

Proposition: convergence de la méthode de Newton

Soit f une fonction de classe \mathcal{C}^2 sur un certain voisinage d'une racine simple α de f . Soit x_0 donné dans ce voisinage, la suite $(x_k)_{k \in \mathbb{N}}$ définie par la méthode de Newton

$$x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f'(x_k)}, \quad \forall k \in \mathbb{N}. \quad (\text{P-1})$$

est localement convergente d'ordre 2.

Proof. Comme α est racine simple de f (i.e. $f(\alpha) = 0$ et $f'(\alpha) \neq 0$) et f' continue, il existe un voisinage \mathcal{V} de α tel que pour tout $x \in \mathcal{V}$, $f'(x) \neq 0$. On peut alors définir la fonction Φ sur \mathcal{V} par

$$\forall x \in \mathcal{V}, \quad \Phi(x) = x - \frac{f(x)}{f'(x)}.$$

On a alors $x_{k+1} = \Phi(x_k)$. La fonction Φ est de classe \mathcal{C}^1 sur \mathcal{V} et

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

On a donc $\Phi'(\alpha) = 0$ car $f(\alpha) = 0$. D'après le théorème de convergence locale du point fixe (théorème 2.5), on en déduit que la suite (x_k) converge vers α (et que la convergence est au moins d'ordre 1. Pour démontrer qu'elle est d'ordre 2, on ne peut utiliser le théorème 2.6 car Φ n'est pas de classe \mathcal{C}^2 . Toutefois comme f est de classe \mathcal{C}^2 , on applique la formule de Taylor-Lagrange aux points x_k, α (en supposant $x_k \neq \alpha$) : il existe ξ_k compris entre x_k et α tel que

$$\underbrace{f(\alpha)}_{=0} = f(x_k) + (\alpha - x_k)f'(x_k) + \frac{(\alpha - x_k)^2}{2!}f^{(2)}(\xi_k).$$

Comme $f'(x_k) \neq 0$, l'équation précédente s'écrit aussi

$$\begin{aligned}\alpha &= x_k - \frac{f(x_k)}{f'(x_k)} - (\alpha - x_k)^2 \frac{f^{(2)}(\xi_k)}{2f'(x_k)} \\ &= x_{k+1} - (\alpha - x_k)^2 \frac{f^{(2)}(\xi_k)}{2f'(x_k)}.\end{aligned}$$

On obtient alors

$$\frac{\alpha - x_{k+1}}{(\alpha - x_k)^2} = -\frac{f^{(2)}(\xi_k)}{2f'(x_k)}.$$

La fonction f est de classe \mathcal{C}^2 et la suite ξ_k converge vers α (car ξ_k compris entre x_k et α). Ceci entraine par passage à la limite que

$$\lim_{k \rightarrow +\infty} \frac{x_{k+1} - \alpha}{(x_k - \alpha)^2} = \frac{f^{(2)}(\alpha)}{2f'(\alpha)}.$$

La convergence est donc d'ordre 2. □

