# Chapitre 4

Interpolation et approximation

### Problème

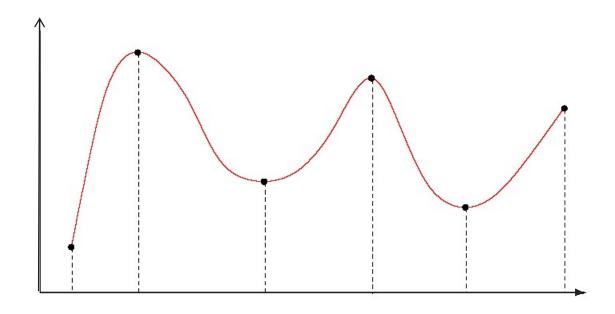
#### Données :

- un ensemble de points connus  $(x_i, Y_i)$ ; ou  $Y_i \in \mathbb{R}^p$ 
  - Obtenus par un ensemble de mesures (relevés terrains)
  - ou bien calculé par l'estimation (x<sub>i</sub>, f(x<sub>i</sub>)) d'une fonction f au points x<sub>i</sub>
- But : déterminer un "modèle" mathématique pour f
  - réduire f en une expression simple (exemple : polynôme)
  - bonnes propriétés : dérivabilité, etc.
- Dans quels cas ?
  - définir un modèle mathématique à partir d'un nombre discret de mesures
  - analyser un phénomène étudié de manière empirique
  - remplacer une équation de courbe "compliquée" par une fonction polynomiale par exemple.

# Interpolation

les x<sub>i</sub>, sont des mesures exactes

On veut que la courbe passe par tous les  $(x_i, f(x_i))$ 



#### On se donne

- une fonction  $f: R \rightarrow R$  inconnue et continue sur un intervalle [a, b].
- un ensemble de points connus  $(x_i, y_i)$ ,  $i \in [0, n]$ .
  - $\{x_0, x_1, \ldots, x_n\}$  est le support de l'interpolation

#### On cherche

une fonction  $\varphi : R \rightarrow R$  telle que  $\varphi (x_i) = f(x_i), i \in [0, n].$ 

• En pratique, $\varphi$ est une somme de fonctions

$$\varphi(x) = \sum_{i=0}^{n} a_i \varphi_i(x)$$

vérifiant

$$f(x_i) = \varphi(x_i) \text{ avec } (x_i) \in \mathbb{R}^n$$
 (1)

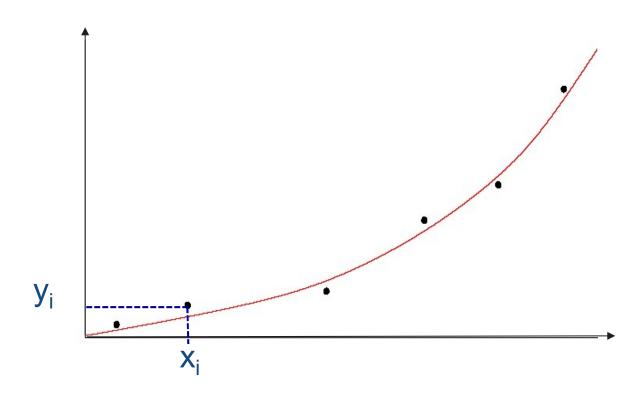
 $\varphi_{j^:}$  fonctions de la base dans laquelle on exprime f ;  $\varphi_{i}$  doit se prêter aux traitements numériques courants.

Problème : déterminer les  $a_i$  pour vérifier (1) et assurer l'unicité de la solution donc de  $a_i$ 

### **Approximation**

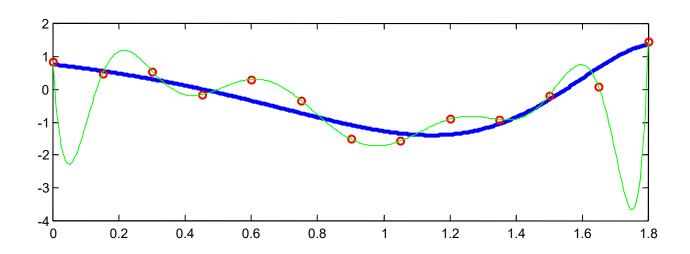
les (x<sub>i</sub>, y<sub>i</sub>) sont des mesures données

Objet de l'étude : déterminer la courbe s'approchant au mieux des points  $(x_i, f(x_i))$ 



### **Approximation**

- En général, on se restreint à une famille de fonctions connues
  - polynômes,
  - exponentielles, logarithme
  - fonctions trigonométriques...



## Quelques méthodes d'interpolation

- Interpolation polynomiale
  - polynômes de degré au plus n
    - polynômes de Lagrange
    - différences finies de Newton
- Interpolation par splines
  - polynômes par morceaux
- Interpolation d'Hermite (ce chapitre ne sera pas traité)
  - informations sur les dérivées de la fonction à approcher

### Théorème de Weierstrass

soit 
$$f$$
 fct continue sur  $[a, b]$ 

Alors, 
$$\forall \varepsilon > 0$$
, il existe un polynôme  $P(x)$ , défini sur  $[a,b]$  tel que :

$$|f(x) - P(x)| < \varepsilon \quad \forall x \in [a, b]$$

plus  $\varepsilon$ , est petit,

plus l'ordre du polynôme est grand

### Interpolation:

n+1 points, n+1 contraintes, n+1 équations, n+1 inconnues: ordre du polynôme n

## Interpolation polynomiale

- Le problème : Solution recherchée
- Données -->  $(x_0, y_0 = f(x_0)), \dots, (x_i, y_i = f(x_i)), \dots, (x_i, y_i = f(x_i))$
- Solution --> P(x) tel que  $P(x_i) = f(x_i)$ , i = 0, n
- mauvaise solution : résoudre le système linéaire

$$P(x) = \sum_{i=0}^{n} a_i x^i$$

la combinaison linéaire de polynômes est un polynôme

### Interpolation polynomiale

la combinaison linéaire de polynômes est un polynôme

$$(x_0, y_0 = f(x_0)), \dots, (x_i, y_i = f(x_i)), \dots, (x_i, y_i = f(x_i))$$
 $P(x) \text{ tel que } P(x_i) = f(x_i), \qquad i = 0, n$ 

→ Idée de Lagrange

$$P(x) = y_0 P_0(x) + \dots + y_i P_i(x) + y_n P_n(x)$$

$$\text{tel que } P_i(x_i) = 1 \quad \text{et } P_i(x_j) = 0 \quad j \neq i$$

$$\text{ainsi } P(x_i) = y_0 P_0(x_i) + \dots + y_i P_i(x_i) + y_n P_n(x_i)$$

$$\downarrow \qquad \qquad \downarrow \qquad \qquad \downarrow$$

$$0 \qquad \qquad 1 \qquad \qquad 0$$

### Méthode de Lagrange pour l'interpolation polynômiale

→ Idée changer de base pour les polynômes

$$L_i(x) = \prod_{\substack{j=0\\j\neq i}}^{n+1} \frac{(x-x_j)}{(x_i-x_j)}$$
$$L(x) = \sum_{i=0}^{n} y_i L_i$$

L est un polynôme d'ordre n

- Théorème
  - Soient n+1 points distincts de coordonnée  $(x_i, y_i)$  avec  $x_i$ ,  $y_i$  réels

il existe un unique polynôme  $p \in P_n$  tel que  $p(x_i) = y_i$  pour i = 0 à n

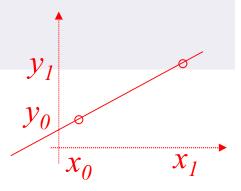
#### Théorème

Soient n+1 points distincts  $x_i$  réels et n+1 réels  $y_i$ , il existe un unique polynôme  $p \in P_n$  tel que  $p(x_i) = y_i$  pour i = 0 à n

#### Idée de démonstration

- Construction de p:
  avec  $L_i$  polynôme de Lagrange  $p(x) = \sum_{i=0}^{n} y_i L_i(x)$
- Propriétés de L<sub>i</sub>
  - $L_i(x_i) = 1$
  - $L_i(x_i) = 0 \quad (j \neq i)$

### Lagrange: degré 1



- Exemple avec n=1
  - on connaît 2 points  $(x_0, y_0)$  et  $(x_1, y_1)$
  - on cherche la droite *y=ax+b* (polynôme de degré 1) qui passe par les 2 points :

$$y_0 = a x_0 + b$$

$$y_1 = a x_1 + b$$

$$a = (y_0 - y_1) / (x_0 - x_1)$$
  
$$b = (x_0 y_1 - x_1 y_0) / (x_0 - x_1)$$

en passant par l'expression de Lagrange

$$y = \frac{y_0 - y_1}{x_0 - x_1} x + \frac{x_0 y_1 - x_1 y_0}{x_0 - x_1}$$

$$y = y_0 \frac{x - x_1}{x_0 - x_1} - y_1 \frac{x - x_0}{x_0 - x_1} = y_0 \underbrace{\left(\frac{x - x_1}{x_0 - x_1}\right)}_{L_0(x)} + y_1 \underbrace{\left(\frac{x - x_0}{x_1 - x_0}\right)}_{L_1(x)}$$

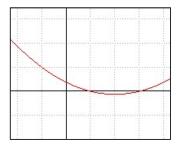
### Lagrange : degré 2

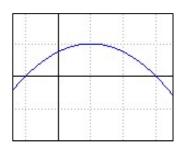
- Exemple avec *n*=2
  - on connaît 3 points (-1,1), (1,4) et (3,16)
  - polynômes de Lagrange associés :
    - → Espace vectoriel : avec {L<sub>i</sub>} base de l'interpolation

$$L_0(x) = \frac{(x-1)(x-3)}{8}$$

$$L_1(x) = \frac{(x+1)(x-3)}{-4} \qquad L_2(x) = \frac{(x+1)(x-1)}{8}$$

$$L_2(x) = \frac{(x+1)(x-1)}{8}$$







### Lagrange : degré 2

calcul du polynôme d'interpolation

points : (-1,1), (1,4) et (3,16)

$$p(x) = l_0(x) + 4l_1(x) + 16l_2(x)$$

$$p(x) = \frac{(x-1)(x-3)}{(-1-1)(-1-3)} + 4\frac{(x+1)(x-3)}{(1-(-1))(1-3)} + 16\frac{(x+1)(x-1)}{(3+1)(3-1)}$$

• en développant, on trouve  $p(x) = \frac{9}{8}x^2 + \frac{3}{2}x + \frac{11}{8}$ 

### Lagrange: Algorithme

Fonction 
$$y = \text{Lagrange } (x, x_i, y_i)$$

pour 
$$i = 1$$
 à  $n$   
pour  $j = 1$  à  $n, j \neq i$   

$$l \leftarrow l * \frac{x - x_i(j)}{x_i(i) - x_i(j)}$$
fin pour  

$$y \leftarrow y + y_i * l$$
fin pour

Donner la complexité de l'algorithme!

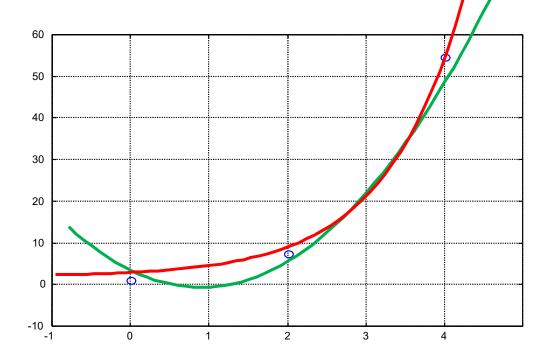
### Lagrange: exemple n°3

• Exemple avec n=2 (fonction à approcher  $y=e^x$ )

on connaît 3 points (0,1), (2,7.3891) et (4,54.5982)

Polynôme d'interpolation

 $p(x) = L_0(x) + 7.3891 L_1(x) + 54.5982 L_2(x)$ 



### Lagrange : estimation de l'erreur d'interpolation

• Erreur d'interpolation e(x) = ||f(x) - p(x)||

#### ☐ Théorème :

- si f est n+1 dérivable sur [a,b],  $\forall x \in [a,b]$ , notons :
  - I le plus petit intervalle fermé contenant x et les  $x_i$
  - $\phi(x) = (x x_0)(x x_1)...(x x_n)$
- alors, il existe  $\xi \in I$  tel que

$$e(x) = \frac{f^{(n+1)}(\xi)}{(n+1)!} \varphi(x)$$

- NB : ξ est dans le voisinage de x
- Utilité = on contrôle l'erreur d'interpolation donc la qualité de l'interpolation (voir exercice fait en TD)

#### Lagrange : choix de n

- Supposons que l'on possède un nb élevé de points pour approcher f ... faut-il tous les utiliser?
  - (calculs lourds)
- Méthode de Neville :
  - on augmente progressivement n
  - on calcule des L<sub>i</sub> de manière récursive
  - on arrête dès que l'erreur est inférieure à un seuil (d'où l'utilité du calcul de l'erreur)

#### La méthode de Neville

Méthode récursive du calcul de la valeur du polynôme d'interpolation en un point donné, il est aisé d'ajouter des points d'interpolation au fur et à mesure.

$$p_{i,0}(x) = y_i, \qquad 0 \leq i \leq n, \ p_{i,j+1}(x) = rac{(x_i - x)p_{i+1,j}(x) + (x - x_{i+j+1})p_{i,j}(x)}{x_i - x_{i+j+1}}, \ 0 \leq i \leq n, \ 1 \leq i \leq n$$

### Algorithme de Neville-Aitken

### Application

$$egin{aligned} p_{0,0}(x) &= y_0 \ & p_{0,1}(x) \ p_{1,0}(x) &= y_1 & p_{0,2}(x) \ & p_{1,1}(x) & p_{0,3}(x) \ p_{2,0}(x) &= y_2 & p_{1,2}(x) & p_{0,4}(x) \ & p_{2,1}(x) & p_{1,3}(x) \ p_{3,0}(x) &= y_3 & p_{2,2}(x) \ & p_{3,1}(x) \ p_{4,0}(x) &= y_4 \end{aligned}$$

$$\left| \begin{array}{c|cccc} x_i & 1 & 2 & 3 & 5 \\ y_i & 1 & 4 & 2 & 5 \end{array} \right|$$

### L'algorithme de Neville

### Fonction $y = \text{Neville}(x, x_i, y_i)$

```
pour i = 1 à n
     Q(i,0) \leftarrow y_i(i)
fin pour
pour i = 1 à n
    Q(i,j) \leftarrow \frac{(x - x_{i}(i - j))Q(i,j - 1) - (x - x_{i}(i))Q(i - 1,j - 1)}{x_{i}(i) - x_{i}(i - j)}
     fin pour
     y \leftarrow Q(n,n)
fin pour
```

Vérifier : complexité du calcul : n<sup>2</sup>

### Méthode de Newton pour l'interpolation polynomiale :

- ☐ Polynômes de Newton :
  - base =  $\{1, (x-x_0), (x-x_0)(x-x_1), ..., (x-x_0)(x-x_1)...(x-x_{n-1})\}$
  - on peut ré-écrire p(x):

$$p(x)=a_0 + a_1(x-x_0) + a_2(x-x_0)(x-x_1)+...+ a_n(x-x_0)(x-x_1)...(x-x_{n-1})$$

• calcul des  $a_k$ : méthode des différences divisées

#### Newton: différences divisées

#### Définition :

Soit une fonction f dont on connaît les valeurs en des points distincts a, b, c, ...

On appelle différence divisée d'ordre 0, 1, 2,...,n les expressions définies par récurrence sur l'ordre k:

- $\checkmark$  k=0 f[a] = f(a)
- $\checkmark$  k=1 f[a,b] = (f[b] f[a]) / (b a)
- $\checkmark$  k=2 f [a,b,c] = (f [a,c] f [a,b])/(c-b)

•••

 $\checkmark f [X,a,b] = (f [X,b] - f [X,a]) / (b - a)$   $a \not\in X, b \not\in X, a \neq b$ 

### Newton: différences divisées

O Détermination des coefficients de p(x) dans la base de Newton :

#### **Théorèmes**

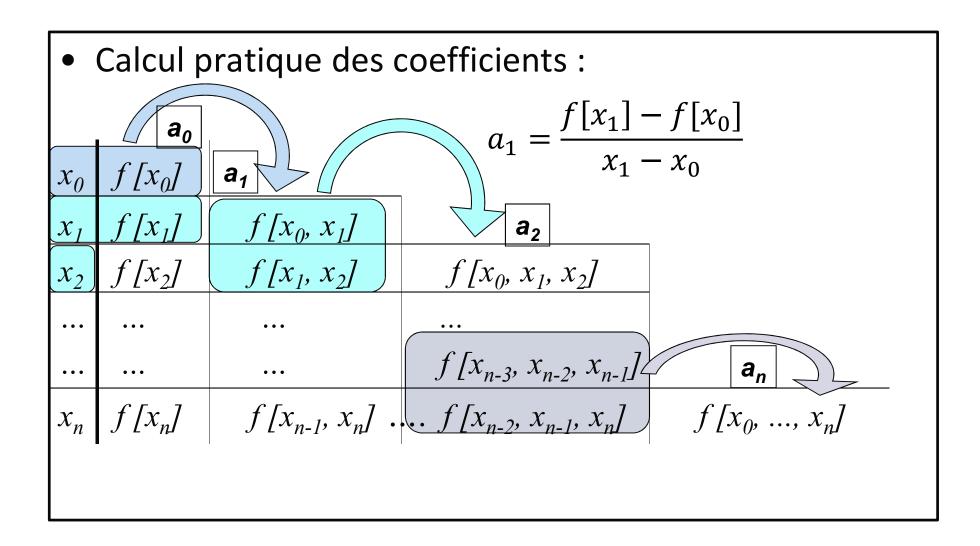
calcul des coeficients de newton

$$a_k = f[x_0, x_1, ..., x_k]$$
 avec  $k = 0 ... n$ 

Calcul de l'erreur d'interpolation

$$e(x) = f[x_0, x_1, ..., x_n, x] \phi(x)$$

#### Newton : différences divisées



### Newton: exemple

• Retour sur l'exercice : *n*=2 avec (-1,1), (1,4) et (3,16)

(p(x) = 
$$1 + \frac{3}{2}(x+1) + \frac{9}{8}(x+1)(x-1)$$
  
et on retombe sur p(x) =  $\frac{9}{8}x^2 + \frac{3}{2}x + \frac{11}{8}$ 

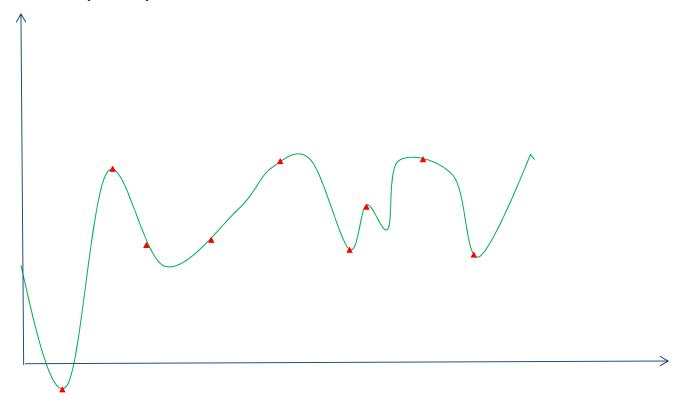
### Newton: l'algorithme

```
Fonction a = \text{Newton}(x_i, y_i)
                 pour i = 1 jusqu'à n
                       F(i,0) \leftarrow y_i(i)
                 fait
                 pour i = 1 jusqu'à n
                       pour j = 1 jusqu'à i
                          F(i,j) \leftarrow \frac{F(i,j-1) - F(i-1,j-1)}{x_i(i) - x_i(i-j)}
                      fait
                 fait
                 pour i = 1 jusqu'à n
                      a(i) \leftarrow F(n,i)
                 fait
```

Vérifier que la complexité est de : n<sup>2</sup>

### Si le nombre de points est élevé

- entre les points, le polynôme fait ce qu'il veut !!!
   et plus son degré est élevé plus il est susceptible d'osciller !
- en dehors de l'intervalle des points d'interpolation la fonction tend vers  $(\pm \infty)$



### Interpolation par splines cubiques

### Principe:

- on approche la courbe par morceaux (localement)
- on prend des polynômes de degré faible (3) pour éviter les oscillations

#### Comment

- on décompose l'espace de définition (des points) en un ensemble contigu d'intervalles sur lesquels on applique des interpolations polynômiales de degré 3
- Résultat un ensemble de polynômes définis de façon continue et « lisse »

### Splines cubiques : définition

### Définition :

- On appelle spline cubique (d'interpolation) une fonction notée g, qui vérifie les propriétés suivantes :
  - ▶  $g \in C^2[a;b]$  (g est deux fois continûment dérivable),
  - ▶ g coïncide sur chaque intervalle  $[x_i; x_{i+1}]$  avec un polynôme de degré inférieur ou égal à 3,

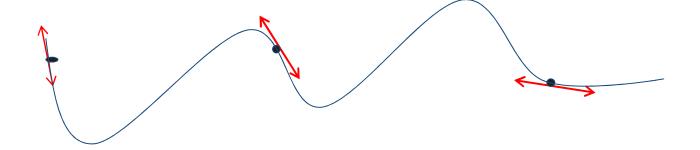
### Splines cubiques : définition

- Remarque (voir plus loin):
  - Il faut des conditions supplémentaires pour définir la spline d'interpolation de façon unique
  - Ex. de conditions supplémentaires : conditions aux limites
    - ▶ g''(a) = g''(b) = 0 spline naturelle.

#### • Remarques :

- Sur le plan pratique, ces conditions permettent d'avoir une courbe continue et d'aspect lisse;
- o Forme ≡ forme d'une barre souple soumise à des contraintes physiques
- Sur le plan technique, cela permet de poser les équations qui permettent d'obtenir l'expression mathématique de la fonction.

### Splines: illustration



#### Fonction formée par 2 morceaux de polynôme

$$P_{1}(x) = \alpha_{1}x^{3} + \beta_{1}x^{2} + \chi_{1}x + \delta_{1}$$

$$= a_{1}(x-x_{1})^{3} + b_{1}(x-x_{1})^{2} + c_{1}(x-x_{1}) + d_{1}$$

$$P_2(x)=a_2(x-x_2)^3+b_2(x-x_2)^2+c_2(x-x_2)+d_2$$

- Déterminer la spline d'interpolation
  - g coïncide sur chaque intervalle  $[x_i; x_{i+1}]$  avec un polynôme de degré inférieur ou égal à 3
  - g" est de degré 1 et est déterminé par 2 valeurs:
    - ightharpoonup mi = g''(xi) et mi+1 = g''(xi+1) (moment au noeud n°i)
  - Notations :
    - $h_i = x_{i+1} x_i$  pour i = 0 ... n-1

    - $ightharpoonup g_i(x)$  le polynôme de degré 3 qui coïncide avec g sur l'intervalle  $\delta_i$

 $g''_{i}(x)$  est linéaire : on peut l'estimer par la méthode de Lagrange

$$\forall X \in \delta_i \qquad g_i''(x) = m_{i+1} \frac{x - x_i}{h_i} + m_i \frac{x_{i+1} - x}{h_i}$$

▶ Pour  $g_i'(x)$  on intègre :  $g_i''(x)$ 

$$g'_i(x) = m_{i+1} \frac{(x - x_i)^2}{2h_i} - m_i \frac{(x_{i+1} - x)^2}{2h_i} + a_i$$

 $(a_i \text{ constante d'intégration})$ 

• Pour calculer  $g_i(x)$ , on intègre  $g'_i(x)$ 

$$g_i(x) = m_{i+1} \frac{(x - x_i)^3}{6h_i} + m_i \frac{(x_{i+1} - x)^3}{6h_i} + a_i(x - x_i) + b_i$$

(b<sub>i</sub> constante d'intégration)

• 
$$g_i(x_i) = y_i \longrightarrow y_i = \frac{m_i h_i^2}{6} + b_i$$
 1

• 
$$gi(xi+1) = yi+1 \longrightarrow y_{i+1} = \frac{m_{i+1}h_i^2}{6} + a_ih_i + b_i$$
 2

• g'(x) est continue : 
$$g'_i(x_i) = -m_i \frac{h_i}{2} + a_i = m_i \frac{h_{i-1}}{2} + a_{i-1} = g'_{i-1}(x_i)$$
 3

• 1 et 2 
$$a_i = \frac{1}{h_i}(y_{i+1} - y_i) - \frac{h_i}{6}(m_{i+1} - m_i)$$

• on remplace les ai dans : (3)

$$h_{i-1}m_{i-1} + 2(h_i + h_{i-1})m_i + h_i m_{i+1} = 6\left(\frac{1}{h_i}(y_{i+1} - y_i) - \frac{1}{h_{i-1}}(y_i - y_{i-1})\right)$$

- Rappel: on cherche les  $m_i$  (n+1 inconnues)
  - ▶ on a seulement (n-1) équations grâce aux données
  - ▶ Pour obtenir une solution unique il manques 2 équations :
  - ▶ il faut rajouter 2 conditions → par exemple condition aux limites
    - $m_0 = m_n = 0$  (appelée : spline naturelle)

### Splines cubiques : calcul des coefficients

$$h_{i-1}m_{i-1} + 2(h_i + h_{i-1})m_i + h_i m_{i+1} = 6\left(\frac{1}{h_i}(y_{i+1} - y_i) - \frac{1}{h_{i-1}}(y_i - y_{i-1})\right)$$

- Ex de résolution avec  $h_i = x_{i+1} x_i$  ( $h_i$  constant):  $m_{i-1} + 4m_i + m_{i+1} = \frac{1}{h^2}(y_{i-1} 2y_i + y_{i+1}) = f_i$ 
  - Forme matricielle

$$T * M = f = \begin{pmatrix} 4 & 1 & & & :0 \\ 1 & 4 & 1 & & \\ & \ddots & \ddots & \ddots & \\ & & 1 & 4 & 1 \\ & & & 1 & 4 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} m_1 \\ \cdots \\ m_{n-1} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} f_1 \\ \cdots \\ f_{n-1} \end{pmatrix}$$

► T matrice inversible, tridiagonale, à diagonale strictement dominante, système facile à résoudre.

### Splines cubiques: algorithme

pour 
$$i = 2; n - 1$$

$$T(i,i) \leftarrow 2(h_i + h_{i-1})$$

$$T(i,i-1) \leftarrow h_{i-1}$$

$$T(i,i+1) \leftarrow 2h_i$$

$$T(i, i-1) \leftarrow h_{i-1}$$

$$T(i, i+1) \leftarrow 2h_i$$

$$f(i-1) \leftarrow 6\left(\frac{y_{i+1} - y_i}{h_i} - \frac{y_i - y_{i-1}}{h_{i-1}}\right)$$

fin pour

$$T \leftarrow T(2: n-1, 2: n-1)$$

$$m \leftarrow T/f$$

$$m \leftarrow [0, m, 0]$$

pour 
$$i = 1; n - 1$$

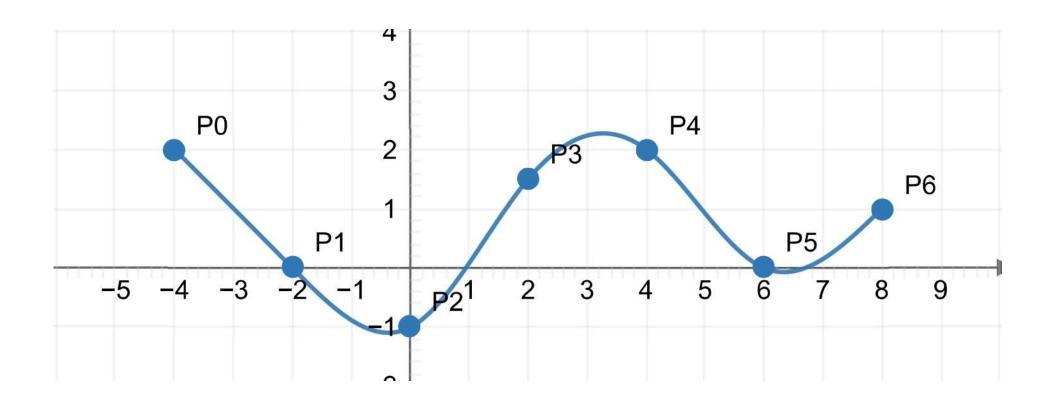
$$\begin{array}{c}
a(i) \\
\leftarrow \frac{1}{h_i}(y_{i+1} - y_i) - \frac{h_i}{6}(m_{i+1} - m_i) \\
b(i) \leftarrow y(i) - \frac{m_i h_i}{6}
\end{array}$$

$$b(i) \leftarrow y(i) - \frac{m_i h_i}{6}$$

fin pour

## Splines cubiques : exemple

• Ex : avec 7 points → spline cubique d'interpolation



### Splines cubiques : exemple

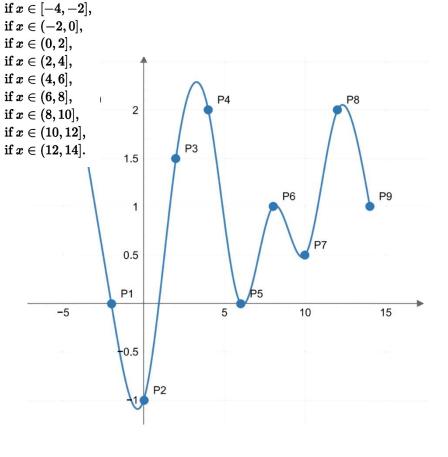
### • Ex : avec 9 points → spline cubique d'interpolation

#### **Points**

 $P_0(-4|2); P_1(-2|0); P_2(0|-1); P_3(2|1.5); P_4(4|2); P_5(6|0); P_6(8|1); P_7(10|0.5); P_8(12|2); P_9(14|1); P_9(14|1)$ 

#### Equation

$$f(x) = \begin{cases} -4.9636 \cdot 10^{-4} \cdot x^3 + -5.9563 \cdot 10^{-3} \cdot x^2 + -1.0218 \cdot x + -2.0238, \\ 1.2748 \cdot 10^{-1} \cdot x^3 + 7.6191 \cdot 10^{-1} \cdot x^2 + 5.1390 \cdot 10^{-1} \cdot x + -1.0000, \\ -1.9693 \cdot 10^{-1} \cdot x^3 + 7.6191 \cdot 10^{-1} \cdot x^2 + 5.1390 \cdot 10^{-1} \cdot x + -1.0000, \\ -2.7258 \cdot 10^{-2} \cdot x^3 + -2.5612 \cdot 10^{-1} \cdot x^2 + 2.5500 \cdot x + -2.3574, \\ 2.4346 \cdot 10^{-1} \cdot x^3 + -3.5048 \cdot x^2 + 1.5545 \cdot 10^1 \cdot x + -1.9684 \cdot 10^1, \\ -2.5910 \cdot 10^{-1} \cdot x^3 + 5.5413 \cdot x^2 + -3.8732 \cdot 10^1 \cdot x + 8.8870 \cdot 10^1, \\ 2.3043 \cdot 10^{-1} \cdot x^3 + -6.2073 \cdot x^2 + 5.5257 \cdot 10^1 \cdot x + -1.6177 \cdot 10^2, \\ -2.2511 \cdot 10^{-1} \cdot x^3 + 7.4589 \cdot x^2 + -8.1405 \cdot 10^1 \cdot x + 2.9377 \cdot 10^2, \\ 1.0752 \cdot 10^{-1} \cdot x^3 + -4.5159 \cdot x^2 + 6.2293 \cdot 10^1 \cdot x + -2.8102 \cdot 10^2, \end{cases}$$



#### Conclusion

- Interpolation polynomiale
  - évaluer la fonction en un point : Polynôme de Lagrange -> méthode de Neville
  - *compiler* la fonction : Polynôme de Newton
- Interpolation polynomiale par morceau : splines
  - spline cubique d'interpolation : passage par les nœuds (points d'interpolation), mais on limite les oscillations.
  - spline cubique d'approximation : on régule mieux la fonction, mais minimise la distance aux nœuds (les points de passage)