

ANALYSE NUMÉRIQUE SV

ÉQUATIONS DIFFÉRENTIELLES ORDINAIRES

Simone Deparis

EPFL Lausanne – MATH

Printemps 2021



CONVERGENCE

DÉFINITION

Soit $y(t)$ la solution du problème de Cauchy (2) sur l'intervalle $[0, T]$; soit u_n une solution approchée au temps $t_n = nh$ trouvée par une méthode numérique donnée, où $h = T/N_h$ ($N_h \in \mathbb{N}$) est le pas de temps. La méthode est dite *convergente* si

$$\forall n = 0, \dots, N_h : |u_n - y(t_n)| \leq C(h)$$

où $C(h) \rightarrow 0$ lorsque $h \rightarrow 0$.

Si, en plus, il existe $p > 0$ tel que $C(h) = Kh^p$ pour une constante K qui ne dépend pas de h ni de n , on dit que la méthode est *convergente d'ordre p* .

Dans la suite du cours, on va analyser la convergence et l'ordre de la méthode d'Euler progressive.

CONVERGENCE D'EULER PROGRESSIF

THÉORÈME

Si $y \in \mathcal{C}^2([0, T])$ et f satisfait $-\infty < -\lambda_{\max} \leq \frac{\partial f}{\partial y}(t, y) \leq 0$ pour tout $t \in [0, T]$ et pour tout $y \in \mathbb{R}$. alors la méthode d'Euler progressive est convergente et

$$\forall n \geq 0, |y(t_n) - u_n| \leq c(t_n)h, \quad \text{où } c(t_n) = t_n \frac{1}{2} \max_{t \in [t_0, t_n]} |y''(t)|, \quad (21)$$

En particulier, la méthode est convergente d'ordre $p = 1$, avec

$$C(h) = c(T)h.$$

REMARQUE

Le même type de résultat peut être établi pour la méthode d'Euler rétrograde.

DÉMONSTRATION I

On définit l'*erreur de troncature locale* de la méthode d'Euler progressive comme

$$\tau_{n+1}(h) = \frac{y(t_{n+1}) - y(t_n)}{h} - y'(t_n), \quad (22)$$

et l'*erreur de troncature globale*

$$\tau(h) = \max_n |\tau_n(h)|.$$

On sait (voir *différences finies*) que

$$\tau_{n+1}(h) = \frac{1}{2} \max_{t \in [t_n, t_{n+1}]} |y''(t)| h.$$

Donc, on a l'estimation suivante pour l'erreur de troncature globale :

$$\tau(h) \leq \frac{1}{2} \max_{t \in [0, T]} |y''(t)| h.$$

DÉMONSTRATION II

On a les équations suivantes pour $y(t)$ et u_n .

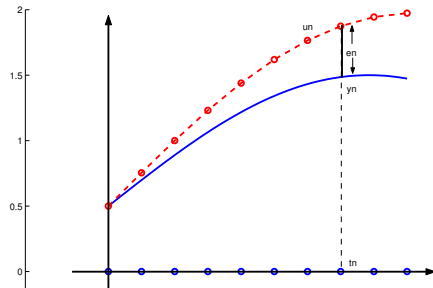
$$\begin{cases} y'(t) = f(t, y(t)) & \forall t \in I \\ y(t_0) = y_0 \end{cases} \quad \begin{cases} \frac{u_{n+1} - u_n}{h} = f(t_n, u_n) & n = 0, 1, 2, \dots, N_h \\ u_0 = y_0. \end{cases}$$

et de l'équation (22) pour l'erreur de troncature locale

$$\tau_{n+1}(h) = \frac{y(t_{n+1}) - y(t_n)}{h} - y'(t_n) = \frac{y(t_{n+1}) - y(t_n)}{h} - f(t_n, y(t_n)),$$

on obtient pour $e_n = u_n - y(t_n)$

$$\begin{cases} \frac{e_{n+1} - e_n}{h} = f(t_n, u_n) - f(t_n, y(t_n)) - \tau_{n+1}(h), \\ e_0 = 0. \end{cases} \quad (23)$$



DÉMONSTRATION III

D'après le théorème de Lagrange, il existe ξ_n tel que

$$f(t_n, u_n) - f(t_n, y(t_n)) = \frac{\partial f(t, \xi_n)}{\partial y}(u_n - y(t_n)) = \frac{\partial f(t, \xi)}{\partial y} e_n.$$

Donc il existe η_n tel qu'à partir de (23) on trouve

$$e_{n+1} = \left(1 + h \frac{\partial f(t, \xi_n)}{\partial y}\right) e_n - h \frac{h}{2} y''(\eta_n).$$

Si $h < \frac{2}{\lambda_{\max}}$, on a $1 + h \frac{\partial f(t, \xi_n)}{\partial y} \in (-1, 1)$ et donc

$$|e_{n+1}| \leq |e_n| + h\tau(h) \leq (|e_{n-1}| + h\tau(h)) + h\tau(h) \leq |e_0| + (n+1)h\tau(h).$$

Comme $e_0 = 0$, on en déduit

$$|e_n| \leq nh\tau(h) = t_n\tau(h),$$

donc on trouve bien (21).

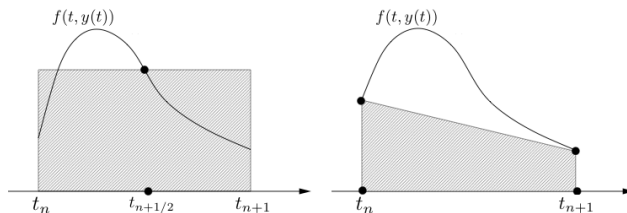
MÉTHODES DE RUNGE-KUTTA

Si on intègre l'équation $y'(t) = f(t, y(t))$ entre t_n et t_{n+1} , on obtient :

$$y(t_{n+1}) - y(t_n) = \int_{t_n}^{t_{n+1}} f(t, y(t)) dt. \quad (24)$$

REMARQUE

Méthodes d'intégration numérique



En utilisant la formule du trapèze, on trouve le schéma implicite suivant, appelé **schéma de Crank-Nicolson ou du trapèze** :

$$u_0 = y(t_0), \quad u_{n+1} - u_n = \frac{h}{2} [f(t_n, u_n) + f(t_{n+1}, u_{n+1})], \quad n = 0, 1, \dots \quad (25)$$

Ce schéma, qui est implicite, est inconditionnellement stable lorsqu'il est appliqué au problème modèle (9).

En modifiant le schéma (25) afin de le rendre explicite, on identifie **la méthode de Heun** :

$$u_{n+1} - u_n = \frac{h}{2} [f(t_n, u_n) + f(t_{n+1}, u_n + hf(t_n, u_n))]. \quad (26)$$

Ces deux méthodes sont d'ordre 2 par rapport à h .

Si on utilise dans (24) la méthode du point milieu, on trouve

$$u_{n+1} - u_n = h f(t_{n+\frac{1}{2}}, u_{n+\frac{1}{2}}).$$

Si maintenant, on approche $u_{n+1/2}$ par

$$u_{n+\frac{1}{2}} = u^n + \frac{h}{2} f(t_n, u_n),$$

on trouve **la méthode d'Euler modifiée** :

$$u_0 = y(t_0), \quad u_{n+1} - u_n = h f\left(t_{n+\frac{1}{2}}, u_n + \frac{h}{2} f(t_n, u_n)\right) \quad n = 0, 1, \dots$$

Les méthodes de Heun et d'Euler modifiée sont des cas particuliers de la famille des méthodes de Runge-Kutta d'ordre 2. Lorsqu'elles sont appliquées au problème modèle (9), on a dans les deux cas la condition de stabilité $h < 2/|\lambda|$.

Il existe d'autres méthodes plus compliquées, comme par exemple **la méthode de Runge-Kutta d'ordre 4** suivante, qui est obtenue en considérant la méthode d'intégration de Simpson :

$$u_n \rightarrow \left\{ \begin{array}{l} u_{n+1} = u_n + \frac{h}{6}(K_1 + 2K_2 + 2K_3 + K_4), \\ \text{avec :} \\ K_1 = f(t_n, u_n), \\ K_2 = f(t_n + \frac{h}{2}, u_n + \frac{h}{2}K_1), \\ K_3 = f(t_n + \frac{h}{2}, u_n + \frac{h}{2}K_2), \\ K_4 = f(t_{n+1}, u_n + hK_3). \end{array} \right.$$

Dans le tableau suivant, on résume les caractéristiques des méthodes qu'on a introduites :

<i>Méthode</i>	<i>Explicite/Implicite</i>	<i>Stabilité</i>	<i>P.r. à h</i>
Euler Progressive	Explicite	Conditionnellement	1
Euler Rétrograde	Implicite	Inconditionnellement	1
Crank–Nicolson	Implicite	Inconditionnellement	2
Heun	Explicite	Conditionnellement	2
Euler Modifiée	Explicite	Conditionnellement	2
Runge–Kutta	Explicite	Conditionnellement	4