Ing. MACS 1 — 2025-2026

Analyse Numérique I : Chapitre 6, Intégration numérique[1]

6.1 Méthodes de quadrature élémentaires

Définition 6.1. *Soient $f \in \mathcal{C}^0([a,b];\mathbb{R})$ et $\mathcal{Q}_n(f,a,b)$ la* ***formule de quadrature élémentaire*** *donnée par :*

$$\mathcal{Q}_n(f,a,b) \stackrel{\text{def}}{=} (b-a)\sum_{j=0}^{n} w_j f(x_j) \tag{1}$$

avec $\forall j \in [\![0,n]\!]$ $w_j \in \mathbb{R}$ et $x_j \in [a,b]$ distincts deux à deux. L'erreur associée à cette formule de quadrature, notée $\mathcal{E}_{a,b}(f)$, est définie par

$$\mathcal{E}_{a,b}(f) = \int_a^b f(x)dx - \mathcal{Q}_n(f,a,b), \quad \forall f \in \mathcal{C}^0([a,b];\mathbb{R}) \tag{2}$$

Définition 6.2. *On dit qu'une formule d'intégration (ou formule de quadrature) est d'ordre p ou a pour* ***degré d'exactitude*** *p si elle est exacte pour les polynômes de degré inférieur ou égal à p.*

Proposition 6.1. *Soit $\mathcal{Q}_n(f,a,b)$ definie en (1), une formule de quadrature élémentaire à $(n+1)$ points (distincts deux à deux dans $[a,b]$).*
L'application $f \longmapsto \mathcal{Q}_n(f,a,b)$ définie de $\mathcal{C}^0([a,b];\mathbb{R})$, muni de la norme infini, à valeurs dans $\mathbb{R}$ est linéaire continue, et elle a pour degré d'exactitude $k \in \mathbb{N}$ si et seulement si

$$\mathcal{Q}_n(x \mapsto x^r, a, b) = \int_a^b x^r dx, \quad \forall r \in [\![0,k]\!].$$

Proposition 6.2. *Soit $\mathcal{Q}_n(f,a,b)$ definie en (1), une formule de quadrature élémentaire à $(n+1)$ points $(x_i)_{i\in[\![0,n]\!]}$ (distincts deux à deux dans $[a,b]$).*
On note $x = \varphi(t) = \alpha + \beta t$, $\beta \in \mathbb{R}^*$, le changement de variable affine, $t_i = \varphi^{-1}(x_i)$, $\forall i \in [\![0,n]\!]$, et

$$\mathcal{Q}_n(g, \varphi^{-1}(a), \varphi^{-1}(b)) = \left(\varphi^{-1}(b) - \varphi^{-1}(a)\right)\sum_{i=0}^{n} w_i g(t_i). \tag{3}$$

Alors $\mathcal{Q}_n(f,a,b)$ est de degré d'exactitude k si et seulement si $\mathcal{Q}_n(g, \varphi^{-1}(a), \varphi^{-1}(b))$ est de degré d'exactitude k.

Proposition 6.3. *La formule de quadrature élémentaire (1) à $(n+1)$ points, distincts deux à deux, est de degré d'exactitude k (au moins) si et seulement si*

$$(b-a)\sum_{i=0}^{n} w_i x_i^r = \frac{b^{r+1} - a^{r+1}}{r+1}, \quad \forall r \in [\![0,k]\!]. \tag{4}$$

[1] auteur: F. Cuvelier. Compilé le 6 décembre 2025 à 6 h 23.

Corollaire 6.1. *La formule de quadrature élémentaire (1) à $(n+1)$ points est de degré d'exactitude 0 au moins si et seulement si*

$$\sum_{i=0}^{n} w_i = 1.$$

Proposition 6.4. *Soient $(x_i)_{i\in[\![0,n]\!]}$ des points deux à deux distincts de l'intervalle $[a,b]$ donnés. Il existe alors une unique formule de quadrature élémentaire (1) à $(n+1)$ points de degré d'exactitude n au moins. Les poids $(w_i)_{i=0}^{n}$ sont alors solutions de*

$$(b-a)\begin{pmatrix} 1 & 1 & \cdots & 1 \\ x_0 & x_1 & \cdots & x_n \\ \vdots & \vdots & & \vdots \\ x_0^n & x_1^n & \cdots & x_n^n \end{pmatrix}\begin{pmatrix} w_0 \\ w_1 \\ \vdots \\ w_n \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} b-a \\ \frac{b^2-a^2}{2} \\ \vdots \\ \frac{b^{n+1}-a^{n+1}}{n+1} \end{pmatrix} \tag{5}$$

Proposition 6.5. *Soit $\mathcal{Q}_n(f,a,b)$ definie en (1), une formule de quadrature élémentaire à $(n+1)$ points (distincts deux à deux).On dit qu'elle est* ***symétrique*** *si*

$$\forall i \in [\![0,n]\!], \quad \frac{x_i + x_{n-i}}{2} = \frac{a+b}{2} \quad \text{et} \quad w_i = w_{n-i}. \tag{6}$$

Dans ce cas si cette formule est exacte pour les polynômes de degré $2m$ alors elle est nécessairement exacte pour les polynômes de degré $(2m+1)$.

Proposition 6.6. *Soit $\mathcal{Q}_n(f,a,b)$ definie en (1), une formule de quadrature élémentaire à $(n+1)$ points $(x_i)_{i\in[\![0,n]\!]}$ (distincts deux à deux).*
La formule de quadrature est de degré d'exactitude n au moins si et seulement si pour tout $i \in [\![0,n]\!]$, les poids w_i sont donnés par

$$w_i = \frac{1}{b-a}\int_a^b \prod_{\substack{j=0\\j\neq i}}^{n} \frac{x-x_j}{x_i-x_j}dx = \int_0^1 \prod_{\substack{j=0\\j\neq i}}^{n} \frac{t-t_j}{t_i-t_j}dt, \quad \forall i \in [\![0,n]\!] \tag{7}$$

avec $t_i = (x_i-a)/(b-a)$.
Si $f \in \mathcal{C}^{n+1}([a,b];\mathbb{R})$ alors on a

$$\left|\int_a^b f(x)dx - \mathcal{Q}_n(f,a,b)\right| \leqslant \frac{1}{(n+1)!}\left\|f^{(n+1)}\right\|_\infty \int_a^b \Big|\prod_{i=0}^{n}(x-x_i)\Big|dx \tag{8}$$

Lemme 6.1. *Soient $(x_i)_{i=0}^{n}$ des points distincts 2 à 2 de l'intervalle $[a,b]$ vérifiant*

$$\forall i \in [\![0,n]\!], \quad \frac{x_i + x_{n-i}}{2} = \frac{a+b}{2}.$$

Soient $(w_i)_{i=0}^{n}$ définis par

$$w_i = \frac{1}{b-a}\int_a^b \prod_{\substack{j=0\\j\neq i}}^{n} \frac{x-x_j}{x_i-x_j}dx, \quad \forall i \in [\![0,n]\!]$$

On a alors

$$\forall i \in [\![0,n]\!], \quad w_i = w_{n-i}$$

et la formule de quadrature élémentaire associée est de degré d'exactitude au moins n si n est impaire et au moins $(n+1)$ sinon.

Proposition 6.7 (Degré maximal d'exactitude). *Soit $\mathcal{Q}_n(f,a,b)$ défini par (1) une formule de quadrature élémentaire de degré d'exactitude au moins n. Elle est alors de degré d'exactitude $(n+m)$, $m \in \mathbb{N}^*$, au moins si et seulement si*

$$\int_a^b \pi_n(x) \mathrm{Q}(x) dx = 0, \ \forall \mathrm{Q} \in \mathbb{R}_{m-1}[X] \tag{9}$$

où π_n est le polynôme de degré $(n+1)$ défini par

$$\pi_n(x) = \prod_{i=0}^{n} (x - x_i). \tag{10}$$

Le degré maximal d'exactitude d'une formule de quadrature élémentaire à $(n+1)$ points est $(2n+1)$.
De plus, on a

$$(9) \Longleftrightarrow \int_a^b \pi_n(x) x^k dx = 0, \ \forall k \in [\![0, m-1]\!]. \tag{11}$$

6.2 Formules élémentaires de Newton-Cotes

$$\forall i \in [\![0,n]\!], \quad x_i = a + ih \text{ avec } h = (b-a)/n.$$

On a alors

$$\forall i \in [\![0,n]\!], \quad \frac{x_i + x_{n-i}}{2} = \frac{a+b}{2}.$$

Proposition 6.8. *Soient $f \in \mathcal{C}^0([a,b];\mathbb{R})$ et $(x_i)_{i\in[\![0,n]\!]}$ une discrétisation régulière de l'intervalle $[a,b]$: $x_i = a + ih$ avec $h = (b-a)/n$.*
Les formules de quadrature élémentaires de Newton-Cotes s'écrivent sous la forme

$$\int_a^b f(x)dx \approx (b-a) \sum_{i=0}^{n} w_i f(x_i)$$

où les poids $(w_i)_{i=0}^n$ sont donnés par (7).
Elles sont symétriques et leur degré d'exactitude (d.e. dans le tableau suivant) est égal à n si n est impair et à $n+1$ sinon.

n	**d.e.**	w_i (poids)									**nom**
1	1	$\frac{1}{2}$	$\frac{1}{2}$								trapèze
2	3	$\frac{1}{6}$	$\frac{2}{3}$	$\frac{1}{6}$							Simpson
3	3	$\frac{1}{8}$	$\frac{3}{8}$	$\frac{3}{8}$	$\frac{1}{8}$						Newton
4	5	$\frac{7}{90}$	$\frac{16}{45}$	$\frac{2}{15}$	$\frac{16}{45}$	$\frac{7}{90}$					Villarceau
5	5	$\frac{19}{288}$	$\frac{25}{96}$	$\frac{25}{144}$	$\frac{25}{144}$	$\frac{25}{96}$	$\frac{19}{288}$				?
6	7	$\frac{41}{840}$	$\frac{9}{35}$	$\frac{9}{280}$	$\frac{34}{105}$	$\frac{9}{280}$	$\frac{9}{35}$	$\frac{41}{840}$			Weddle
7	7	$\frac{751}{17280}$	$\frac{3577}{17280}$	$\frac{49}{640}$	$\frac{2989}{17280}$	$\frac{2989}{17280}$	$\frac{49}{640}$	$\frac{3577}{17280}$	$\frac{751}{17280}$		?
8	9	$\frac{989}{28350}$	$\frac{2944}{14175}$	$-\frac{464}{14175}$	$\frac{5248}{14175}$	$-\frac{454}{2835}$	$\frac{5248}{14175}$	$-\frac{464}{14175}$	$\frac{2944}{14175}$	$\frac{989}{28350}$	?

Table 1: Méthodes de Newton-Cotes

6.3 Formules élémentaires de Gauss-Legendre

Les polynômes de Legendre peuvent être définis par la formule de récurrence de Bonnet

$$(n+1)\mathrm{P}_{n+1}(t) = (2n+1)t\mathrm{P}_n(t) - n\mathrm{P}_{n-1}(t), \ \forall n \geqslant 1 \tag{12}$$

avec $\mathrm{P}_0(t) = 1$ et $\mathrm{P}_1(t) = t$.
On a les propriétés suivantes:

prop.1 le polynôme de Legendre P_n est de degré n,

prop.2 la famille $\{\mathrm{P}_k\}_{k=0}^n$ est une base de $\mathbb{R}_n[X]$,

prop.3 pour tout $(m,n) \in \mathbb{N}^2$, on a

$$\int_{-1}^{1} \mathrm{P}_m(t)\mathrm{P}_n(t)dt = \frac{2}{2n+1}\delta_{m,n}, \tag{13}$$

ce qui correspond à l'orthogonalité des polynômes de Legendre pour le produit scalaire

$$\langle \mathrm{P}_m, \mathrm{P}_n \rangle = \int_{-1}^{1} \mathrm{P}_m(t)\mathrm{P}_n(t)dt.$$

prop.4 Soit $n \geqslant 1$, P_n est scindé sur $\mathbb{R}$ et ses n racines, notées $(t_i)_{i=0}^n$, sont simples dans $]-1,1[$, c'est à dire

$$\mathrm{P}_n(t) = C\prod_{i=0}^{n-1}(t-t_i),\ C \in \mathbb{R}^*$$

où les t_i sont 2 à 2 distincts (et ordonnés). Les $(n+1)$ racines simples de P_{n+1} sont alors chacunes dans l'un des $(n+1)$ intervalles $]-1,t_0[$, $]t_0,t_1[$, $\ldots$, $]t_{n-2},t_{n-1}[$, $]t_{n-1},1[$.

Proposition 6.9. *Soit $(t_i)_{i=0}^n$ les $(n+1)$ racines distinctes du polynôme de Legendre de degré $(n+1)$. On note $x_i = \frac{a+b}{2} + \frac{b-a}{2}t_i$, $\forall i \in [\![0,n]\!]$ et w_i les poids donnés par (7). La formule de quadrature élémentaire*

$$\int_a^b f(x)dx \approx (b-a)\sum_{i=0}^{n} w_i f(x_i)$$

est appelée la formule de quadrature de Gauss-Legendre. C'est l'unique formule de quadrature élémentaire à $(n+1)$ points ayant pour degré d'exactitude $(2n+1)$.

n	**exactitude**	w_i (poids)	t_i (points)
0	1	1	0
1	3	$1/2, 1/2$	$-\sqrt{1/3}, \sqrt{1/3}$
2	5	$5/18, 8/18, 5/18$	$-\sqrt{3/5}, 0, \sqrt{3/5}$

Table 2: Méthodes de Gauss-Legendre sur $[-1,1]$

Théorème 6.1. *Soient $f \in \mathcal{C}^{2n+2}([a,b];\mathbb{R})$ et $\mathcal{Q}_n(f,a,b)$ la formule de quadrature de Gauss-Legendre définie dans la Proposition 6.9. Alors on a*

$$|\int_a^b f(x)dx - \mathcal{Q}_n(f,a,b)| \leqslant \frac{\left\|f^{(2n+2)}\right\|_\infty}{(2n+2)!}\int_a^b \pi_n(x)^2 dx \tag{14}$$

où $\pi_n(x) = \prod_{i=0}^n (x-x_i)$, les x_i étant les points de la formule de quadrature.

7 Méthodes de quadrature composées

Définition 7.1. *Soit $(\alpha_i)_{i\in[\![0,k]\!]}$ une subdivison de l'intervalle $[\alpha,\beta]$:*

$$\alpha = \alpha_0 < \alpha_1 < \cdots < \alpha_k = \beta.$$

On a alors

$$\int_\alpha^\beta f(x)dx = \sum_{i=1}^{k}\int_{\alpha_{i-1}}^{\alpha_i} f(x)dx. \tag{15}$$

Soit $\mathcal{Q}_n(g,a,b)$ la formule de quadrature élémentaire à $n+1$ points d'ordre p donnée par

$$\mathcal{Q}_n(g,a,b) \overset{\text{def}}{=} (b-a)\sum_{j=0}^{n} w_j g(x_j) \approx \int_a^b g(x)dx.$$

*La **méthode de quadrature composée associée à** $\mathcal{Q}_n$, notée $\mathcal{Q}_{k,n}^{\text{comp}}$, est donnée par*

$$\mathcal{Q}_{k,n}^{\text{comp}}(f,\alpha,\beta) = \sum_{i=1}^{k} \mathcal{Q}_n(f,\alpha_{i-1},\alpha_i) \approx \int_\alpha^\beta f(x)dx \tag{16}$$

Proposition 7.1. *Soit $\mathcal{Q}_n$ une formule de quadrature élémentaire à $n+1$ points. Si $\mathcal{Q}_n$ est d'ordre p alors la méthode de quadrature composée associée est aussi d'ordre p : elle est exacte pour tout polynôme de degré p.*

Théorème 7.1 ([1], page 43 (admis))**.** *Soient $\mathcal{Q}_{k,n}^{\text{comp}}$ une méthode de quadrature composée associée à une méthode de quadrature élémentaire $\mathcal{Q}_n$ de degré d'exactitude $p \geqslant n$ et $f \in \mathcal{C}^{p+1}([\alpha,\beta];\mathbb{R})$. On a alors*

$$\left|\int_\alpha^\beta f(x)dx - \mathcal{Q}_{k,n}^{\text{comp}}(f,\alpha,\beta)\right| \leqslant C_p(\beta-\alpha)h^{p+1}\left\|f^{(p+1)}\right\|_\infty \tag{17}$$

avec $h = \max_{j\in[\![1,k]\!]}(\alpha_j - \alpha_{j-1})$ et $C_p > 0$. Ceci s'écrit aussi sous la forme

$$\left|\int_\alpha^\beta f(x)dx - \mathcal{Q}_{k,n}^{\text{comp}}(f,\alpha,\beta)\right| = \mathcal{O}(h^{p+1}) \tag{18}$$

*et son **ordre de convergence** est $(p+1)$.*

8 Dominance (rappels?)

Définition 8.1. *Soient X un sous-ensemble de $\mathbb{R}$, et f et g deux fonctions définies sur X à valeurs réelles. On dit que f est dominée par g au voisinage de $a \in \overline{X}$ s'il existe un voisinage U de a et un réel $C \in \mathbb{R}_+^*$ tel que*

$$\forall x \in U \cap X, \quad |f(x)| \leqslant C|g(x)|.$$

On note $f(x) \underset{x\to a}{=} \mathcal{O}(g(x))$, ou $f \underset{a}{=} \mathcal{O}(g)$ (notation de Bachmann), ou, lorsqu'il n'y pas d'ambiguïté sur la valeur de a, $f(x) = \mathcal{O}(g(x))$.

Proposition 8.1. *Soient X un sous-ensemble de $\mathbb{R}$, f et g deux fonctions définies sur X à valeurs réelles, et $a \in \overline{X}$.*

- *Si a est fini, $f(x) \underset{x\to a}{=} \mathcal{O}(g(x))$ si et seulement si*

$$\exists \eta > 0,\ \exists C > 0,\ \text{tel que } \forall x \in X,\ |x-a| < \eta \implies |f(x) \leqslant C|g(x)|.$$

- *Si $a = +\infty$, $f(x) \underset{x\to a}{=} \mathcal{O}(g(x))$ si et seulement si*

$$\exists M > 0,\ \exists C > 0,\ \text{tel que } \forall x \in X,\ x > M \implies |f(x) \leqslant C|g(x)|.$$

References

[1] M. Crouzeix and A.L. Mignot. *Analyse numérique des équations différentielles.* Mathématiques appliquées pour la maîtrise. Masson, 1992.