre aisément en exercice que ce point fixe est unique.

Pour montrer la convergence de la suite vers x^* , on calcule

$$|x_n - x^*| = |g(x_{n-1}) - g(x^*)| \leq k|x_{n-1} - x^*|.$$

En itérant le processus, on trouve

$$|x_n - x^*| \leq k^n |x_0 - x^*|.$$

Convergence des méthodes de point fixe

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Puisque $k < 1$, la suite k^n tend vers 0 quand $n \rightarrow \infty$, ce qui démontre la convergence de la suite.

Le corollaire qui suit est pratique quand la fonction g est régulière.

Corollaire 4.2.2. Soit a et b dans \mathbb{R} , tels que $a < b$.

Soit une fonction $g : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$.

On suppose de plus que $g([a, b]) \subset [a, b]$, que g est continûment dérivable sur $[a, b]$ et qu'il existe $k \geq 0$ tel que

$$|g'(x)| \leq k < 1, \forall x \in [a, b].$$

Alors g possède un point fixe unique $x^* \in [a, b]$ et la suite

$$\begin{cases} x_0 \text{ donné dans } [a, b], \\ x_{n+1} = g(x_n), n > 0 \end{cases}$$

converge vers x^* .

Démonstration - On applique la Proposition 4.2.2, grâce au théorèmes des accroissements finis :

$$\forall y, z \in [a, b], \exists c \in]a, b[\text{ tel que } |g(y) - g(z)| = |g'(c)| |y - z| \leq k |y - z|,$$

où $k < 1$ est indépendant de y et de z . Donc g est contractante sur $[a, b]$.

Remarquons que si l'on a une application $g : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ telle que $|g'(x)| \geq k \geq 1, \forall x \in [a, b]$ et qui possède un point fixe dans $[a, b]$, alors la suite (x_n) précédemment définie est

Convergence des méthodes de point fixe

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

divergente au sens suivant. Soit x_n sort du domaine de définition de g , soit

$$|x_n - x^*| \geq k^n |x_0 - x^*|$$

et donc la suite (x_n) s'éloigne de x^* (au mieux elle reste à une distance constante si $k = 1$).

On dit que les méthodes de point fixe ont une convergence linéaire car

$$|x_{n+1} - x^*| = |g(x_n) - g(x^*)| \leq k |x_n - x^*|.$$

De même que pour la dichotomie, on peut estimer le nombre d'itérations nécessaires pour obtenir une précision donnée. En effet, vous pourrez montrer en exercice, que

$$|x_n - x^*| \leq \frac{k^n}{1-k} |x_1 - x_0|.$$

Donc, pour une précision ϵ donnée, le nombre d'itérations n est donné par

$$\frac{k^n}{1-k} |x_1 - x_0| \leq \epsilon \Rightarrow n \leq \frac{\ln \frac{(1-k)\epsilon}{|x_1 - x_0|}}{\ln k}.$$

Dans la proposition précédente, on a supposé que la valeur absolue de la dérivée était majorée par 1 sur l'intervalle $[a, b]$ tout entier. Si l'on considère l'exemple de la racine carrée d'un nombre réel a traité dans le paragraphe référencé, on a décrit trois fonctions g pour lesquelles le point fixe x^* correspond à cette racine carrée. Calculons les dérivées correspondantes

$$\text{— } g_1(x) = \frac{a}{x}, \quad g_1'(x) = -\frac{a}{x^2}, \quad g_1'(x^*) = -1,$$

Convergence des méthodes de point fixe

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

- $g_2(x) = 2x - \frac{a}{x}$, $g_2'(x) = 2 + \frac{a}{x^2}$, $g_2'(x^*) = 3$,
- $g_3(x) = \frac{x}{2} + \frac{a}{2x}$, $g_3'(x) = \frac{1}{2} - \frac{a}{2x^2}$, $g_3'(x^*) = 0$.

Proposition 4.2.3. Soit x^* un point fixe de g , fonction continûment dérivable, tel que $|g'(x^*)| < 1$, alors la suite (x_n) définie par $x_{n+1} = g(x_n)$ converge vers x^* si x_0 est suffisamment proche de x^* .

Démonstration - Puisque g' est continue, il existe un intervalle contenant x^* tel que $|g'(x)| < 1$. Plus précisément, il existe $\alpha > 0$ tel que

$$|g'(x)| < 1, \quad \forall x \in [x^* - \alpha, x^* + \alpha].$$

Il est alors facile de montrer que g est une application de $I = [x^* - \alpha, x^* + \alpha]$ (intervalle fermé, borné et non vide) dans lui-même. En effet si $x \in I$,

$$|g(x) - x^*| = |g(x) - g(x^*)| \leq \max_{x \in I} |g'(x)| |x - x^*| \leq \alpha.$$

D'autre part, puisque la fonction $|g'|$ est continue, elle atteint son maximum sur l'intervalle I fermé, borné (compact) et non vide. Par conséquent, il existe $x_0 \in I$ tel que $\max_{x \in I} |g'(x)| = |g'(x_0)| \leq k$, et donc pour tout x de I on a $|g'(x)| \leq k < 1$.

Ceci permet d'appliquer le Corollaire 4.2.2 et de montrer ainsi que la suite $x_{n+1} = g(x_n)$ converge vers x^* si x_0 est dans I , c'est-à-dire suffisamment proche de x^* .

Remarquons que si $|g'(x^*)| > 1$, il existe un intervalle $[x^* - \alpha, x^* + \alpha]$ sur lequel $|g'(x)| \geq k > 1$. La suite (x_n) définie précédemment a peu de chance de converger vers x^* . En effet

Convergence des méthodes de point fixe

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents

si on part proche de x^* , on a

$$|x_1 - x^*| \geq k|x_0 - x^*| > |x_0 - x^*|$$

et x_1 s'éloigne de x^* . Il en sera ainsi jusqu'à ce que l'on sorte de l'intervalle $[x^* - \alpha, x^* + \alpha]$. Alors, comme on ne connaît pas le comportement de g , il se peut qu'un itéré postérieur "ré-rentre" dans l'intervalle. La seule chance que l'on a de converger, c'est alors de "tomber" sur x^* . Cette méthode n'est donc pas à utiliser dans ce cas.

Convergence des méthodes de point fixe

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

4.2.4 Méthode de Newton pour résoudre une équation

Exercices :

[Exercice B.1.11](#)

[Exercice Newton /
Système non
linéaire](#)

La méthode de Newton s'utilise pour calculer une racine de $f(x) = 0$, où f est une fonction deux fois continûment dérivable de $[a, b]$ dans \mathbb{R} . En voici le principe : soit x_0 donné, on écrit le développement de Taylor en x_0 :

$$f(x) = f(x_0) + (x - x_0)f'(x_0) + (x - x_0)\epsilon(x - x_0),$$

où $\lim_{x \rightarrow x^{(0)}} \epsilon(x - x^{(0)}) = 0$.

La méthode de Newton consiste à négliger les termes d'ordre supérieur à 1 (ce qui revient à assimiler localement la courbe à sa tangente) et à considérer alors que x_1 est le point qui annule l'approximation de f ainsi obtenue, c'est-à-dire

$$0 = f(x_0) + (x_1 - x_0)f'(x_0),$$

ce qui donne

$$x_1 = x_0 - \frac{f(x_0)}{f'(x_0)}, \quad \text{si } f'(x_0) \neq 0.$$

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

L'étape ainsi décrite qui permet de passer de x_0 à x_1 permet aussi de passer de x_n à x_{n+1} .

L'algorithme de Newton en dimension 1 (pour résoudre une équation non linéaire $f(x) = 0$) est le suivant

$$\begin{cases} x_0 \text{ donné,} \\ \text{pour } n \geq 0 : & x_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)}{f'(x_n)}, \quad \text{si } f'(x_n) \neq 0. \end{cases}$$

Une version de l'algorithme pour résoudre un système d'équations non linéaires est donnée dans le paragraphe référencé.

Il s'agit donc d'une méthode de point fixe $x_{n+1} = g(x_n)$ pour laquelle g est définie par

$$g(x) = x - \frac{f(x)}{f'(x)}.$$

La méthode de Newton est une méthode de point fixe telle que $g'(x^*) = 0$ c'est-à-dire que la dérivée s'annule au point fixe de la fonction g .

Une autre manière de présenter la méthode de Newton, plus graphique, est d'obtenir x_{n+1} comme l'intersection de la tangente à la courbe $y = f(x)$ au point x_n avec l'axe Ox (voir l'exercice).

Si la méthode de point fixe converge vers x^* , alors on a en passant à la limite quand n tend vers $+\infty$:

$$x^* = x^* - \frac{f(x^*)}{f'(x^*)}.$$

Méthode de Newton pour résoudre une équation

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

On voit alors que l'on obtient bien $f(x^*) = 0$ si $f'(x^*) \neq 0$. On suppose dorénavant que cette condition est remplie c'est-à-dire que la courbe $y = f(x)$ n'est pas tangente à l'axe Ox lorsqu'elle coupe cet axe.

Méthode de Newton pour résoudre une équation

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

4.2.5 Convergence de la méthode de Newton pour résoudre une équation

Exercices :

[Exercice B.1.12](#)

Proposition 4.2.4. *Soit f une fonction deux fois continûment dérivable sur $[a, b]$ et $x^* \in [a, b]$ tel que $f(x^*) = 0$ et $f'(x^*) \neq 0$. Alors il existe $\alpha > 0$ tel que la suite générée par la méthode de Newton*

$$x_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)}{f'(x_n)}$$

converge vers x^ pour tout $x_0 \in [x^* - \alpha, x^* + \alpha]$.*

Démonstration - Comme il s'agit d'une méthode de point fixe de la fonction $g(x) = x - \frac{f(x)}{f'(x)}$, on calcule la dérivée de cette fonction au point fixe

$$g'(x) = 1 - \frac{(f'(x))^2 - f''(x)f(x)}{f'(x)^2} = \frac{f''(x)f(x)}{(f'(x))^2}$$

et puisque $f(x^*) = 0$ on a $g'(x^*) = 0$. On peut donc appliquer la Proposition 4.2.3 qui montre l'existence de α tel que la suite $x_{n+1} = g(x_n)$ converge vers le point fixe si $x_0 \in [x^* - \alpha, x^* + \alpha]$.

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Cette proposition donne une condition suffisante de convergence mais heureusement la méthode de Newton converge souvent même si l'on part loin de la solution. Montrons maintenant que la vitesse de convergence est quadratique, ce qui est mieux que linéaire.

Proposition 4.2.5. *Soit g une fonction deux fois continûment dérivable de $[a, b]$ dans $[a, b]$, soit $x^* \in [a, b]$ tel que $g(x^*) = x^*$ et $g'(x^*) = 0$, soit $x_0 \in [a, b]$, on définit $x_{n+1} = g(x_n)$, alors :*

$$|x_{n+1} - x^*| \leq \frac{M}{2} |x_n - x^*|^2$$

où $M = \max_{x \in [a, b]} |g''(x)|$.

Démonstration - Le développement de Taylor au point x^* est donné par

$$g(x_n) = g(x^*) + (x_n - x^*)g'(x^*) + \frac{(x_n - x^*)^2}{2} g''(\xi)$$

où ξ est strictement compris entre x_n et x^* . Étant données les hypothèses sur g , on obtient

$$|x_{n+1} - x^*| = \frac{(x_n - x^*)^2}{2} |g''(\xi)| \leq \frac{M}{2} |x_n - x^*|^2.$$

On dit alors que la vitesse de convergence est quadratique.

Convergence de la méthode de Newton pour résoudre une équation

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

4.2.6 La méthode de la sécante

Exercices :[Exercice B.1.13](#)[Exercice B.1.14](#)**Cours :**[Newton/ Convergence](#)

Cette méthode peut être vue comme une approximation de la méthode de Newton, présentée dans le paragraphe référencé. En effet la méthode de Newton nécessite le calcul de la dérivée de la fonction en un point à chaque itération. Si le calcul de la dérivée est coûteux en temps ou peu précis (par exemple c'est le résultat d'une approximation numérique), on peut approcher la dérivée de la manière suivante

$$f'(x_n) = \frac{f(x_n) - f(x_{n-1})}{x_n - x_{n-1}}.$$

On obtient ainsi la méthode de la sécante :

$$\left\{ \begin{array}{l} x_0, x_1 \text{ donnés tels que } f(x_0)f(x_1) < 0, \\ x_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)(x_n - x_{n-1})}{f(x_n) - f(x_{n-1})}. \end{array} \right.$$

Ceci signifie, graphiquement, que l'on remplace la tangente par la “corde”. Il s'agit en effet de l'intersection de la droite passant par les points $(x_n, f(x_n))$ et $(x_{n-1}, f(x_{n-1}))$ avec l'axe Ox (exercice).

[Sommaire](#)
[Concepts](#)[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Cette méthode n'est pas une méthode de point fixe puisque chaque point de la suite est construit à partir des deux précédents. La convergence de la suite ne peut être assurée que pour certaines valeurs de x_0 et x_1 suffisamment proches de x^* , solution de $f(x^*) = 0$. L'étude de l'erreur est compliquée mais elle montre que

$$|x_{n+1} - x^*| \leq K|x_n - x^*|^{\frac{1+\sqrt{5}}{2}},$$

où K est une constante qui dépend de la fonction f et de la racine x^* . La vitesse de convergence, égale au nombre d'or, est plus grande que pour une convergence linéaire mais moins importante que pour une convergence quadratique puisque

$$1 < \frac{1 + \sqrt{5}}{2} < 2.$$

Cette méthode devrait donc converger moins vite que la méthode de Newton. Mais une itération de la sécante ne demande qu'une évaluation de f au point x_n (sauf pour la première itération) tandis que la méthode de Newton demande l'évaluation de f et f' . Donc, même si on suppose que l'évaluation de f et de f' a le même coût, une itération de Newton représente deux itérations de la sécante. Donc pour la comparaison des vitesses de convergence c'est $\sqrt{2} = 1,414$ qu'il faut comparer à $\frac{1+\sqrt{5}}{2} = 1,618$ et ainsi la comparaison tourne à l'avantage de la sécante.

Toutefois un inconvénient de la méthode de la sécante, telle qu'on l'a décrite, est que si deux points successifs sont sur une droite "presque parallèle" à l'axe Ox , l'intersection avec l'axe Ox part à l'"infini". Une variante de la méthode consiste à s'assurer que deux points successifs encadrent toujours la racine de f . On part donc de x_0 et x_1 qui encadrent x^* et pour calculer x_{n+1} on n'utilise x_n et x_{n-1} que s'ils entourent x^* . Sinon,

La méthode de la sécante

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents

on utilise x_n et x_{n-2} . On peut montrer alors que pour une fonction f dont la concavité a un signe constant autour de x^* , un des points servant à calculer x_{n+1} se fige (exercice) de sorte que, la méthode se comporte comme

$$x_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)(x_n - x_0)}{f(x_n) - f(x_0)}.$$

On retombe alors sur une méthode de point fixe qui a une vitesse de convergence linéaire. On obtient ainsi une convergence globale au détriment de la vitesse de convergence.

La méthode de la sécante

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents

4.3 Résolution d'un système d'équations non-linéaires

4.3.1	Rappels : Taylor et jacobienne en dimension 2	34
4.3.2	Méthodes de point fixe	36
4.3.3	Méthode de Newton pour deux équations non-linéaires	39
4.3.4	Méthode de Newton pour un système d'équations non-linéaires	41

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

4.3.1 Rappels : Taylor et jacobienne en dimension 2

On veut maintenant résoudre deux équations à deux inconnues :

$$f_1(x_1, x_2) = 0, \quad f_2(x_1, x_2) = 0.$$

On manipule maintenant des vecteurs de \mathbb{R}^2 que l'on peut noter

$$x = \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix}, \quad f(x) = \begin{pmatrix} f_1(x) \\ f_2(x) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} f_1(x_1, x_2) \\ f_2(x_1, x_2) \end{pmatrix}.$$

Comme pour toutes les méthodes itératives que l'on a vues dans ce chapitre, on va construire une suite de vecteurs censée converger vers une solution de $f(x) = 0$, on notera les vecteurs de la suite $x^{(0)}, x^{(1)}, \dots, x^{(k)}, \dots$

Pour cela, nous allons avoir besoin de rappels de calcul différentiel. Notons que les résultats se généralisent en dimension $n \geq 2$.

Soit $x^{(0)}$ un vecteur donné. On suppose que la fonction $f : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}^2$ est différentiable en $x^{(0)}$. Cela s'écrit

$$\begin{cases} f_1(x) = f_1(x^{(0)}) + \frac{\partial f_1}{\partial x_1}(x^{(0)})(x_1 - x_1^{(0)}) + \frac{\partial f_1}{\partial x_2}(x^{(0)})(x_2 - x_2^{(0)}) + \|x - x^{(0)}\| \varepsilon_1(x - x^{(0)}), \\ f_2(x) = f_2(x^{(0)}) + \frac{\partial f_2}{\partial x_1}(x^{(0)})(x_1 - x_1^{(0)}) + \frac{\partial f_2}{\partial x_2}(x^{(0)})(x_2 - x_2^{(0)}) + \|x - x^{(0)}\| \varepsilon_2(x - x^{(0)}), \end{cases}$$

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents

où $\varepsilon_i(x - x^{(0)})$ ($i = 1, 2$) sont deux fonctions $\mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}$ qui tendent vers 0 quand x tend vers $x^{(0)}$ (ou, de façon équivalente, quand $\|x - x^{(0)}\| \rightarrow 0$).

Pour écrire ces équations de façon compacte, on note $Df(x^{(0)})$ la matrice jacobienne de f au point $x^{(0)}$ définie par :

$$Df(x^{(0)}) = \begin{pmatrix} \frac{\partial f_1}{\partial x_1}(x^{(0)}) & \frac{\partial f_1}{\partial x_2}(x^{(0)}) \\ \frac{\partial f_2}{\partial x_1}(x^{(0)}) & \frac{\partial f_2}{\partial x_2}(x^{(0)}) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} (\nabla f_1(x^{(0)}))^T \\ (\nabla f_2(x^{(0)}))^T \end{pmatrix} \in \mathcal{M}_{2,2}(\mathbb{R}),$$

avec les vecteurs gradients

$$\nabla f_1(x^{(0)}) = \begin{pmatrix} \frac{\partial f_1}{\partial x_1}(x^{(0)}) \\ \frac{\partial f_1}{\partial x_2}(x^{(0)}) \end{pmatrix} \text{ et } \nabla f_2(x^{(0)}) = \begin{pmatrix} \frac{\partial f_2}{\partial x_1}(x^{(0)}) \\ \frac{\partial f_2}{\partial x_2}(x^{(0)}) \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^2.$$

Si l'on note $\varepsilon = [\varepsilon_1, \varepsilon_2]^T \in \mathbb{R}^2$, les relations précédentes peuvent s'écrire :

$$f(x) = f(x^{(0)}) + Df(x^{(0)})(x - x^{(0)}) + \|x - x^{(0)}\| \varepsilon(x - x^{(0)}),$$

et $\lim_{x \rightarrow x^{(0)}} \|\varepsilon(x - x^{(0)})\| = 0$. Cela s'écrit encore :

$$f(x) = f(x^{(0)}) + \begin{pmatrix} (\nabla f_1(x^{(0)}))^T \\ (\nabla f_2(x^{(0)}))^T \end{pmatrix} (x - x^{(0)}) + \|x - x^{(0)}\| \varepsilon(x - x^{(0)}),$$

et $\lim_{x \rightarrow x^{(0)}} \|\varepsilon(x - x^{(0)})\| = 0$.

Attention : $f(x), f(x^{(0)}), x - x^{(0)}, \varepsilon(x - x^{(0)}), \nabla f_1(x^{(0)}), \nabla f_2(x^{(0)})$ sont des vecteurs colonnes. $Df(x^{(0)})$ est une matrice. $Df(x^{(0)})(x - x^{(0)})$ est un vecteur colonne. Tous les produits et sommes sont donc bien cohérents.

Rappels :
Taylor et
jacobienne en
dimension 2

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

4.3.2 Méthodes de point fixe

Cours :[Point fixe/ Principe](#)[Point fixe/ Convergence](#)**Documents :**[Document A.1.1](#)

Les résultats présentés dans ce paragraphe sont une généralisation des résultats en dimension un présentés dans les paragraphes référencés. La fonction g est continue de \mathbb{R}^n dans \mathbb{R}^n , x et $g(x)$ sont des vecteurs. Comme précédemment on construit une suite définie par :

$$\begin{cases} x^{(0)} \text{ donné,} \\ x^{(k+1)} = g(x^{(k)}), \quad \text{pour } k \geq 0. \end{cases}$$

Quand “tout se passe bien”, cette suite converge vers \hat{x} vérifiant $\hat{x} = g(\hat{x})$.

On a besoin de généraliser la notion de fonction contractante.

Définition 4.3.1. Soit $E \subset \mathbb{R}^n$. La fonction g est dite contractante sur E s'il existe un réel λ , $0 \leq \lambda < 1$, tels que pour tout x et tout y dans E on ait

$$\|g(x) - g(y)\| \leq \lambda \|x - y\|. \quad (4.3.1)$$

Nous allons donner deux théorèmes principaux dont vous trouverez les démonstrations en document.

[Sommaire](#)
[Concepts](#)[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Théorème 4.3.2 (du point fixe). Soit g une application de \mathbb{R}^n dans \mathbb{R}^n . On suppose que g est contractante sur \mathbb{R} .

Alors il existe un \hat{x} unique appartenant à \mathbb{R}^n tel que $\hat{x} = g(\hat{x})$ et la suite $\{x^k\}_{k \geq 0}$ définie par

$$\begin{cases} x^{(0)} \text{ donné,} \\ x^{(k+1)} = g(x^{(k)}) \quad \text{pour } k \geq 0, \end{cases}$$

converge vers \hat{x} .

Définition 4.3.3. Soit g une fonction de \mathbb{R}^n dans \mathbb{R}^n . On appelle matrice jacobienne de g la matrice $Dg(x)$ définie par

$$Dg(x) = \begin{pmatrix} \frac{\partial g_1}{\partial x_1}(x) & \dots & \frac{\partial g_1}{\partial x_n}(x) \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ \frac{\partial g_n}{\partial x_1}(x) & \dots & \frac{\partial g_n}{\partial x_n}(x) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} (\nabla g_1(x))^T \\ (\nabla g_2(x))^T \\ \dots \\ (\nabla g_n(x))^T \end{pmatrix} \in \mathcal{M}_{nn}(\mathbb{R}),$$

où g_1, \dots, g_n désignent les composantes de g .

Définition 4.3.4. La fonction g est différentiable en x si g admet des dérivées partielles en x et si la matrice jacobienne $Dg(x)$ vérifie

$$g(y) = g(x) + Dg(x)(y - x) + \|y - x\|\varepsilon(y - x)$$

où $\varepsilon(y - x)$ est un vecteur de \mathbb{R}^n qui tend vers 0 quand y tend vers x .

Le théorème suivant dont la démonstration est délicate relie la convergence de la méthode de point fixe au rayon spectral de la matrice jacobienne :

Méthodes de point fixe

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents

Théorème 4.3.5. Soit g une application de \mathbb{R}^n dans \mathbb{R}^n qui admet un point fixe \hat{x} , on suppose que g est différentiable en \hat{x} et que $\rho[Dg(\hat{x})]$, le rayon spectral de la matrice jacobienne de g , vérifie $\rho[Dg(\hat{x})] < 1$. Alors il existe η tel que si x^0 vérifie $\|x^{(0)} - \hat{x}\| < \eta$, la suite définie par

$$x^{(k+1)} = g(x^{(k)})$$

converge vers \hat{x} .

On pourrait montrer que la convergence obtenue est *linéaire*, c'est-à-dire qu'il existe $C > 0$ tel que

$$\|x^{(k+1)} - \hat{x}\| \leq C \|x^{(k)} - \hat{x}\|.$$

On parle de convergence d'*ordre* n quand on a la majoration

$$\|x^{(k+1)} - \hat{x}\| \leq C \|x^{(k)} - \hat{x}\|^n.$$

Méthodes de point fixe

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

4.3.3 Méthode de Newton pour deux équations non-linéaires

Exercices :[Exercice B.1.15](#)**Cours :**[Taylor / différentielle dim 2](#)[Newton/ Convergence](#)[Newton / Système non linéaire](#)

L'approximation par un développement de Taylor au premier ordre que nous avons utilisée pour introduire la méthode de Newton pour une équation peut être étendue à deux équations voire à n équations. Explicitons-la pour 2 équations.

Dans le développement de Taylor, on néglige le reste, on calcule l'itéré suivant $x^{(1)}$ en annulant l'approximation de f ainsi obtenue :

$$0 = f(x^{(0)}) + Df(x^{(0)})(x^{(1)} - x^{(0)})$$

Le vecteur $x^{(1)} - x^{(0)}$ se calcule en résolvant un système linéaire :

$$Df(x^{(0)})(x^{(1)} - x^{(0)}) = -f(x^{(0)})$$

Quand on a obtenu le vecteur $h = x^{(1)} - x^{(0)}$, on calcule $x^{(1)} = h + x^{(0)}$.

[Sommaire](#)
[Concepts](#)[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

On recommence les mêmes étapes pour obtenir le vecteur $x^{(2)}$ à partir du vecteur $x^{(1)}$.

La méthode de Newton est présentée dans le cas général dans le paragraphe référencé.

Méthode de Newton pour deux équations non-linéaires

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

4.3.4 Méthode de Newton pour un système d'équations non-linéaires

Cours :

[Newton/ Convergence](#)

[Newton / Système 2 équations non-linéaires](#)

On cherche à résoudre le système d'équations non-linéaires $f(x) = 0$. Comme pour le cas $n = 1$, l'idée de la méthode de Newton consiste à considérer l'approximation affine de f en $x^{(k)}$. Si f est différentiable, le développement de Taylor donne :

$$f(x^{(k)} + h) = f(x^{(k)}) + Df(x^{(k)})h + \|h\|\varepsilon(h),$$

où on a noté $Df(x)$ la matrice jacobienne de f et la fonction vectorielle $\varepsilon(h)$ vérifie $\varepsilon(h) \rightarrow 0$ quand $\|h\| \rightarrow 0$. On détermine alors le vecteur h tel que $f(x^{(k)}) + Df(x^{(k)})h = 0$, puis $x^{(k+1)} = x^{(k)} + h$.

La méthode de Newton pour résoudre le système d'équations non-linéaires $f(x) = 0$ est donnée par :

On se donne $x^{(0)}$ dans \mathbb{R}^n , puis pour $k \geq 0$

1. Calculer $J = Df(x^{(k)}) \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ et $F = f(x^{(k)}) \in \mathbb{R}^n$.
2. Résoudre le système linéaire $Jh = -F$.

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

3. Mettre à jour $x^{(k+1)} = x^{(k)} + h$.

Les itérations s'arrêtent :

- lorsque la suite devient stationnaire, c'est-à-dire que la norme de la différence entre deux itérés successifs est inférieure à une tolérance fixée à l'avance : $\|h\| \leq \text{tol}_1$,
- ou quand la norme du résidu est inférieure à une (autre) tolérance donnée : $\|f(x^{(k)})\| \leq \text{tol}_2$.

Il est donc nécessaire de résoudre un système linéaire à chaque itération. Pour cela, on peut utiliser une méthode directe (comme l'élimination de Gauss, voir Chapitre 2) pour résoudre ces systèmes linéaires.

Théorème 4.3.6. *Soit f une application de \mathbb{R}^n dans \mathbb{R}^n . on cherche à résoudre $f(x) = 0$ par la méthode de Newton. S'il existe \hat{x} tel que*

- $f(\hat{x})$ est nul,
- f est différentiable dans un voisinage de \hat{x} et $\|Df(x) - Df(\hat{x})\| \leq \alpha \|x - \hat{x}\|$,
- $Df(\hat{x})$ est inversible,

alors il existe un réel strictement positif η tel que si $x^{(0)}$ vérifie $\|x^{(0)} - \hat{x}\| < \eta$ la suite construite par la méthode de Newton converge vers \hat{x} . De plus la convergence obtenue est d'ordre 2, ou quadratique, c'est-à-dire qu'il existe une constante $C > 0$ telle que

$$\|x^{(k+1)} - \hat{x}\| \leq C \|x^{(k)} - \hat{x}\|^2.$$

Nous ne démontrerons pas ce résultat, qui est la “traduction” des hypothèses correspondantes dans le cas $n = 1$. On notera aussi que la convergence est très rapide (quadratique).

Méthode de Newton pour un système d'équations non-linéaires

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents

Annexe A

Documents

A.1 Documents du chapitre 4 44

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents

A.1 Documents du chapitre 4

A.1.1 Les théorèmes de point fixe pour les systèmes non-linéaires . . 45

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents

Document A.1.1 Les théorèmes de point fixe pour les systèmes non-linéaires

On définit en général la convergence d'une suite à l'aide de sa limite. Quand on ne connaît pas cette limite, on peut utiliser la notion de suite de Cauchy, définie par

Définition A.1.1. On dit que la suite $\{x^{(k)}\}$ est une suite de Cauchy si

$$\forall \varepsilon > 0, \exists N(\varepsilon) \in \mathbf{N} \text{ tel que } \forall k \geq N(\varepsilon), \forall p \geq 0, \|x^{(k+p)} - x^{(k)}\| \leq \varepsilon.$$

On montre qu'une suite est convergente dans un fermé de \mathbf{R}^n si et seulement si c'est une suite de Cauchy. Ceci permet d'énoncer quelques résultats sur les méthodes de point fixe.

Théorème A.1.2. Soit g une application de \mathbf{R}^n dans \mathbf{R}^n . On suppose que g est contractante sur \mathbf{R}^n . Alors il existe un \hat{x} unique appartenant à \mathbf{R}^n tel que $\hat{x} = g(\hat{x})$ et la suite $\{x^{(k)}\}_{k \geq 0}$ définie par

$$\begin{cases} x^{(0)} \text{ donné} \\ \forall k \geq 0 \quad x^{(k+1)} = g(x^{(k)}). \end{cases}$$

converge vers \hat{x} .

Démonstration - On a

$$\|x^{(k+1)} - x^{(k)}\| \leq \lambda \|x^{(k)} - x^{(k-1)}\| \leq \dots \leq \lambda^k \|x^{(1)} - x^{(0)}\|.$$

On a d'autre part

$$x^{(k+p)} - x^{(k)} = x^{(k+p)} - x^{(k+p-1)} + x^{(k+p-1)} - x^{(k+p-2)} + \dots + x^{(k+2)} - x^{(k+1)} + x^{(k+1)} - x^{(k)}.$$

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents



On peut donc écrire que

$$\begin{aligned} \|x^{(k+p)} - x^{(k)}\| &\leq \|x^{(k+p)} - x^{(k+p-1)}\| + \dots + \|x^{(k+2)} - x^{(k+1)}\| + \|x^{(k+1)} - x^{(k)}\|, \\ &\leq (\lambda^{k+p-1} + \dots + \lambda^{k+1} + \lambda^k) \|x^{(1)} - x^{(0)}\|, \\ &\leq \lambda^k (1 + \lambda + \dots + \lambda^{p-1}) \|x^{(1)} - x^{(0)}\| = \lambda^k \frac{1 - \lambda^p}{1 - \lambda} \|x^{(1)} - x^{(0)}\|, \\ &\leq \frac{\lambda^k}{1 - \lambda} \|x^{(1)} - x^{(0)}\|. \end{aligned}$$

La quantité $\|x^{(k+p)} - x^{(k)}\|$ tend donc vers zéro quand k tend vers l'infini ; ainsi la suite est une suite de Cauchy, de sorte qu'elle est convergente. On note \hat{x} la limite de cette suite. On a

$$\|g(x^{(k)}) - g(\hat{x})\| \leq \|x^{(k)} - \hat{x}\|,$$

donc la limite de $g(x^{(k)})$ est $g(\hat{x})$. On a bien $g(\hat{x}) = \hat{x}$ car

$$\hat{x} = \lim_{k \rightarrow \infty} x^{(k+1)} = \lim_{k \rightarrow \infty} g(x^{(k)}) = g(\hat{x}).$$

La suite ainsi construite converge donc vers une solution de $g(x) = x$. Montrons que cette équation admet une solution unique : on suppose qu'il existe 2 solutions u et v , on a donc $u = g(u)$, $v = g(v)$, donc $g(u) - g(v) = u - v$. Or $\|g(u) - g(v)\| \leq \lambda \|u - v\|$, on a donc

$$\|u - v\| \leq \lambda \|u - v\|, \quad \text{soit} \quad \|u - v\|(1 - \lambda) \leq 0$$

avec $\lambda < 1$. Ceci n'est possible que si $\|u - v\| = 0$ donc $u = v$. Ceci termine la démonstration du théorème .

Le théorème suivant dont la démonstration est délicate relie la convergence de la méthode de point fixe au rayon spectral de la matrice jacobienne :

Document

A.1.1

Les théorèmes de point fixe pour les systèmes non-linéaires

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Théorème A.1.3. Soit g une application de \mathbb{R}^n dans \mathbb{R}^n qui admet un point fixe \hat{x} , on suppose que g est différentiable en \hat{x} et que $\rho[Dg(\hat{x})]$, le rayon spectral de la matrice jacobienne de g , vérifie $\rho[Dg(\hat{x})] < 1$. Alors il existe η tel que si x^0 vérifie $\|x^{(0)} - \hat{x}\| < \eta$, la suite définie par

$$x^{(k+1)} = g(x^{(k)})$$

converge vers \hat{x} .

Démonstration - Grâce à des résultats sur les normes matricielles, on peut montrer que, si l'on note

$$\hat{\varepsilon} = \frac{1 - \rho[Dg(\hat{x})]}{3} > 0,$$

il est possible de trouver une norme matricielle subordonnée telle que

$$0 \leq \| \|Dg(\hat{x})\| \| \leq \rho[Dg(\hat{x})] + \hat{\varepsilon},$$

on utilisera donc dans la suite cette norme matricielle et la norme vectorielle correspondante.

En utilisant la définition de la différentiabilité, on obtient donc :

$$\begin{aligned} \|g(x) - g(\hat{x})\| &= \|Dg(\hat{x})(x - \hat{x}) + \varepsilon(x - \hat{x})\| \leq \|Dg(\hat{x})(x - \hat{x})\| + \|x - \hat{x}\| \|\varepsilon(x - \hat{x})\| \\ &\leq \| \|Dg(\hat{x})\| \| \|x - \hat{x}\| + \|x - \hat{x}\| \|\varepsilon(x - \hat{x})\| = \|x - \hat{x}\| (\| \|Dg(\hat{x})\| \| + \|\varepsilon(x - \hat{x})\|). \end{aligned}$$

Or $\|\varepsilon(x - \hat{x})\|$ tend vers 0 quand x tend vers \hat{x} , il existe donc η tel que

$$\|x - \hat{x}\| < \eta \implies \|\varepsilon(x - \hat{x})\| \leq \hat{\varepsilon}.$$

On obtient alors :

$$(\| \|Dg(\hat{x})\| \| + \|\varepsilon(x - \hat{x})\|) \leq \rho[Dg(\hat{x})] + \hat{\varepsilon} + \hat{\varepsilon} = \lambda.$$

Document

A.1.1

Les théorèmes de point fixe pour les systèmes non-linéaires

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents

Or $\lambda = \rho[Dg(\hat{x})] + 2\hat{\varepsilon} = 1 - \hat{\varepsilon} < 1$, on a donc démontré que :

$$\|x - \hat{x}\| < \eta \implies \|g(x) - g(\hat{x})\| \leq \lambda \|x - \hat{x}\|,$$

avec $\lambda < 1$. La suite de la démonstration est analogue à ce qui se passe pour $n = 1$.

[retour au cours](#)

Document

A.1.1

Les théorèmes
de point fixe
pour les
systèmes
non-linéaires

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Annexe B

Exercices

B.1	Exercices du chapitre 4	50
B.2	Exercices de TD du chapitre 4	66

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents

B.1 Exercices du chapitre 4

B.1.1	51
B.1.2	52
B.1.3	53
B.1.4	54
B.1.5	55
B.1.6	56
B.1.7	57
B.1.8	58
B.1.9	59
B.1.10	60
B.1.11	61
B.1.12	62
B.1.13	63
B.1.14	64
B.1.15	65

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents

Exercice B.1.1

On rappelle que la définition du déterminant à partir des permutations est la suivante

$$\det A = \sum_{\sigma} a_{\sigma(1)1} a_{\sigma(2)2} \dots a_{\sigma(n)n}$$

où la somme est faite sur toutes les permutations de l'ensemble $\{1, 2, \dots, n\}$. En utilisant cette définition, montrer que si une matrice est inversible, il existe une permutation de ses lignes telle que tous les éléments de la diagonale de la matrice ainsi obtenue soient non nuls.

[retour au cours](#)

[Solution](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.1.2

Donner les matrices D , E et F correspondant à la décomposition $A = D - E - F$ de la méthode de Jacobi dans le cas

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 3 & 0 \\ 6 & 7 & -1 \\ 3 & 4 & 9 \end{pmatrix}.$$

[retour au cours](#)

[Solution](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.1.3

Quelle est, pour la méthode de Gauss-Seidel, la forme de la matrice du système permettant de calculer $x^{(k+1)}$ à partir de $x^{(k)}$. Que pensez-vous de la résolution de ce système?

[retour au cours](#)

[Solution](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.1.4

Soit la décomposition $A = M - N$ avec M inversible et la méthode itérative

$$\begin{cases} x^{(0)} \text{ donné,} \\ Mx^{(k+1)} = Nx^{(k)} + b. \end{cases}$$

Donner une condition suffisante sur les matrices M et N pour que la suite $x^{(k)}$ converge vers la solution de $Ax = b$.

[retour au cours](#)

Solution

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.1.5

Montrer que pour la dichotomie, le nombre d'itérations nécessaires pour obtenir une précision inférieure à ϵ est supérieur ou égal à $\log_2 \frac{b-a}{\epsilon}$.

[retour au cours](#)

[Solution](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.1.6

Pour calculer la racine carrée d'un nombre réel $a > 0$, on résout $x^2 = a$. Il existe alors différentes manières de se ramener à une méthode de point fixe :

—

$$x = \frac{a}{x} \text{ donc } g_1(x) = \frac{a}{x},$$

—

$$2x = x + \frac{a}{x}, \text{ soit } x = 2x - \frac{a}{x} \text{ donc } g_2(x) = 2x - \frac{a}{x},$$

—

$$x = \frac{x}{2} + \frac{a}{2x} \text{ donc } g_3(x) = \frac{x}{2} + \frac{a}{2x}.$$

Tracer les fonctions $g_i(x)$ et la bissectrice pour $x > 0$. Prendre x_0 quelconque et construire graphiquement la suite $x_{k+1} = g_i(x_k)$ pour $k > 0$. Conclusion ?

[retour au cours](#)

[Solution](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.1.7

Soit $g : [a, b] \rightarrow [a, b]$, continument dérivable, telle que $|g'(x)| \leq k < 1, \forall x \in [a, b]$. On suppose que g admet deux points fixes dans $[a, b]$. Montrer, en utilisant le théorème des accroissements finis, que l'on arrive à une contradiction.

[retour au cours](#)

[Solution](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.1.8

Pour calculer la racine x^* de $x^2 - 3x - 1 = 0$ sur $[-1, +1]$, on pose $g(x) = \frac{x^2 - 1}{3}$ pour appliquer une méthode de point fixe $x = g(x)$. Montrer que la suite $x_{n+1} = g(x_n)$, avec $x_0 \in [-1, +1]$, converge vers un unique point fixe $x^* \in [-1, 1]$.

[retour au cours](#)

[Solution](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.1.9

Soit une suite (x_n) convergeant vers x^* . On suppose que

$$\exists k < 1, |x_{i+1} - x_i| \leq k|x_i - x_{i-1}| \forall i \in \mathbf{N}$$

1. Montrer que

$$|x_{n+1} - x_n| \leq k^n |x_1 - x_0|.$$

2. En déduire que, pour $p > n$,

$$|x_p - x_n| \leq (k^{p-1} + \dots + k^n) |x_1 - x_0|.$$

3. Après avoir calculé la somme du membre de droite, faites tendre p vers l'infini pour obtenir

$$|x^* - x_n| \leq \frac{k^n}{1 - k} |x_1 - x_0|.$$

[retour au cours](#)

[Solution](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.1.10

On reprend la fonction $g(x) = \frac{x^2-1}{3}$ dont l'unique point fixe x^* de $[-1,1]$ est racine du trinôme $x^2 - 3x - 1 = 0$. Soit $x_0 = 0$, calculer le nombre d'itérations de point fixe n nécessaires pour obtenir une précision inférieure à $\epsilon = 10^{-3}$ pour le calcul de x^* . Vérifier votre résultat en calculant les n premiers itérés de la méthode de point fixe.

[retour au cours](#)

[Solution](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.1.11

Soit la courbe $y = f(x)$. Écrire l'équation de la tangente à cette courbe au point d'abscisse $x = x_n$. Donner alors l'abscisse du point d'intersection de cette tangente avec l'axe Ox . Montrer que l'on retrouve ainsi l'itéré de la méthode de Newton. Pour illustrer graphiquement et numériquement cette méthode, tracer et calculer deux itérations avec $f(x) = x^2 - 4$ et $x_0 = 4$.

[retour au cours](#)

[Solution](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.1.12

Soit la fonction $f(x) = \cos x - x$. Montrer qu'elle admet une racine sur $[0, \pi/2]$. Calculer trois itérations de la méthode de Newton en partant de $x_0 = \pi/4$ puis avec $x_0 = 0$.

[retour au cours](#)

Solution

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.1.13

Écrire l'équation de la droite passant par les points $(x_n, f(x_n))$ et $(x_{n-1}, f(x_{n-1}))$. Donner l'abscisse x_{n+1} de l'intersection de cette droite avec l'axe Ox . Montrer que l'on retrouve l'équation de la sécante.

[retour au cours](#)

[Solution](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.1.14

Tracer une courbe convexe qui coupe l'axe Ox en un point x^* . Considérer deux points x_0 et x_1 qui entourent ce point. Effectuer alors graphiquement quelques itérations de la méthode de la sécante (modifiée) de telle sorte que la sécante passe toujours par deux points qui entourent x^* . Remarquez alors que soit x_0 , soit x_1 est pris en compte dans toutes les itérations.

[retour au cours](#)

[Solution](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.1.15

On considère les deux équations non-linéaires

$$x_1^2 + (x_2 - 1)^2 = 4, \quad x_1^2 - x_2 + 1 = 0.$$

Écrire une étape de la méthode de Newton. Prenez un vecteur $x^{(0)}$ et calculez le vecteur $x^{(1)}$.

[retour au cours](#)

Solution

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

B.2 Exercices de TD du chapitre 4

B.2.1	TD4-Exercice1 : méthode de la relaxation	67
B.2.2	TD4-Exercice2 : convergence de Jacobi et GS	68
B.2.3	TD4-Exercice3 : GS et matrice à diag. strict. dominante	69
B.2.4	TD4-Exercice4 : méthode de Richardson et complément de Schur	70
B.2.5	TD4-Exercice5 : Point fixe	71
B.2.6	TD4-Exercice6 : Newton pour racines <i>p</i> èmes	72
B.2.7	TD4-Exercice7 : Newton pour racines cubiques de l'unité	73
B.2.8	TD4-Exercice8 : Newton pour intersection de courbes	74
B.2.9	TD4-Exercice9 : Newton pour Laplacien non-linéaire	75
B.2.10	TD4-Exercice10 : Algorithme de Bairstow	77

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.2.1 TD4-Exercice1 : méthode de la relaxation

On veut résoudre $Ax = b$.

Les méthodes de Jacobi et Gauss-Seidel peuvent être généralisées en introduisant un paramètre réel strictement positif ω . Connaissant le vecteur $x^{(k)}$, on détermine les composantes du vecteur $x^{(k+1)}$, de la façon suivante, pour chaque i :

- on calcule $\hat{x}_i^{(k+1)}$ à partir de l'une des deux méthodes, Jacobi ou Gauss-Seidel,
- on définit

$$x_i^{(k+1)} = \omega \hat{x}_i^{(k+1)} + (1 - \omega)x_i^{(k)}.$$

On applique la méthode de relaxation à la méthode de Gauss Seidel.

1. Donner la relation matricielle liant $x^{(k+1)}$ et $x^{(k)}$. À chaque itération, quel est le système à résoudre? Si on utilise les notations du cours que vaut M ? Que vaut N ?
2. Écrire l'algorithme de la méthode de relaxation appliquée à la méthode de Gauss-Seidel.

Question 1 [Aide 1](#)

Question 2 [Aide 1](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.2.2 TD4-Exercice2 : convergence de Jacobi et GS

Le but de cet exercice est de montrer (sur des exemples) qu'on ne peut rien conclure de façon générale sur la comparaison des deux méthodes itératives de Jacobi et Gauss-Seidel. On veut résoudre $Ax = b$. La méthode de Jacobi peut s'écrire $x^{(k+1)} = Jx^{(k)} + d$, la méthode de Gauss-Seidel peut s'écrire $x^{(k+1)} = Rx^{(k)} + e$

1. Soit $A = \begin{pmatrix} 1 & -2 & 2 \\ -1 & 1 & -1 \\ -2 & -2 & 1 \end{pmatrix}$, montrer que $\rho(J) < 1 < \rho(R)$.

Indication : $p_J(\lambda) = \lambda^3$, $p_R(\lambda) = \lambda^3 + 4\lambda^2 - 4\lambda$.

2. Soit $A = \begin{pmatrix} 1 & -1 & -2 \\ -2 & 1 & 3 \\ 0 & 2 & 1 \end{pmatrix}$, montrer que $\rho(R) < 1 < \rho(J)$.

Indication : $p_J(\lambda) = \lambda^3 - 8\lambda + 8$, $p_R(\lambda) = \lambda^3$.

Question 1 [Aide 1](#)

Question 2 [Aide 1](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.2.3 TD4-Exercice3 : GS et matrice à diag. strict. dominante

1. Soit A une matrice carrée, montrer que quel que soit la norme matricielle subordonnée on a toujours $\rho(A) \leq \|A\|$.
2. On pose $A = D - E - F$ (voir les notations du cours), on suppose que D est inversible. Montrer que

$$\lambda \neq 0 \text{ est valeur propre de } (D - E)^{-1}F \Leftrightarrow 1 \text{ est valeur propre de } D^{-1} \left(\frac{F}{\lambda} + E \right).$$

3. Utiliser les deux questions précédentes pour montrer que :

$$1 \leq \max_i \left(\frac{1}{|a_{ii}|} \left(\sum_{j=1}^{i-1} |a_{ij}| + \sum_{j=i+1}^n \frac{|a_{ij}|}{|\lambda|} \right) \right).$$

4. Montrer que si A est à diagonale strictement dominante la méthode de Gauss Seidel converge.

Question 1 [Aide 1](#) [Aide 2](#) [Aide 3](#)

Question 2 [Aide 1](#)

Question 3 [Aide 1](#)

Question 4 [Aide 1](#) [Aide 2](#) [Aide 3](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.2.4 TD4-Exercice4 : méthode de Richardson et complément de Schur

Soit $A \in \mathcal{M}_{n,n}(\mathbb{R})$ une matrice symétrique définie positive. On désire résoudre itérativement le système $AX = F$, avec X et $F \in \mathbb{R}^n$.

1. Soit $P \in \mathcal{M}_{n,n}(\mathbb{R})$ une matrice inversible. On considère la méthode itérative suivante :

$$\begin{cases} X^0 \text{ donné dans } \mathbb{R}^n, \\ P(X^{k+1} - X^k) = F - AX^k, \quad \forall k = 0, 1, \dots \end{cases} \quad (\text{B.2.1})$$

- (a) Vérifier que si la méthode itérative (B.2.1) converge vers un $X^* \in \mathbb{R}^n$, alors ce X^* est solution du système $AX = F$.
- (b) Mettre (B.2.1) sous la forme $X^{k+1} = CX^k + G$. Que valent C et G ?
2. Soit $A_i \in \mathcal{M}_{n_i, n_i}(\mathbb{R})$, avec $n_i \geq 1$, pour $i = 1, 2$, et $n_1 + n_2 = n$. On suppose que A prend la forme par blocs $A = \begin{bmatrix} A_1 & B \\ B^T & A_2 \end{bmatrix}$. On écrit X et F par blocs : $X = \begin{bmatrix} X_1 \\ X_2 \end{bmatrix}$ et

$$F = \begin{bmatrix} F_1 \\ F_2 \end{bmatrix}, \text{ avec } X_i \text{ et } F_i \text{ dans } \mathbb{R}^{n_i} \text{ pour } i = 1, 2.$$

On prend $P = L = \begin{bmatrix} I_{n_1} & 0 \\ B^T A_1^{-1} & I_{n_2} \end{bmatrix}$ (voir l'exercice 14 du TD 2).

- (a) Calculer l'inverse de L , puis déterminer C et G .
- (b) On pose $(X^k)^T = [(X_1^k)^T \ (X_2^k)^T]$. Écrire les équations vérifiées par X_i^{k+1} en fonction de X_i^k , pour $i = 1, 2$.
- (c) En déduire que le calcul de X_2^k ne fait pas intervenir X_1^k .
- (d) Si on a obtenu X_2^* , comment obtenir sans calcul itératif X_1^* ?

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents

Exercice B.2.5 TD4-Exercice5 : Point fixe

On veut résoudre $x^2 - 3x - 1 = 0$ sur $[-1, 1]$.

On utilise la méthode de point fixe

$$x_0 \in [-1, 1], x_{n+1} = \frac{x_n^2 - 1}{3}.$$

1. Montrer $\forall n \in \mathbb{N}, x_n \in [-1, 1]$.
2. Montrer que la suite x_n converge.
3. Faire une interprétation géométrique.

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.2.6 TD4-Exercice6 : Newton pour racines p èmes

Étant donné $a > 0$ et $p \in \mathbb{N}$, $p > 1$, on cherche à déterminer $x^* \in \mathbb{R}$ solution de :

$$x^p = a. \quad (\text{B.2.2})$$

1. On prend dans un premier temps $p = 2$. Détailler l'application de la méthode de Newton à la résolution de (B.2.2) et montrer graphiquement que cette méthode converge.
2. On prend p quelconque et on se propose d'utiliser une méthode de point fixe en écrivant (B.2.2) sous la forme $x = g(x)$, avec $g(x) = ax^{1-p}$. Montrer que l'algorithme $x^{(k+1)} = g(x^{(k)})$ peut ne pas converger dès que $p \geq 2$.
3. On utilise la méthode de Newton pour résoudre (B.2.2). Montrer que cette méthode peut s'écrire $x_{n+1} = h(x_n)$. Que vaut $h'(x^*)$? Utiliser quelques itérations de cette méthode pour calculer une valeur approchée de $\sqrt{3}$ (on prendra $x^{(0)} = 1,5$).

Question 1 [Aide 1](#)
Question 2 [Aide 1](#)
Question 3 [Aide 1](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.2.7 TD4-Exercice7 : Newton pour racines cubiques de l'unité

On désire approcher dans \mathbb{C} les racines cubiques de l'unité, c'est-à-dire trouver $z = x_1 + ix_2$ tel que

$$z^3 = 1.$$

1. Mettre l'équation sous la forme $f(x) = 0$, où $x \in \mathbb{R}^2$ et $f : \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}^2$.
2. On résout par l'algorithme de Newton. Calculer le premier itéré de Newton : $x^{(1)}$ pour $x^{(0)} = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$, puis $y^{(1)}$ pour $y^{(0)} = \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \end{pmatrix}$, puis $z^{(1)}$ pour $z^{(0)} = \begin{pmatrix} 0 \\ -1 \end{pmatrix}$.

[Solution](#)

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.2.8 TD4-Exercice8 : Newton pour intersection de courbes

On désire déterminer toutes les solutions du système

$$\begin{cases} x_1^2 - x_2 & = 0 \\ (x_1 - 1)^2 + (x_2 - 6)^2 & = 25 \end{cases}$$

1. Déterminer graphiquement une approximation des solutions de ce système.
2. Améliorer ces approximations à l'aide d'une itération de la méthode de Newton.

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.2.9 TD4-Exercice9 : Newton pour Laplacien non-linéaire

1. Soit u est une fonction 3 fois continûment dérivable, utiliser la formule de Taylor pour montrer que :

$$u''(x) = \frac{u(x+h) - 2u(x) + u(x-h)}{h^2} + h\epsilon(h), \text{ avec } \lim_{h \rightarrow 0} \epsilon(h) = 0. \quad (\text{B.2.3})$$

2. On considère le problème aux limites suivant

$$\begin{cases} -u''(x) + g(u(x)) &= f(x), \text{ pour } x \in]0, 1[\\ u(0) &= \alpha \\ u(1) &= \beta \end{cases} \quad (\text{B.2.4})$$

où α et β sont des constantes données et g et f sont des fonctions connues.

On effectue un maillage de $[0, 1]$, en définissant les points $x_k = k/n$ pour $k = 0 \dots n$ et on note v_k une approximation de $u(x_k)$. Pour approcher $u''(x_k)$ on utilise la formule (B.2.3) avec $h = \frac{1}{n}$.

- (a) En écrivant (B.2.4) en chaque point x_k et en utilisant (B.2.3) pour approcher $u''(x)$, montrer que ce problème peut se mettre sous la forme $F(v) = 0$ où $v = (v_1, \dots, v_{n-1})$.
- (b) Décrire l'algorithme de Newton pour résoudre ce problème. Quelle est la matrice du système à résoudre à chaque itération ?
- (c) On doit résoudre ces équations, par exemple, dans le cas d'une réaction enzymatique avec diffusion, u représente la concentration du substrat, on a $g(u) = \frac{\sigma u}{1+u}$ (avec $\sigma > 0$).

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents

Montrer que la matrice du système à résoudre à chaque itération est à diagonale strictement dominante. Quelles méthodes proposez-vous pour résoudre le système linéaire ?

Exercice B.2.9

TD4-

Exercice10 :
Newton pour
Laplacien
non-linéaire

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Exercice B.2.10 TD4-Exercice10 : Algorithme de Bairstow

Soit un polynôme $P(x) = a_0x^n + a_1x^{n-1} + \dots + a_n$, les coefficients réels a_0, a_1, \dots, a_n sont connus, on cherche à déterminer des racines de P . Pour cela étant donnés p et q on calcule r et s coefficients du reste de la division de P par le polynôme $(x^2 + px + q)$, c'est-à-dire qu'on écrit

$$P(x) = (x^2 + px + q)(b_0x^{n-2} + \dots + b_{n-2}) + rx + s$$

et on cherche à déterminer p et q pour que r et s soient nuls. Il suffira alors de calculer les deux racines de $(x^2 + px + q)$ pour obtenir deux racine de P .

1. On pose :

$$b_{n-1} = r, \quad b_n = s - pb_{n-1},$$

montrer que

$$\begin{cases} b_0 &= a_0, \\ b_1 &= a_1 - pb_0 \\ b_i &= a_i - pb_{i-1} - qb_{i-2}, \quad i = 2, \dots, n \end{cases}$$

2. On pose :

$$c_i = -\frac{\partial b_{i+1}}{\partial p}, \quad i = 0, \dots, n-2, \quad c_{n-1} = -\frac{\partial b_n}{\partial p} - b_{n-1}$$

montrer que

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents



$$\begin{cases} c_0 &= b_0, \\ c_1 &= b_1 - pc_0 \\ c_i &= b_i - pc_{i-1} - qc_{i-2}, \quad i = 2, \dots, n-2 \\ c_{n-1} &= -pc_{n-2} - qc_{n-3}. \end{cases}$$

3. On pose :

$$d_{i-1} = -\frac{\partial b_{i+1}}{\partial q}, \quad i = 1, \dots, n-1,$$

montrer que

$$\begin{cases} d_0 &= b_0, \\ d_1 &= b_1 - pd_0 \\ d_i &= b_i - pd_{i-1} - qd_{i-2}, \quad i = 2, \dots, n-2. \end{cases}$$

En déduire que

$$d_i = c_i, \quad i = 0, \dots, n-2$$

et que :

$$\begin{cases} \frac{\partial r}{\partial p} = -c_{n-2} & , & \frac{\partial r}{\partial q} = -c_{n-3}, \\ \frac{\partial s}{\partial p} = -c_{n-1} - pc_{n-2} & , & \frac{\partial s}{\partial q} = -c_{n-2} - pc_{n-3}. \end{cases}$$

4. On utilise la méthode de Newton pour calculer p et q tels que :

$$\begin{cases} r(p, q) &= 0, \\ s(p, q) &= 0. \end{cases}$$

Exercice
B.2.10
TD4-
Exercice10 :
Algorithme de
Bairstow

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Rassemblez les résultats des questions précédentes pour construire un algorithme de recherche des racines du polynôme P .

Exercice
B.2.10
TD4-
Exercice10 :
Algorithme de
Bairstow

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)

Index des concepts

Le gras indique un grain où le concept est défini; l'italique indique un renvoi à un exercice ou un exemple, le gras italique à un document, et le romain à un grain où le concept est mentionné.

C
Convergence des méthodes itératives .. **11**

D
Dichotomie **15**

G
Gauss-Seidel..... **9**

J
Jacobi..... **6, 9**

N

Newton
Convergence **28, 30, 39, 41**
Equation non-linéaire **25**

Newton
Système 2 équations non-linéaires **39, 41**
Système non linéaire **39, 41**

P

Point fixe
Convergence **19, 36**
Principe **17, 19, 36**

Point fixe
Système non linéaire **36**

[Sommaire](#)
[Concepts](#)

[Exemples](#)
[Exercices](#)
[Documents](#)



S

Sécante **30**

T

Taylor
différentielle dim 2 **34, 39**

Sommaire
Concepts

Exemples
Exercices
Documents

Solution de l'exercice B.1.1

La définition du déterminant à partir des permutations donne

$$\det A = \sum_{\sigma} a_{\sigma(1)1} a_{\sigma(2)2} \dots a_{\sigma(n)n}$$

où la somme porte sur toutes les permutations de l'ensemble $\{1, 2, \dots, n\}$. Or si la matrice est inversible, son déterminant est non nul et il existe donc au moins un élément de cette somme qui est non nul, cet élément correspond à une permutation $\hat{\sigma}$. On a donc

$$a_{\hat{\sigma}(1)1} a_{\hat{\sigma}(2)2} \dots a_{\hat{\sigma}(n)n} \neq 0,$$

donc $\forall i = 1, \dots, n$ $a_{\hat{\sigma}(i)i} \neq 0$. Si on permute les lignes de A et que l'on note \hat{A} la matrice définie par $\hat{A} = \begin{pmatrix} \underline{A}_{\hat{\sigma}(1)} \\ \underline{A}_{\hat{\sigma}(2)} \\ \vdots \\ \underline{A}_{\hat{\sigma}(n)} \end{pmatrix}$,

les termes diagonaux de \hat{A} qui sont $a_{\hat{\sigma}(1)1}, a_{\hat{\sigma}(2)2}, \dots, a_{\hat{\sigma}(n)n}$ sont tous non nuls.

Il suffit alors de permuter les lignes de la matrice A suivant la permutation $\hat{\sigma}$ pour obtenir le résultat attendu.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Solution de l'exercice B.1.2

$$D = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 7 & 0 \\ 0 & 0 & 9 \end{pmatrix}.$$

$$E = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ -6 & 0 & 0 \\ -3 & -4 & 0 \end{pmatrix}.$$

$$F = \begin{pmatrix} 0 & -3 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}.$$

[Retour à l'exercice ▲](#)

Solution de l'exercice B.1.3

La matrice $D-E$ est triangulaire inférieure. Le nombre de multiplications/divisions est de l'ordre de n^2 pour la résolution d'un système triangulaire, ce qui est beaucoup moins important que les n^3 de la méthode LU. Par contre, la diagonale de A ne doit pas comporter d'éléments nuls.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Solution de l'exercice B.1.4

On a donc $x^{(k+1)} = M^{-1}Nx^{(k)} + M^{-1}b$, donc en reprenant les notations du paragraphe [Convergence des méthodes itératives](#), on a $C = M^{-1}N$ et $d = M^{-1}b$. On utilise la proposition [4.1.1](#). Si $\|M^{-1}N\| < 1$, alors la suite $x^{(k)}$ converge vers la solution unique de

$$(I - M^{-1}N)x = d \Leftrightarrow x - M^{-1}Nx = M^{-1}b \Leftrightarrow (M - N)x = b \Leftrightarrow Ax = b.$$

On remarque au passage que si M inversible, si $\|M^{-1}N\| < 1$, alors la matrice $A = M - N$ est inversible, en effet il suffit de reprendre la proposition [4.1.1](#), $A = M(I - M^{-1}N)$ est un produit de matrices inversibles.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Solution de l'exercice B.1.5

La méthode de la dichotomie est basée sur le fait que la solution x^* de $f(x) = 0$ recherchée appartient à une suite de segments emboîtés $[a_k, b_k]$ pour $k \in \mathbb{N}$. Or la longueur de ces segments est donnée par

$$l_k = \frac{b-a}{2^k}.$$

Ceci implique que

$$x^* - a_k \leq l_k.$$

Pour que a_n soit une approximation de x^* avec un précision inférieure à ε , il suffit que

$$l_n \leq \varepsilon$$

soit

$$\frac{b-a}{2^n} \leq \varepsilon \Rightarrow n \leq \log_2 \frac{b-a}{\varepsilon}$$

[Retour à l'exercice ▲](#)

Solution de l'exercice B.1.6

Vous pouvez vous aider de SCILAB pour tracer graphiquement la courbe $g(x)$, la bissectrice $y = x$ et les points $(x_k, g(x_k))$.

Pour les figures, on prend $a = 4$.

— Voir sur la Figure B.2.1 un exemple de ce que vous pourriez obtenir pour g_1 .

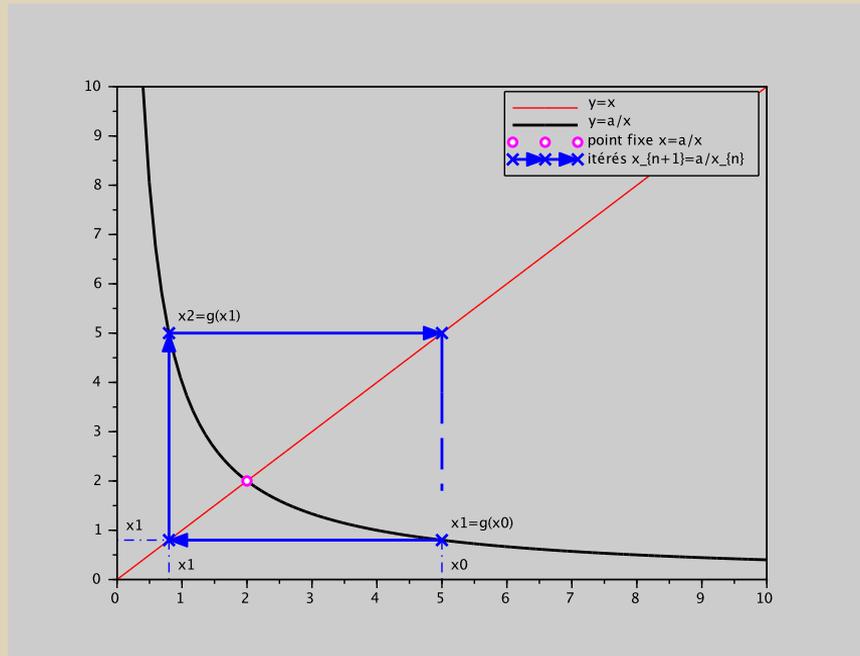


FIGURE B.2.1 – Point fixe pour $g_1(x) = \frac{a}{x}$, $x_0 = 5$, $a = 4$.

Il est facile de calculer dans le cas de g_1 la suite des itérés. En effet

$$x_0 \text{ donné}, x_1 = \frac{a}{x_0}, x_{2n} = x_0, x_{2n+1} = x_1, n = 1, 2, \dots$$

La suite prend successivement les valeurs x_0 et x_1 et ne converge donc pas (sauf si par hasard $x_0 = \sqrt{a}$!).

— Voir sur la Figure B.2.2 un exemple de ce que vous pourriez obtenir pour g_2 .

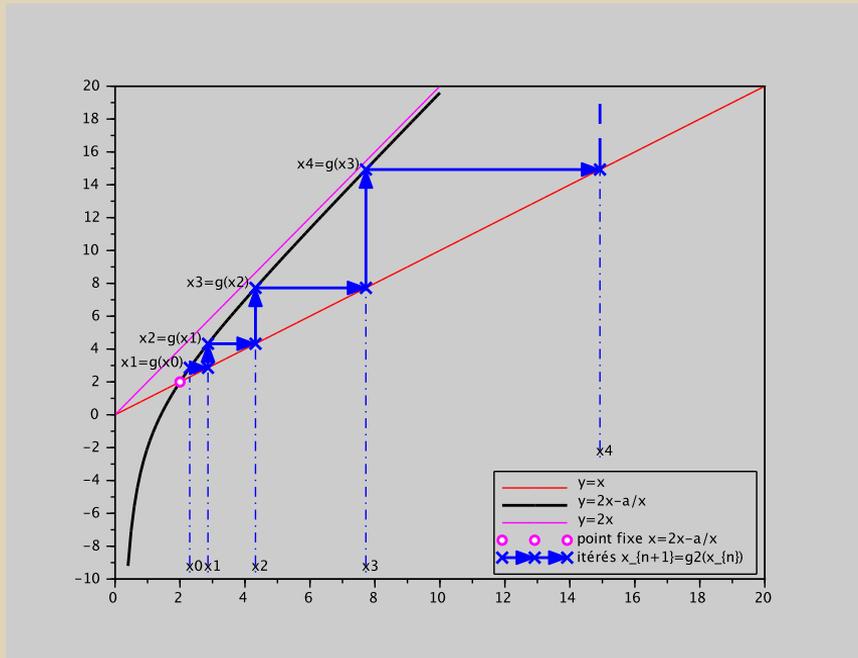


FIGURE B.2.2 – Point fixe pour $g_2(x) = 2x - \frac{a}{x}$, $x_0 = 2.3$, $a = 4$. L'asymptote $y = 2x$ est également tracée.

Le tracé que vous avez effectué pour g_2 vous montre que la suite $(x_k)_{k \in \mathbb{N}}$ diverge.

— Voir sur la Figure B.2.3 un exemple de ce que vous pourriez obtenir pour g_3 .

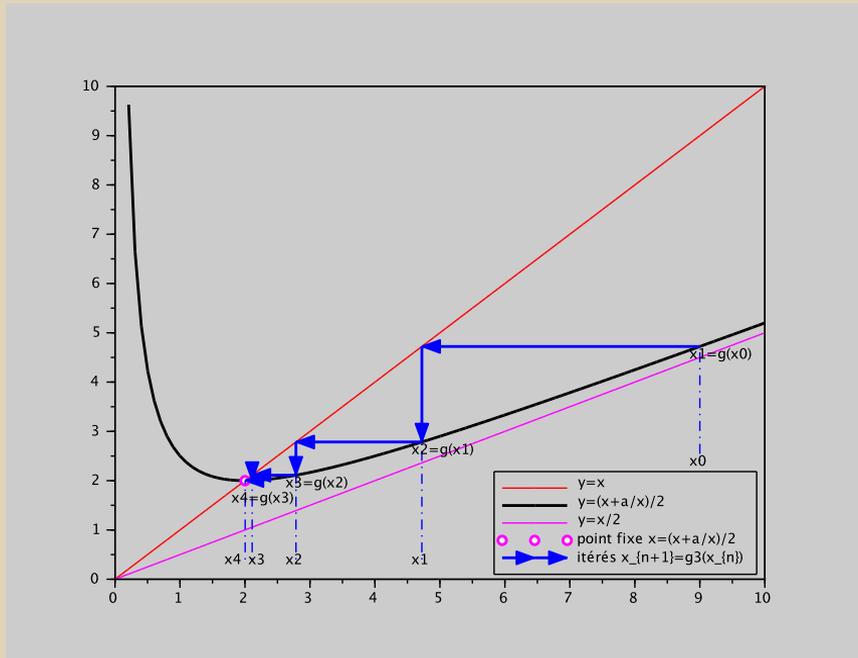


FIGURE B.2.3 – Point fixe pour $g_3(x) = \frac{x}{2} - \frac{a}{2x}$, $x_0 = 9$, $a = 4$. L'asymptote $y = \frac{x}{2}$ est également tracée.

Le tracé que vous avez effectué pour g_3 vous montre que la suite $(x_k)_{k \in \mathbb{N}}$ se rapproche de la solution. Après avoir étudié les théorèmes sur la convergence d'une telle suite, vous pourrez démontrer qu'elle converge.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Solution de l'exercice B.1.7

Le raisonnement se fait par l'absurde en supposant qu'il existe deux points fixes distincts x^* et \hat{x} distincts dans $[a, b]$. Alors, le théorème des accroissements finis donne

$$g(x^*) - g(\hat{x}) = (x^* - \hat{x})g'(\xi),$$

où ξ est compris entre x^* et \hat{x} et donc appartient à $[a, b]$. Alors

$$|x^* - \hat{x}| = |g(x^*) - g(\hat{x})| = |x^* - \hat{x}| |g'(\xi)| \leq k|x^* - \hat{x}| < |x^* - \hat{x}|$$

ce qui est absurde!

[Retour à l'exercice ▲](#)

Solution de l'exercice B.1.8

Pour appliquer la proposition , il suffit de démontrer que l'application g va de $[-1,1]$ dans lui-même et que sa dérivée est bornée par une constante strictement inférieure à 1 sur cet intervalle. Faites un tableau de variation de la fonction g sur $[-1,1]$ et vous démontrerez la première partie sans problème. Quant à la dérivée $g'(x) = \frac{2}{3}x \dots$

[Retour à l'exercice ▲](#)

Solution de l'exercice B.1.9

1. L'inégalité de démontre facilement en utilisant l'inégalité de l'hypothèse pour $i = n, n-1, \dots, 0$.
2. On écrit

$$x_p - x_n = x_p - x_{p-1} + x_{p-1} - \dots - x_{n+1} + x_{n+1} - x_n$$

on prend les valeurs absolues, on utilise l'inégalité triangulaire, puis la majoration précédente.

3. On a

$$k^{p-1} + \dots + k^{n+1} + k^n = k^n(k^{p-1-n} + \dots + k + 1) = k^n \frac{1 - k^{p-n}}{1 - k}$$

ce qui donne

$$|x_p - x_n| \leq k^n \frac{1 - k^{p-n}}{1 - k} |x_1 - x_0|.$$

On passe alors à la limite quand p tend vers $+\infty$ sur les deux membres de l'inégalité (le passage à la limite conserve l'inégalité). Alors, puisque $k < 1$

$$\lim_{p \rightarrow +\infty} k^{p-n} = 0$$

et, par hypothèse, $\lim_{p \rightarrow +\infty} x_p = x^*$, ce qui donne le résultat.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Solution de l'exercice B.1.10

On utilise les résultats des exercices [B.1.8](#) et [B.1.9](#), ce qui donne

$$|x^* - x_n| \leq k^n \frac{1}{1-k} |x_1 - x_0|, \text{ avec } k = \frac{2}{3}.$$

On obtient donc

$$x_1 = -\frac{1}{3}, k^n \frac{1}{1-k} |x_1 - x_0| = \left(\frac{2}{3}\right)^n, |x^* - x_n| \leq \left(\frac{2}{3}\right)^n.$$

Il suffit donc d'avoir

$$\left(\frac{2}{3}\right)^n \leq \epsilon \Leftrightarrow n \ln\left(\frac{2}{3}\right) \leq \ln \epsilon \Leftrightarrow n \geq 18.$$

[Retour à l'exercice ▲](#)

Solution de l'exercice B.1.11

L'équation de la droite tangente est évidemment

$$y = f'(x_n)(x - x_n) + f(x_n).$$

L'abscisse x_{n+1} de l'intersection de la droite tangente avec l'axe Ox est donné par

$$0 = f'(x_n)(x_{n+1} - x_n) + f(x_n),$$

ce qui permet de retrouver la formule de Newton :

$$x_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)}{f'(x_n)}.$$

En partant de $x_0 = 4$, le calcul de x_1 et x_2 donne

$$x_1 = 4 - \frac{12}{8} = \frac{5}{2} = 2.5, \quad x_2 = \frac{5}{2} - \frac{\frac{9}{4}}{5} = \frac{41}{20} = 2.05.$$

En poursuivant, on trouve que $x_4 - 2 \approx 10^{-7}$ et $|x_5 - 2| \approx 10^{-15}$, soit quasiment la précision machine. Voir sur la Figure [B.2.4](#) les itérés de Newton en partant de $x_0 = 9.5$.

[Retour à l'exercice ▲](#)

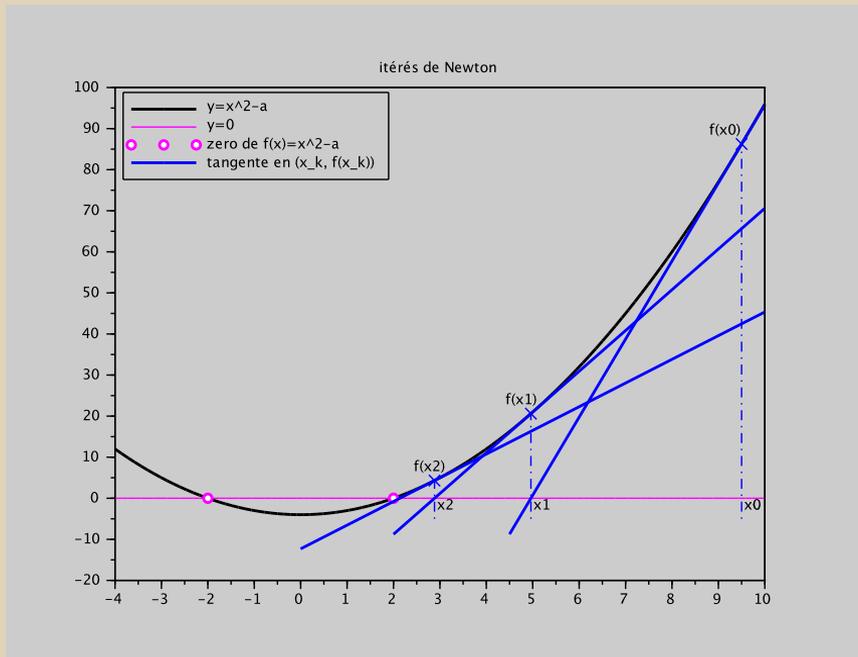


FIGURE B.2.4 – Itérés de Newton pour $f(x) = x^2 - a$, $x_0 = 9.5$, $a = 4$.

Solution de l'exercice B.1.12

Puisque $f(0)f(\frac{\pi}{2}) < 0$ la fonction f admet au moins une racine sur $[0, \frac{\pi}{2}]$. En calculant on obtient

$$x_0 = 0, x_1 = 1, x_2 = 0.7504, x_3 = 0.7391$$

puis

$$x_0 = \frac{\pi}{4}, x_1 = 0.7395, x_2 = 0.7391, x_3 = 0.7391$$

[Retour à l'exercice ▲](#)

Solution de l'exercice B.1.13

L'équation de la droite (pour ceux qui auraient un trou de mémoire) est donnée par

$$\frac{y - f(x_n)}{x - x_n} = \frac{f(x_n) - f(x_{n-1})}{x_n - x_{n-1}} \Leftrightarrow y = f(x_n) + (x - x_n) \frac{f(x_n) - f(x_{n-1})}{x_n - x_{n-1}}.$$

x_{n+1} est l'abscisse de l'intersection de cette droite avec l'axe Ox , on a donc

$$y = 0 \Leftrightarrow x_{n+1} = x_n - f(x_n) \frac{x_n - x_{n-1}}{f(x_n) - f(x_{n-1})}$$

On retrouve la formule de la sécante.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Solution de l'exercice B.1.14

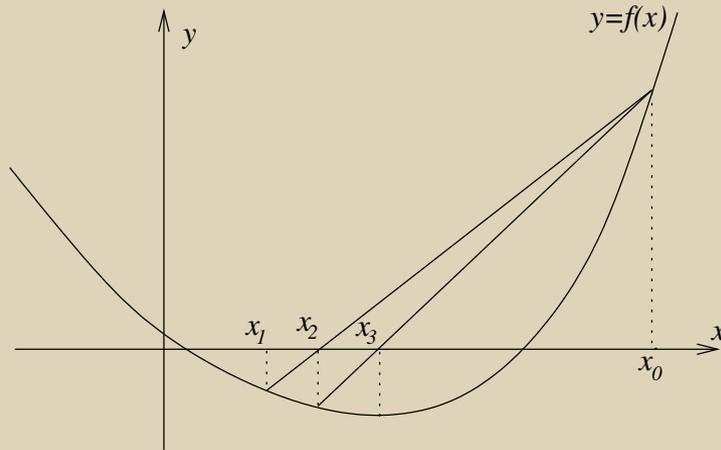


FIGURE B.2.5 – Méthode de la sécante modifiée

Comme on le voit sur la Figure B.2.5, la suite construite par la méthode de la sécante modifiée est obtenue successivement avec les couples x_0, x_1 puis x_2, x_0 puis x_3, x_0 , chacun des couples encadre la racine.

Par la méthode de la sécante simple, à partir de x_0, x_1 on aurait construit x_2 , (le même !) puis à partir de x_1, x_2 on aurait construit un x_3' qui n'est pas x_3 .

[Retour à l'exercice ▲](#)

Solution de l'exercice B.1.15

Donnons d'abord la fonction f et sa matrice jacobienne

$$f(x) = \begin{pmatrix} x_1^2 + (x_2^2 - 1)^2 - 4 \\ x_1^2 - x_2^2 + 1 \end{pmatrix} \quad Df(x) = \begin{pmatrix} 2x_1 & 2(x_2 - 1) \\ 2x_1 & 2x_2 \end{pmatrix}$$

Alors on peut calculer $x^{(1)}$ en fonction de $x^{(0)}$ de la manière suivante :

$$(Df(x^{(0)}))h = -f(x^{(0)}), \quad x^{(1)} = x^{(0)} + h$$

Par exemple, si on choisit

$$x^{(0)} = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}, \text{ on calcule } Df(x^{(0)}) = \begin{pmatrix} 2 & 0 \\ 2 & -1 \end{pmatrix}, \quad f(x^{(0)}) = \begin{pmatrix} -3 \\ 1 \end{pmatrix}$$

puis après résolution

$$h = \begin{pmatrix} 1.5 \\ 4 \end{pmatrix}, \quad x^{(1)} = \begin{pmatrix} 2.5 \\ 5 \end{pmatrix}, \quad Df(x^{(1)}) = \begin{pmatrix} 5 & 8 \\ 5 & -1 \end{pmatrix}, \quad f(x^{(1)}) = \begin{pmatrix} 18.25 \\ 2.25 \end{pmatrix}$$

Après quelques itérations on obtient la solution $x = \begin{pmatrix} 1.25 \\ 2.56 \end{pmatrix}$.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Aide 1, Question 1, Exercice B.2.1

On doit résoudre

$$Mx^{(k+1)} = Nx^{(k)} + b$$

avec

$$M = \frac{1}{\omega}D - E, \quad N = \left(\frac{1}{\omega} - 1\right)D + F,$$

on vérifie bien que $M - N = D - E - F = A$.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Aide 1, Question 2, Exercice B.2.1

A, b , x_0 , N, ϵ donnés

1. $n =$ nombre de lignes de la matrice A
2. pour $i = 1$ jusqu'à n faire
3. si $|a_{ii}| < \epsilon$ alors
4. arrêter l'algorithme et écrire un message d'erreur
5. fin si
6. fin pour
7. pour $k = 1$ jusqu'à N faire
8. pour $i = 1$ jusqu'à n faire
9.
$$x_1(i) \leftarrow \frac{1}{a_{ii}} (b_i - \sum_{j=1}^{i-1} a_{ij} x_1(j) - \sum_{j=i+1}^n a_{ij} x_0(j));$$
10. $\mathbf{x}_1(\mathbf{i}) \leftarrow \omega \mathbf{x}_1(\mathbf{i}) + (1 - \omega) \mathbf{x}_0(\mathbf{i}); \rightarrow$ variante sur la méthode de relaxation
11. fin pour
12. si $\frac{\|x_1 - x_0\|}{\|x_1\|} \leq \epsilon$
13. arrêter et écrire que x_1 est la solution et retourner
14. sinon
15. $x_0 = x_1;$
16. fin si
17. fin pour
18. arrêt avec un message indiquant la non-convergence

Remarque :

Au niveau pratique, on ne stocke que 2 vecteurs (x_0 et x_1) c'est-à-dire $x^{(k)}$ et $x^{(k+1)}$, nécessaires pour calculer l'erreur relative.

On écrase l'ancien vecteur par le nouveau petit à petit.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Aide 1, Question 1, Exercice B.2.2

$\rho(J) = 0$, donc la méthode de Jacobi converge pour cette matrice.

R admet 0 , λ_1 et λ_2 comme valeurs propres.

Les coefficients du polynôme caractéristique permettent de voir que $\lambda_1 \lambda_2 = -4$, donc forcément une des deux valeurs propres est plus grande que 1 en module (sinon le produit serait inférieur à 1 en module).

Donc $\rho(R) > 1$, donc la méthode de Gauss-Seidel diverge pour cette matrice.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Aide 1, Question 2, Exercice B.2.2

$\rho(R) = 0$, donc la méthode de Gauss-Seidel converge pour cette matrice.

Les coefficients du polynôme caractéristique permettent de voir que le produit des trois valeurs propres de J vaut -8 , donc forcément une des trois valeurs propres est plus grande que 1 en module (sinon le produit serait inférieur à 1 en module).

Donc $\rho(J) > 1$, donc la méthode de Jacobi diverge pour cette matrice.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Aide 1, Question 1, Exercice B.2.3

Revoyez la définition d'une norme subordonnée.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Aide 2, Question 1, Exercice B.2.3

D'après la définition, on a donc pour tous les x non nuls appartenant à \mathbb{C}^n

$$\|A\| \geq \frac{\|Ax\|}{\|x\|}.$$

Faites le bon choix pour x .

[Retour à l'exercice ▲](#)

Aide 3, Question 1, Exercice B.2.3

Si l'on note λ^* la plus grande valeur propre en module de A , si on note x^* un vecteur propre associé, on a donc

$$Ax^* = \lambda^* x^* \Rightarrow \|Ax^*\| = |\lambda^*| \|x^*\| = \rho(A) \|x^*\|.$$

donc

$$\|A\| \geq \frac{\|Ax^*\|}{\|x^*\|} = \rho(A).$$

[Retour à l'exercice ▲](#)

Aide 1, Question 2, Exercice B.2.3

On suppose que $\lambda \neq 0$, on a alors :

$$\begin{aligned} \lambda \text{ valeur propre de } (D - E)^{-1}F &\Leftrightarrow \exists y \neq 0, (D - E)^{-1}Fy = \lambda y \\ &\Leftrightarrow \exists y \neq 0, Fy = \lambda(D - E)y \\ &\Leftrightarrow \exists y \neq 0, (F + \lambda E)y = \lambda Dy \\ &\Leftrightarrow \exists y \neq 0, \frac{1}{\lambda}(F + \lambda E)y = Dy \\ &\Leftrightarrow \exists y \neq 0, D^{-1}\left(\frac{1}{\lambda}F + E\right)y = y \\ &\Leftrightarrow 1 \text{ valeur propre de } D^{-1}\left(\frac{1}{\lambda}F + E\right) \end{aligned}$$

[Retour à l'exercice ▲](#)

Aide 1, Question 3, Exercice B.2.3

Puisque 1 est valeur propre de $D^{-1}\left(\frac{1}{\lambda}F + E\right)$, on a donc

$$\rho\left(D^{-1}\left(\frac{1}{\lambda}F + E\right)\right) \geq 1,$$

donc

$$\|D^{-1}\left(\frac{1}{\lambda}F + E\right)\|_{\infty} \geq 1,$$

or

$$\|D^{-1}\left(\frac{1}{\lambda}F + E\right)\|_{\infty} = \sum_{j=1}^{i-1} |a_{ij}| + \sum_{j=i+1}^n \frac{|a_{ij}|}{|\lambda|}.$$

[Retour à l'exercice ▲](#)

Aide 1, Question 4, Exercice B.2.3

On va montrer que si la méthode de Gauss-Seidel diverge, alors la matrice A n'est pas à diagonale strictement dominante.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Aide 2, Question 4, Exercice B.2.3

Si la méthode de Gauss-Seidel diverge que peut-on dire du rayon spectral de $(D - E)^{-1}F$?

[Retour à l'exercice ▲](#)

Aide 3, Question 4, Exercice B.2.3

Si la méthode de Gauss-Seidel diverge, le rayon spectral de $(D - E)^{-1}F$ est supérieur ou égal à 1, donc il existe une valeur propre λ de $(D - E)^{-1}F$ supérieure ou égale à 1, pour cette valeur propre, en appliquant la question précédente, on a

$$1 \leq \max_i \left(\frac{1}{|a_{ii}|} \left(\sum_{j=1}^{i-1} |a_{ij}| + \sum_{j=i+1}^n \frac{|a_{ij}|}{|\lambda|} \right) \right) \leq \max_i \left(\frac{1}{|a_{ii}|} \left(\sum_{j=1}^{i-1} |a_{ij}| + \sum_{j=i+1}^n |a_{ij}| \right) \right).$$

Ce qui prouve que la matrice A n'est pas à diagonale strictement dominante.

Donc par contraposée : si la matrice A est à diagonale strictement dominante, la méthode de Gauss-Seidel converge.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Aide 1, Question 1, Exercice B.2.6

Tracer la courbe $x^2 = a$, tracez les tangentes et constatez graphiquement que la méthode de Newton converge.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Aide 1, Question 2, Exercice B.2.6

On calcule

$$g'(x^*) = \frac{(1-p)a}{(x^*)^p} = 1 - p,$$

or la proposition 4.2.3 permet de conclure quant à la convergence pour $g'(x^*) < 1$, bien sûr cette proposition donne seulement une condition suffisante de convergence, mais pour $p \geq 2$, cette condition suffisante n'est pas vérifiée, donc la méthode de point fixe peut ne pas converger.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Aide 1, Question 3, Exercice B.2.6

On a

$$h(x) = x - \frac{x^p - a}{px^{p-1}} = x\left(1 - \frac{1}{p}\right) + \frac{a}{px^{p-1}}.$$

On obtient, comme pour toute méthode de Newton, $h'(x^*) = 0$.

[Retour à l'exercice ▲](#)

Solution de l'exercice B.2.7

Pour $x^{(0)} = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$, on obtient $x^{(1)} = \begin{pmatrix} \frac{2}{3} \\ \frac{2}{3} \end{pmatrix}$, après 7 itérations on obtiendrait $\begin{pmatrix} 1 \\ -2.5610^{-8} \end{pmatrix}$.

Pour $y^{(0)} = \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \end{pmatrix}$, on obtient $y^{(1)} = \begin{pmatrix} \frac{1}{3} \\ \frac{2}{3} \end{pmatrix}$, après 5 itérations on obtiendrait $\begin{pmatrix} -0.5 \\ 0.8660254 \end{pmatrix}$.

Pour $z^{(0)} = \begin{pmatrix} 0 \\ -1 \end{pmatrix}$, on obtient $z^{(1)} = \begin{pmatrix} \frac{-1}{3} \\ \frac{2}{3} \end{pmatrix}$, après 5 itérations on obtiendrait $\begin{pmatrix} -0.5 \\ -0.8660254 \end{pmatrix}$.

On rappelle que les racines de l'unité sont $1, j, j^2$, ce sont les valeurs obtenues numériquement.

[Retour à l'exercice ▲](#)