

Calcul différentiel et intégral II

R. Petit

année académique 2016 - 2017

Table des matières

1	Suites et séries de fonctions	1
1.1	Rappels	1
1.1.1	Topologie métrique	1
1.1.1.1	Espaces métriques	1
1.1.1.2	Espaces vectoriels	2
1.1.1.3	Ouverts, fermés, compacts	3
1.1.1.4	Suites de Cauchy	4
1.1.1.5	Continuité	4
1.2	Convergence de suites de fonctions	5
1.2.1	Convergence simple	5
1.2.2	Convergence uniforme	6
1.2.3	L'espace $B(X, E)$	7
1.2.4	Convergence uniforme sur tout compact	8
1.3	Suites de fonctions et opérations d'intégration et de dérivation	9
1.3.1	Passage à la limite dans une intégrale de Riemann	9
1.3.2	Passage à la limite dans une dérivation ordinaire ou partielle	10
1.4	Séries de fonctions	13
1.4.1	Retranscription des résultats sur les suites	13
1.4.2	Convergence normale	14
1.4.3	Transformation d'Abel	15
1.4.4	Exemple d'une fonction continue sur \mathbb{R} nulle part dérivable	16
1.5	Séries de puissances	17
1.5.1	Théorie du rayon	17
1.5.2	Étude sur le cercle de convergence	19
1.5.3	Fonctions réelles analytiques	21
2	Intégration	24
2.1	Intégrales absolument convergentes	24
2.1.1	Rappels concernant l'intégrale de Riemann	24
2.1.2	Fonctions absolument intégrables sur un intervalle	25
2.1.3	Fonctions absolument intégrables vues comme fonction des bornes	27
2.1.4	Critères d'intégration absolue	29
2.1.5	Fonctions de référence de Riemann	30
2.1.6	Théorème du changement de variable	31
2.2	Intégrales convergentes	32
2.2.1	Définitions et exemples	32
2.2.2	Rappel : deuxième formule de la moyenne	33
2.2.3	Critère d'Abel	35

3	Intégrales à paramètres	37
3.1	Fonctions définies par une intégrale sur un segment fixe	37
3.1.1	Un résultat de continuité	37
3.1.2	Un résultat de dérivabilité	38
3.2	Fonction définies par des intégrales sur un segment variable	39
3.2.1	Un résultat de continuité	39
3.2.2	Un résultat de dérivabilité	40
3.3	Fonctions définies par des intégrales convergentes	41
3.3.1	Exemple	41
3.3.2	Notion d'intégrales uniformément convergentes	41
3.3.3	Théorème de Fubini	43
3.3.4	Critères de convergence uniforme d'intégrales	44

Chapitre 1

Suites et séries de fonctions

1.1 Rappels

1.1.1 Topologie métrique

1.1.1.1 Espaces métriques

Définition 1.1. Soit X un ensemble. Une *distance* sur X est une application $d : X \times X \rightarrow \mathbb{R}^+$ telle que :

1. $\forall x, y \in X : d(x, y) = d(y, x)$ (symétrie) ;
2. $\forall x, y, z \in X : d(x, z) \leq d(x, y) + d(y, z)$ (inégalité triangulaire) ;
3. $\forall x, y \in X : (d(x, y) = 0 \iff x = y)$ (séparation¹).

Définition 1.2. On appelle *espace métrique* (X, d) un espace X muni d'une distance d sur X .

Définition 1.3. Soient (X, d) un espace métrique, $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ et $x \in X$. La suite (x_n) converge vers x dans (X, d) lorsque :

$$\forall \varepsilon > 0 : \exists N \in \mathbb{N} \text{ t.q. } \forall n \geq N : d(x_n, x) < \varepsilon.$$

Cela se note :

$$x_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{d} x.$$

Proposition 1.4. Soit $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ une suite dans (X, d) , un espace métrique. Soient $x, y \in X$. Si :

$$x_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{d} x \quad \text{et} \quad x_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{d} y,$$

alors $x = y$.

Démonstration. Soit $\varepsilon > 0$. Puisque $x_n \rightarrow x$ et $x_n \rightarrow y$, on sait qu'il existe $N_1, N_2 \in \mathbb{N}$ tels que :

$$\forall n \geq N_1 : d(x_n, x) < \frac{\varepsilon}{2} \quad \text{et} \quad \forall n \geq N_2 : d(x_n, y) < \frac{\varepsilon}{2}.$$

Dès lors, soit $N := \max\{N_1, N_2\}$. On peut dire :

$$\forall n \geq N : d(x, y) \leq d(x, x_n) + d(x_n, y) < \frac{\varepsilon}{2} + \frac{\varepsilon}{2} = \varepsilon.$$

1. Également appelé *principe d'identité des indiscernables*.

On en déduit $d(x, y) = 0$ et donc $x = y$ par séparation. \square

1.1.1.2 Espaces vectoriels

Définition 1.5. Soit \mathbb{K} , un sous-corps de \mathbb{C} . On appelle *norme* sur le \mathbb{K} -e.v. E toute application $n : E \rightarrow \mathbb{R}^+$ telle que :

1. $\forall x \in E : (n(x) = 0 \iff x = 0)$;
2. $\forall x \in E : \forall \lambda \in \mathbb{K} : n(\lambda x) = |\lambda| n(x)$;
3. $\forall x, y \in E : n(x + y) \leq n(x) + n(y)$.

Proposition 1.6. Soit (E, n) un \mathbb{K} -espace vectoriel normé. L'application d suivante est une distance sur E (on l'appelle la distance associée à la norme n) :

$$d : E \times E \rightarrow \mathbb{R}^+ : (x, y) \mapsto n(y - x).$$

Démonstration. EXERCICE. \square

Remarque. Si (E, n) est un espace vectoriel normé, $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est une suite de E , et si $x \in E$, alors on dit :

$$x_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{n} x$$

lorsque :

$$x_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{} x$$

au sens de la distance associée à la norme n .

Exemple 1.1. \mathbb{R} est un \mathbb{R} -e.v. normé avec pour norme $n : x \mapsto |x|$.

Exemple 1.2. Soient $d \in \mathbb{N}^*$, $p \in [1, +\infty)$. Pour $x = (x_i)_{1 \leq i \leq d} \in \mathbb{C}^d$, on définit :

$$n(x) = \|x\|_p := \left(\sum_{k=0}^d |x_i|^p \right)^{\frac{1}{p}}.$$

On a alors (\mathbb{C}^d, n) est un \mathbb{C} -espace vectoriel normé. Également (\mathbb{C}^d, n) et (\mathbb{R}^d, n) sont des \mathbb{R} -espaces vectoriels normés.

Définition 1.7. Soit $x \in \mathbb{C}^d$. On définit la *norme infinie* de x dans \mathbb{C}^d par :

$$\|x\|_\infty := \max_{1 \leq i \leq d} |x_i|.$$

Exemple 1.3. Soit $d \in \mathbb{N}^*$. $(\mathbb{C}^d, \|\cdot\|_\infty)$ est un \mathbb{C} -espace vectoriel normé. Également, $(\mathbb{R}^d, \|\cdot\|_\infty)$ et $(\mathbb{C}^d, \|\cdot\|_\infty)$ sont des \mathbb{R} -espaces vectoriels normés.

Démonstration. EXERCICE. \square

Définition 1.8. Soit $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ une suite. On dit que la suite (x_n) est *presque nulle* s'il existe $N \in \mathbb{N}$ tel que $\forall n \geq N : x_n = 0$.

Exemple 1.4. Soient $P \in \mathbb{C}[x]$ et $(a_k)_{k \in \mathbb{N}}$ la suite presque nulle des coefficients de P . On pose :

$$\|P\|_\infty := \sup_{k \in \mathbb{N}} |a_k| = \max_{k \in \mathbb{N}} |a_k|.$$

Alors $\|\cdot\|_\infty$ est une norme sur $\mathbb{C}[x]$.

Démonstration. EXERCICE. \square

1.1.1.3 Ouverts, fermés, compacts

Définition 1.9. Soit (X, d) un espace métrique. On appelle *boule ouverte* de centre $x \in X$ et de rayon $r \geq 0$ l'ensemble :

$$B(x, r[:= \{y \in X \text{ t.q. } d(x, y) < r\}.$$

On définit également la *boule fermée* de centre x et de rayon r l'ensemble :

$$B(x, r] := \{y \in X \text{ t.q. } d(x, y) \leq r\}.$$

Définition 1.10. Soit (X, d) un espace métrique et soit $O \subset X$. On dit que O est une partie *ouvert* dans X lorsque :

$$\forall x \in O : \exists r \geq 0 \text{ t.q. } B(x, r) \subset O.$$

Remarque. Pour tout X , les ensembles \emptyset et X sont tous deux des ouverts de X .

Définition 1.11. Soit (X, d) un espace métrique. Une partie $F \subset X$ de X est dite *fermée* dans X lorsque $X \setminus F$ est ouvert.

Proposition 1.12. Dans un espace métrique (X, d) , soit $(O_i)_{i \in I}$ une famille d'ouverts de X indicés par un ensemble $I \neq \emptyset$. Alors $(\bigcup_{i \in I} O_i)$ est un ouvert de X . Si de plus I est fini, alors $(\bigcap_{i \in I} O_i)$ est un ouvert de X .

Exemple 1.5. Prenons $X = \mathbb{R}$ et $O_i = (-1 - \frac{1}{i}, 1 + \frac{1}{i})$. Alors $(\bigcap_{i \in \mathbb{N}^*} O_i) = [-1, 1]$ qui n'est pas un ouvert de X .

Démonstration. EXERCICE. □

Définition 1.13 (Compacts par Borel-Lebesgue). Soit (X, d) un espace métrique. Une partie $K \subset X$ est dite *compacte* si $K \neq \emptyset$ et si, de tout recouvrement de K par des ouverts de X , on peut extraire un sous-recouvrement fini.

C'est-à-dire lorsque :

1. $K \neq \emptyset$;
2. $\forall I \neq \emptyset : \forall (O_i)_{i \in I}$ ouverts de X t.q. $K \subset (\bigcup_{i \in I} O_i) : \exists J \subset I$ fini t.q. $K \subset (\bigcup_{j \in J} O_j)$.

Proposition 1.14 (Compacts par Bolzano-Weierstrass). Soit (X, d) un espace métrique. Une partie K de X est compacte si et seulement si :

1. $K \neq \emptyset$;
2. de toute suite de points de K , on peut extraire une sous-suite convergente dans K .

Démonstration. Admis. □

Exemple 1.6. L'ensemble $[0, 1]$ est un compact de \mathbb{R} .

Proposition 1.15. Soit (X, d) , un espace métrique et $K \subset X$, une partie compacte. Alors K est fermé et borné.

Démonstration. EXERCICE. (Absurde) □

Proposition 1.16. Soit (E, n) un \mathbb{K} -e.v. normé de dimension finie. Alors les parties compactes de E sont les parties fermées bornées non nulles.

Démonstration. Admis. □

1.1.1.4 Suites de Cauchy

Définition 1.17. Soit (X, d) , un espace métrique. On dit que $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est de Cauchy dans X lorsque :

$$\forall \varepsilon > 0 : \exists N \in \mathbb{N} \text{ t.q. } \forall m, n \geq N : d(x_n, x_m) < \varepsilon.$$

Proposition 1.18. Si $(x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est convergente dans l'espace métrique (X, d) , alors elle est de Cauchy.

Démonstration. Si x est la limite de la suite (x_n) , on pose $\varepsilon > 0$. Il existe $N \in \mathbb{N}$ tel que :

$$\forall n \geq N : d(x, x_n) < \frac{\varepsilon}{2}.$$

Donc $\forall m, n \geq N : d(x_m, x_n) \leq d(x_m, x) + d(x, x_n) < \varepsilon$. □

Définition 1.19. Un espace métrique (M, d) est dit *complet* quand toute suite de Cauchy de points de X converge dans X .

Définition 1.20. Un espace vectoriel E est dit *de Banach* lorsque toute suite de Cauchy de vecteurs de E converge dans E .

Remarque. On remarque que dans un espace métrique complet, une suite converge si et seulement si elle est de Cauchy (ce qui est entre autres le cas de \mathbb{R}).

De plus, les suites de Cauchy permettent, dans des espaces complets, de montrer que des suites convergent sans connaître leur limite.

Exemple 1.7. Les espaces métriques $(\mathbb{R}, |\cdot|)$ et $(\mathbb{C}, |\cdot|)$ sont des espaces de Banach. Et pour tout $p \in [1, +\infty)$ et $q \in \mathbb{N}$, les espaces métriques $(\mathbb{R}^q, \|\cdot\|_p)$ et $(\mathbb{C}^q, \|\cdot\|_p)$ sont des espaces de Banach.

1.1.1.5 Continuité

Définition 1.21. Soient (X, d_X) et (Y, d_Y) deux espaces métriques. Une application $f : X \rightarrow Y$ est dite continue en $x_0 \in X$ lorsque :

$$\forall \varepsilon > 0 : \exists \delta \geq 0 \text{ t.q. } \forall x \in X : (d_X(x, x_0) < \delta \Rightarrow d_Y(f(x), f(x_0)) < \varepsilon).$$

On dit que f est continue sur $A \subset X$ lorsque f est continue en tout $a \in A$.

Proposition 1.22. Une fonction $f : (X, d) \rightarrow (Y, d)$ est continue sur X lorsque l'image réciproque par f de (Y, d) est un ouvert de (X, d) .

Démonstration. Admis. □

Proposition 1.23. Une fonction $f : (X, d) \rightarrow (Y, d)$ est continue en $x_0 \in X$ si et seulement si l'image par f de toute suite de points de X convergente en x_0 est une suite convergente en $f(x_0)$.

Démonstration. Admis. □

Définition 1.24. Soit $f : (X, d) \rightarrow (Y, d)$. f est dite *lipschitzienne* de constante $K \geq 0$ lorsque

$$\forall (x, y) \in X^2 : d(f(x), f(y)) \leq K d(x, y).$$

Proposition 1.25. Si $f : (X, d) \rightarrow (Y, d)$ est lipschitzienne, alors elle est continue sur X .

Démonstration. EXERCICE. □

Définition 1.26. Soit $(a_k)_{k \in \mathbb{N}}$, une suite dans un espace métrique (X, d) . On dit que (a_k) est *presque nulle* lorsqu'il existe $N \in \mathbb{N}$ tel que $\forall n \geq N : a_n = 0$.

Exemple 1.8.

- Pour tout $i \in \mathbb{N}$, l'application $c_i : \mathbb{C}[x] \rightarrow \mathbb{C} : P = \sum_{k=0}^{+\infty} a_k x^k \mapsto a_i$ est continue de $(\mathbb{C}[x], \|\cdot\|_\infty)$ dans $(\mathbb{C}, |\cdot|)$. En effet, pour $i \in \mathbb{N}$, $P = \sum_{k=0}^{+\infty} a_k x^k$, et $Q = \sum_{k=0}^{+\infty} b_k x^k$, on a :

$$|c_i(P) - c_i(Q)| = |a_i - b_i| \leq \|P - Q\|_\infty = \max_{k \in \mathbb{N}} |a_k - b_k|.$$

On en déduit que c_i est lipschitzienne sur $\mathbb{C}[x]$ et donc continue sur $\mathbb{C}[x]$.

- Soit $n \in \mathbb{N}$. Posons :

$$P_n = \sum_{k=0}^n \frac{1}{k!} x^k \in \mathbb{C}[x].$$

On observe que $(P_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est de Cauchy dans $(\mathbb{C}[x], \|\cdot\|_\infty)$ car :

$$\|P_n - P_m\|_\infty = \left\| \sum_{k=0}^n \frac{1}{k!} x^k - \sum_{k=0}^m \frac{1}{k!} x^k \right\|_\infty.$$

On a alors :

$$\|P_n - P_m\|_\infty = \left\| \sum_{k=\min\{m,n\}+1}^{\max\{m,n\}} \frac{1}{k!} x^k \right\|_\infty = \max_{\min\{m,n\}+1 \leq k \leq \max\{m,n\}} \frac{1}{k!} = \frac{1}{(\min\{m,n\} + 1)!}.$$

Montrons que $(P_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est de Cauchy. Supposons (par l'absurde) que $(P_n)_{n \in \mathbb{N}}$ converge vers $P \in (\mathbb{C}[x], \|\cdot\|_\infty)$. Notons $(a_k) \subset \mathbb{C}$, la suite presque nulle des coefficients de P . Pour $i \in \mathbb{N}$, on a $c_i(P) = \frac{1}{i!}$ quand $n \geq i$. Or par la propriété de Lipschitz, on sait que $c_i(P_n) \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} c_i(P) = a_i$. Or (a_k) est presque nulle et $a_i = \frac{1}{i!}$. Il y a donc contradiction. Donc (P_n) ne converge pas dans $(\mathbb{C}[x], \|\cdot\|_\infty)$. Dès lors, $(\mathbb{C}[x], \|\cdot\|_\infty)$ n'est pas complet.

1.2 Convergence de suites de fonctions

1.2.1 Convergence simple²

Définition 1.27. Soit X un ensemble et (Y, d) un espace métrique. On dit que la suite $(f_n(x))_{n \in \mathbb{N}}$ où $f_n : X \rightarrow (Y, d)$ converge simplement sur X lorsque :

$$\forall x \in X : (f_n(x))_{n \in \mathbb{N}} \text{ converge dans } (Y, d).$$

Définition 1.28. Dans ce cas, la suite a pour limite simple la fonction :

$$f : X \rightarrow (Y, d) : x \mapsto \lim_{n \rightarrow +\infty} f_n(x)$$

et est bien définie. Cela se note :

$$f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVS}} f \quad \text{ou} \quad f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVS sur } X} f.$$

Exemple 1.9. Soient $X = [0, 1]$ et $Y = \mathbb{R}$. On pose $f_n(x) = x^n$ pour tout $n \in \mathbb{N}$.

- Si $x \in [0, 1)$, alors la suite $(f_n(x))_{n \in \mathbb{N}}$ est une suite géométrique de raison x avec $|x| < 1$ donc la suite converge vers 0 ;

2. La convergence simple est la notion de convergence « minimale » que l'on va exiger. Il existe des convergences encore plus élémentaires (voir théorie de l'intégration de Lebesgue), mais qui se trouvent en dehors des objectifs du cours.

- si $x = 1$, alors $f_n(x) = 1$ pour tout $n \in \mathbb{N}$. Donc la suite $(f_n(x))_{n \in \mathbb{N}}$ converge simplement sur $[0, 1]$ vers la fonction :

$$f : [0, 1] \rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \begin{cases} 0 & \text{si } x < 1 \\ 1 & \text{si } x = 1 \end{cases}.$$

Remarque.

- On a « perdu » la continuité des fonctions f_n par passage à la limite ;
- ici, la convergence simple peut s'écrire ainsi, à l'aide de quantificateurs :

$$\forall \varepsilon > 0 : \forall x \in X : \exists N \in \mathbb{N} \text{ t.q. } \forall n \geq N : d(f_n(x), f(x)) < \varepsilon.$$

On remarque donc que N dépend de x (ordre des quantificateurs).

1.2.2 Convergence uniforme

Définition 1.29. Soient X un ensemble, (Y, d) un espace métrique, et $f_n : X \rightarrow (Y, d)$. On dit que (f_n) converge uniformément sur X vers $f : X \rightarrow (Y, d)$ lorsque :

$$\forall \varepsilon > 0 : \exists N \in \mathbb{N} \text{ t.q. } \forall n \geq N : \forall x \in X : d(f_n(x), f(x)) < \varepsilon.$$

Cela se note :

$$f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVU sur } X} f.$$

Remarque. La définition est très proche de la convergence simple. La différence étant que pour une convergence uniforme, il faut que $N \in \mathbb{N}$ ne dépende pas de la valeur de x .

Proposition 1.30. Soient X un ensemble, (Y, d) un espace métrique, $(f_n(x))_{n \in \mathbb{N}}$ une suite de fonctions de X dans (Y, d) et $f : X \rightarrow (Y, d)$. Si (f_n) converge uniformément sur X vers f , alors (f_n) converge simplement sur X vers f .

Démonstration. EXERCICE. □

Exemple 1.10. Prenons $X = \mathbb{R} = Y$ et pour tout $n \geq 1$, définissons $f_n(x) = \sqrt{x^2 + \frac{1}{n}}$. Fixons $x \in \mathbb{R}$. On trouve alors :

$$(f_n(x))_{n \in \mathbb{N}} = \left(\sqrt{x^2 + \frac{1}{n}} \right)_{n \in \mathbb{N}} \rightarrow \sqrt{x^2} = |x|.$$

Donc :

$$f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVS sur } X} |\cdot|.$$

Théorème 1.31. Soient (X, d) , (Y, d) deux espaces métriques. Soient $f_n : X \rightarrow Y$, $a \in X$. On suppose :

- $\exists f$ t.q. $f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVU sur } X} f$;
- $\forall n \in \mathbb{N} : f_n$ est continue en a .

Alors f est continue en a .

Démonstration. Soit $\varepsilon > 0$. Par convergence uniforme des f_n , on sait :

$$\exists N \in \mathbb{N} \text{ t.q. } \forall n \geq N : \forall x \in X : d(f_n(x), f(x)) < \frac{\varepsilon}{3}.$$

De plus, la fonction f_N est continue en a par hypothèse. Dès lors, on sait qu'il existe δ tel que :

$$\forall x \in X : d(x, a) < \delta \Rightarrow d(f_N(x), f_N(a)) < \frac{\varepsilon}{3}.$$

Ainsi, prenons $x \in X$ tel que $d(x, a) < \delta$. On a alors :

$$d(f(x), f(a)) \leq d(f(x), f_N(x)) + d(f_N(x), f(a)) \leq d(f(x), f_N(x)) + d(f_N(x), f_N(a)) + d(f_N(a), f(a)) \leq 3 \frac{\varepsilon}{3} = \varepsilon.$$

□

Corollaire 1.32. Si $f_n \in C^0(X, Y)$ et $f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{CVU \text{ sur } X}$, alors $f \in C^0(X, Y)$.

Démonstration. Les fonctions f_n sont continues en tout point et $f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{CVU \text{ sur } X}$ par hypothèse. Dès lors, pour tout point $a \in X$, par le théorème précédent, on peut dire f continue en a . Dès lors $f \in C^0(X, Y)$. □

1.2.3 L'espace $B(X, E)$

Définition 1.33. Soient $X \neq \emptyset$ et $(E, \|\cdot\|_E)$ un espace vectoriel normé. On note :

$$B(X, E) := \{f : X \rightarrow E \text{ t.q. } f \text{ est bornée sur } X\}.$$

Pour $f \in B(X, E)$, on définit :

$$\|f\|_\infty := \sup_{x \in X} \|f(x)\|_E.$$

Proposition 1.34. $(B(X, E), \|\cdot\|_\infty)$ est un espace vectoriel normé.

Démonstration. EXERCICE. □

Théorème 1.35. $(B(X, E), \|\cdot\|_\infty)$ est complet si et seulement si $(E, \|\cdot\|_E)$ est complet.

Démonstration. Supposons d'abord $(B(X, E), \|\cdot\|_\infty)$ complet et montrons que $(E, \|\cdot\|_E)$ est complet.

Soit $(x_n)_n$ une suite de Cauchy d'éléments de E . Soit (f_n) une suite de fonctions de $B(X, E)$ telle que :

$$\forall n \in \mathbb{N} : \forall x \in X : f_n(x) = x_n.$$

Puisque (x_n) est de Cauchy, on sait que :

$$\forall \varepsilon > 0 : \exists N \in \mathbb{N} \text{ t.q. } \forall m, n \geq N : d(x_m, x_n) < \varepsilon.$$

Or, avec $a \in X$ fixé, on peut alors dire $\forall m, n \geq N : d(f_m(a), f_n(a)) < \varepsilon$, et ce peu importe le a choisi (car les f_n sont constantes). On a donc (f_n) une suite de Cauchy dans $B(X, E)$ car $d(f_m(a), f_n(a)) = \|f_m - f_n\|_\infty$. Or, par complétude de $B(X, E)$, on sait qu'il existe $f \in B(X, E)$ telle que $f_n \rightarrow f$. La fonction f est également constante. Posons L la seule image de f . Soit $\varepsilon > 0$. On sait qu'il existe $n \in \mathbb{N}$ tel que $\forall n \geq N : \|f_n - f\|_\infty < \varepsilon$.

Or :

$$\varepsilon > \|f_n - f\|_\infty = \sup_{x \in X} \|f_n(x) - f(x)\|_E = \|f_n(a) - f(a)\|_E = \|x_n - L\|.$$

Dès lors, on sait que (x_n) converge dans E .

Montrons maintenant que si $(E, \|\cdot\|_E)$ est complet, alors $(B(X, E), \|\cdot\|_\infty)$ est complet également.

Soit $(f_n)_n$ une suite de Cauchy de fonctions de $(B(X, E), \|\cdot\|_\infty)$. Fixons $\varepsilon > 0$. Il existe alors $N \in \mathbb{N}$ tel que :

$$\forall m, n \geq N : \|f_m - f_n\|_\infty < \varepsilon.$$

Soit $x \in X$. On observe que :

$$\forall m, n \geq N : \|f_n(x) - f_m(x)\|_E \leq \|f_n - f_m\|_\infty < \varepsilon.$$

La suite $(f_n(x))_n$ est donc une suite de Cauchy dans $(E, \|\cdot\|_E)$. Par complétude de E , on sait qu'il existe $f(x) \in E$ tel que $f_n(x) \rightarrow f(x)$. Montrons maintenant que $f \in B(X, E)$.

La suite $(f_n)_n$ est de Cauchy et donc bornée. Soit $M \geq 0$ tel que $\forall n \in \mathbb{N} : \|f_n\|_\infty < M$. Passons à la limite dans $(B(X, E))$. On a alors :

$$\forall n \in \mathbb{N} : \forall x \in X : \|f(x)\|_E < M.$$

Ainsi, $f \in B(X, E)$ par définition.

Soit alors $\varepsilon > 0$. Pour tout $m, n \in \mathbb{N}$ et pour tout $x \in X$, on a :

$$\|f_n(x) - f_m(x)\|_E \leq \|f_n - f_m\|_\infty \leq \varepsilon.$$

Passons alors à la limite en m , ce qui donne :

$$\|f_n(x) - f(x)\|_E \leq \|f_n - f\|_\infty \leq \varepsilon.$$

Dès lors :

$$\forall n \geq N : \|f_n - f\|_\infty \leq \varepsilon.$$

□

Remarque. Quand $X \neq \emptyset$ et $Y = E$ est un espace vectoriel normé, on a :

$$f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVU sur } X} f \iff \begin{cases} \exists N \in \mathbb{N} \text{ t.q. } \forall n \geq N : f_n - f \in B(X, E) \\ f_n - f \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\|\cdot\|_\infty} 0 \end{cases}.$$

1.2.4 Convergence uniforme sur tout compact

Définition 1.36. Soit X , une partie non-vide d'un espace vectoriel normé de dimension finie $(E, \|\cdot\|_E)$. Soit (Y, d) un espace métrique. Une suite $f_n : X \rightarrow Y$ converge uniformément vers $f : X \rightarrow Y$ sur tout compact lorsque :

$$\forall \text{ compact } K \subset X : f_n \Big|_K \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVU sur } K} f \Big|_K.$$

Cela se note :

$$f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVU sur tout cpct de } X} f.$$

Proposition 1.37. Si la suite f_n converge uniformément sur tout compact de X et si toutes les fonctions f_n sont continues en $a \in X$, alors f est continue en a .

Démonstration. EXERCICE.

□

Exemple 1.11. Prenons $X = Y = \mathbb{R}$. On définit $f_n(x) = \sum_{k=0}^n \frac{x^k}{k!}$. On a alors $f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVS sur } X} \exp$.

De plus :

$$\|f_n - \exp\|_\infty = \sup_{x \in \mathbb{R}} \left| \sum_{k=0}^n \frac{x^k}{k!} - \exp(x) \right| = +\infty.$$

Donc f_n ne converge pas uniformément vers \exp . Montrons maintenant que f_n converge uniformément vers \exp sur tout compact de \mathbb{R} . Soit $K \subset \mathbb{R}$ un compact. On sait qu'il existe $a, b \in \mathbb{R}, a < b$ tels que $K \subset [a, b]$. Pour $x \in [a, b]$, par Lagrange, on a :

$$\exp(x) - \sum_{k=0}^n \frac{x^k}{k!} = \frac{x^{n+1}}{(n+1)!} \exp(c_x),$$

avec $c_x \in [a, b]$.

Ainsi :

$$\left| \exp(x) - \sum_{k=0}^n \frac{x^k}{k!} \right| \leq \frac{(b-a)^{n+1}}{(n+1)!} \sup_{x \in [a, b]} \exp(x) \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} 0.$$

D'où $f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{[a, b]} f$ et donc la convergence uniforme sur tout compact de f_n vers f .

1.3 Suites de fonctions et opérations d'intégration et de dérivation

1.3.1 Passage à la limite dans une intégrale de Riemann

Soit X un pavé de \mathbb{R}^d (donc $X = \prod_{i=1}^d [a_i, b_i]$ avec $a_i < b_i \forall i \in \{1, \dots, d\}$).

Théorème 1.38. Soit $f_n : X \rightarrow \mathbb{R}$ intégrables au sens de Riemann sur X . Supposons $f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVU sur } X} f$. Alors :

- f est intégrable au sens de Riemann ;
- la $(\int_X f_n(x) dx)_n$ converge vers $\int_X f(x) dx$.³

Démonstration. On note $\mathcal{E}(X, \mathbb{R}) := \{f : X \rightarrow \mathbb{R} \text{ t.q. } f \text{ est élémentaire}\}$.

Soit $\varepsilon > 0$. Par la convergence uniforme, on sait qu'il existe $N \in \mathbb{N}$ tel que :

$$\forall n \geq N : \|f_n - f\|_\infty \leq \frac{\varepsilon}{4|X|},$$

où $|X| = \prod_{i=1}^d (b_i - a_i)$.

Par intégrabilité de f_N , on sait qu'il existe $\varphi, \psi \in \mathcal{E}(X, \mathbb{R})$ telles que :

$$\psi \leq f_N \leq \varphi \quad \text{et} \quad \int_X (\varphi - \psi) < \frac{\varepsilon}{2}.$$

On a alors :

$$\psi - f_N \leq f \leq \varphi + f_N,$$

ou encore :

$$\psi - \frac{\varepsilon}{4|X|} \leq f \leq \varphi + \frac{\varepsilon}{4|X|}.$$

3. Cela veut dire que :

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} \int_X f_n(x) dx = \int_X \lim_{n \rightarrow +\infty} f_n(x) dx.$$

En posant $\bar{\psi} := \psi - \frac{\varepsilon}{4|X|}$ et $\bar{\varphi} := \varphi + \frac{\varepsilon}{4|X|}$, on a $\bar{\psi}, \bar{\varphi} \in \mathcal{E}(X, \mathbb{R})$. De plus :

$$\int_X (\psi - \varphi) = \int_X \left(\psi + \frac{\varepsilon}{4|X|} - \left(\varphi - \frac{\varepsilon}{4|X|} \right) \right) = \frac{\varepsilon}{2|X|} |X| + \int_X \psi - \varphi < 2 \frac{\varepsilon}{2} = \varepsilon.$$

Dès lors, on en déduit f intégrable au sens de Riemann.

Fixons $\varepsilon > 0$. Par convergence uniforme de f_n vers f sur X , on sait que :

$$\exists N \in \mathbb{N} \text{ t.q. } \forall n \geq N : \|f_n - f\|_\infty < \frac{\varepsilon}{|X|}$$

Et donc :

$$\left| \int_X f_n(x) dx - \int_X f(x) dx \right| = \left| \int_X (f_n - f)(x) dx \right| \leq \left| \int_X \|f_n - f\|_\infty dx \right| = |X| \|f_n - f\|_\infty \leq |X| \frac{\varepsilon}{|X|} = \varepsilon.$$

Finalement, la suite $(\int_X f_n(x) dx)_n$ converge dans \mathbb{R} vers $\int_X f(x) dx$. □

Remarque.

1. Il est possible d'avoir les résultats sans vérifier les hypothèses. Par exemple, $X = [0, 1] \subset \mathbb{R} = Y$, avec $f_n(x) = x^n$. On sait que $f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVS sur } X} 1_{\{x=1\}}$ et que la convergence n'est pas uniforme sur $[0, 1]$. On remarque alors :

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} \int_0^1 f_n(x) dx = \lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{1}{n+1} = 0 = \int_0^1 1_{\{x=1\}}(x) dx = \int_0^1 \lim_{n \rightarrow +\infty} f_n(x) dx ;$$

2. si les hypothèses ne sont pas vérifiées, la conclusion peut être fausse. Par exemple, $X = [0, 1] \subset \mathbb{R} = Y$. On définit ($n \geq 1$) :

$$f_n(x) = \begin{cases} 2n\alpha_n x & \text{si } 0 \leq x < \frac{1}{2n} \\ 2\alpha_n - 2n\alpha_n x & \text{si } \frac{1}{2n} \leq x < \frac{1}{n} \\ 0 & \text{sinon} \end{cases},$$

où $\alpha_n \in \mathbb{R}_0^+$ t.q. $\forall n \in \mathbb{N}^* : \int_0^1 f_n(x) dx = 1$, donc $\alpha_n = 2n$.

On a alors $f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVS sur } X} 0 = f$. La fonction nulle $0(x)$ est intégrable au sens de Riemann sur $[0, 1]$.

Finalement, on a :

$$\int_0^1 \lim_{n \rightarrow +\infty} f_n(x) dx = \int_0^1 f(x) dx = 0 \quad \text{et} \quad \lim_{n \rightarrow +\infty} \int_0^1 f_n(x) dx = 1.$$

Dans ce cas précis, on ne peut pas passer à la limite.

1.3.2 Passage à la limite dans une dérivation ordinaire ou partielle

Théorème 1.39. Soit $\emptyset \neq \Omega \subset \mathbb{R}^d$, un ouvert. Soient $f_n : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$, toutes de classe C^1 sur Ω . Supposons :

- $f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVS sur tout cpt de } \Omega} f$;
- $\forall i \in \llbracket 1, d \rrbracket : \frac{\partial f_n}{\partial x_i} \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVU sur } \Omega} g_i$.

Alors :

1. $f \in C^1(\Omega, \mathbb{R})$;
2. $\forall i \in \llbracket 1, d \rrbracket : \frac{\partial f}{\partial x_i} = \lim_{n \rightarrow +\infty} \frac{\partial f_n}{\partial x_i} \text{ dans } \Omega$;
3. $f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{CVU \text{ sur tout cpct de } \Omega} f$.

Démonstration. Soit $x \in \Omega$. Par ouverture de Ω , on sait qu'il existe $\delta \geq 0$ tel que $B(x, \delta) \subset \Omega$. On en déduit que $B(x, \frac{\delta}{2})$ est incluse dans $B(x, \delta)$. Or $B(x, \frac{\delta}{2})$ est fermé et borné par définition. $B(x, \frac{\delta}{2})$ est donc un compact de Ω .

Soient $i \in \llbracket 1, d \rrbracket$ et $h \in [\pm \frac{\delta}{2}]$. On a alors :

$$\forall n \in \mathbb{N} : f_n(x + h e_i) = f_n(x) + \int_0^h \frac{\partial f}{\partial x_i}(x + s e_i) ds.$$

Or comme $f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{CVS \text{ sur tout cpct de } \Omega} f$ et pour tout i , $\frac{\partial f_n}{\partial x_i}$ converge uniformément vers g_i sur $B(x, \frac{\delta}{2})$, il vient :

$$f_n(x + h e_i) = f_n(x) + \int_0^h g_i(x + s e_i) ds,$$

où $\{e_1, \dots, e_d\}$ est la base canonique de \mathbb{R}^d .

On en déduit alors que f admet une dérivée partielle par rapport à x_i en x :

$$\frac{\partial f}{\partial x_i}(x) = g_i(x).$$

De plus, les f_n sont $C^1(\Omega, \mathbb{R})$, et donc les dérivées partielles $\frac{\partial f_n}{\partial x_i}$ sont $C^0(\Omega, \mathbb{R})$ pour tout i et par convergence uniforme sur les compacts, $g_i \in C^0(\Omega, \mathbb{R})$ (Proposition 1.37).

On en déduit alors $f \in C^1(\Omega, \mathbb{R})$ avec $\frac{\partial f}{\partial x_i} = g_i$ pour tout i dans Ω (points 1 et 2 à montrer).

Il reste donc à montrer le point 3.

Soit $K \subset \Omega$, un compact. Par ouverture de Ω , on sait que pour tout $a \in K$, on a :

$$\exists r_a \geq 0 \text{ t.q. } B(a, r_a) \subset \Omega.$$

Dès lors, on sait que :

$$K \subset \bigcup_{a \in K} B\left(a, \frac{r_a}{2}\right).$$

Par complétude, on sait qu'il existe un sous-recouvrement fini de K , c'est-à-dire $p \in \mathbb{N}^*$ et $(a_i)_{i \in \llbracket 1, p \rrbracket} \in K^p$ tel que :

$$K \subset \bigcup_{i=1}^p B\left(a_i, \frac{r_{a_i}}{2}\right).$$

Par convergence simple de f_n vers f , et puisque les a_i sont en nombre fini, on peut alors exprimer :

$$\forall \varepsilon > 0 : \exists N \in \mathbb{N} \text{ t.q. } \forall n \geq N : \forall k \in \llbracket 1, p \rrbracket |f_n(a_i) - f(a_i)| < \varepsilon.$$

Fixons donc $\varepsilon > 0$, soit N correspondant et soit $x \in K$. Il existe $k \in \llbracket 1, p \rrbracket$ tel que $x \in B(a_k, \frac{r_{a_k}}{2})$ car les boules ouvertes forment un recouvrement de K . On a alors :

$$f_n(x) = f_n(a_k) + \int_0^1 \langle \nabla f_n(a_k + t(x - a_k)), (x - a_k) \rangle dt,$$

et :

$$f(x) = f(a_k) + \int_0^1 \langle \nabla f(a_k + t(x - a_k)), (x - a_k) \rangle dt.$$

Par différence, on a :

$$|f_n(x) - f(x)| \leq |f_n(a_k) - f(a_k)| + \int_0^1 \|\nabla f_n(a_k + t(x - a_k)) - \nabla f(a_k + t(x - a_k))\| dt \cdot \|x - a_k\|.$$

Par convergence uniforme sur $(\bigcup_{i=1}^p B(a_i, \frac{r_{a_i}}{2}))$ de ∇f_n vers ∇f , on sait que :

$$\exists N \in \mathbb{N} \text{ t.q. } \forall n \geq N : \|\nabla f_n - \nabla f\|_{\infty, \bigcup_{i=1}^p B(a_i, \frac{r_{a_i}}{2})} < \frac{2\varepsilon}{\max_{i \in \llbracket 1, p \rrbracket} r_{a_i}}.$$

Finalement, on a :

$$\forall x \in K : \forall n \geq N : \|f_n(x) - f(x)\| \leq \varepsilon + \frac{r_{a_k}}{2} \cdot \frac{2\varepsilon}{\max_{i \in \llbracket 1, d \rrbracket} r_{a_i}} \leq 2\varepsilon.$$

Ainsi, pour $n \geq N$, on a :

$$\|f_n - f\|_{\infty, K} \leq 2\varepsilon.$$

□

Remarque. Ce théorème est vrai en particulier pour $d = 1$, et Ω un segment de \mathbb{R} .

Exemple 1.12 (Contre-exemples ne vérifiant pas les hypothèses donc ne pouvant faire passer la limite dans la dérivation).

$f_n(x) = \frac{\sin(n^2 x)}{n}$, $n \geq 1$, $x \in X = \mathbb{R}$. On a donc $f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVU sur } \mathbb{R}} 0 = f$ car $|f_n(x) - f(x)| \leq \frac{1}{n} \rightarrow 0$ avec $\frac{1}{n}$ ne dépendant pas de x . Les f^n sont $C^\infty(\mathbb{R})$ et sont donc dérivables :

$$\frac{df_n}{dx} = n \cos(n^2 x),$$

et donc :

$$\left. \frac{df_n}{dx} \right|_{x=0} = n \rightarrow +\infty.$$

On en déduit :

$$\neg \left(\frac{df_n}{dx} \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{} \frac{df}{dx} \right).$$

2. $f_n(x) = \frac{x^n}{n}$, $n \geq 1$, $x \in X = [0, 1]$. On a $f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVU sur } X} 0$. Puisque les f_n sont $C^\infty(X, \mathbb{R})$, on a :

$$\frac{df_n}{dx} = x^{n-1} \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{} 1_{\{x=1\}},$$

qui n'est pas une dérivée. À nouveau, la suite des dérivées des f_n ne tend pas vers la dérivée de f .

Corollaire 1.40. Soient $p \in \mathbb{N}^*$, $\Omega \subset \mathbb{R}^d$, un ouvert non-vide. Soit $f_n : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ de classe $C^p(\Omega, \mathbb{R})$. Supposons :

$$\begin{aligned}
& \text{--- } \forall q \in \llbracket 0, p-1 \rrbracket : \forall (i_1, \dots, i_q) \in \llbracket 1, d \rrbracket^q : \frac{\partial^q f_n}{\partial x_{i_1} \dots \partial x_{i_q}} \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{CVU \text{ sur } \Omega} g_{i_1, \dots, i_q} ; \\
& \text{--- } \forall (i_1, \dots, i_p) \in \llbracket 1, d \rrbracket^p : \frac{\partial^p f_n}{\partial x_{i_1} \dots \partial x_{i_p}} \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{CVU \text{ sur } \Omega} g_{i_1, \dots, i_p} .
\end{aligned}$$

Alors :

1. $f = g_\emptyset \in C^p(\Omega, \mathbb{R})$;
2. $\forall q \in \llbracket 1, p \rrbracket : \forall (i_1, \dots, i_q) \in \llbracket 1, d \rrbracket^q : \frac{\partial^q f}{\partial x_{i_1} \dots \partial x_{i_q}} = g_{i_1, \dots, i_q} ;$
3. $\forall q \in \llbracket 0, p-1 \rrbracket : \forall (i_1, \dots, i_q) \in \llbracket 1, d \rrbracket^q : \frac{\partial^q f_n}{\partial x_{i_1} \dots \partial x_{i_q}} \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{CVU \text{ sur tout cpct de } \Omega} g_{i_1, \dots, i_q} .$

Démonstration. EXERCICE. (Récurrence sur p par le résultat précédent) □

1.4 Séries de fonctions

1.4.1 Retranscription des résultats sur les suites

Définition 1.41. Soit $u_n : X \rightarrow Y$ où $X \neq \emptyset$ et Y est un espace vectoriel normé. On appelle *somme partielle d'ordre n de la série de terme général u_n* la fonction suivante :

$$S_n : X \rightarrow Y : x \mapsto \sum_{k=0}^n u_k(x).$$

On dit que la série de terme général u_n *converge simplement* sur X lorsque S_n converge simplement sur X . De même pour la *convergence uniforme* sur X et la *convergence uniforme sur tout compact* de X .

Théorème 1.42. Soient (X, d) un espace métrique et Y un espace vectoriel normé. Soit $u_n : X \rightarrow Y$. Si $\forall n \in \mathbb{N} : u_n$ est continue en $a \in X$ et si la série de terme général u_n converge uniformément sur X , alors :

$$S := \lim_{n \rightarrow +\infty} S_n \text{ est continue en } a.$$

Démonstration. EXERCICE. □

Théorème 1.43. Soit $X \neq \emptyset$, un pavé de \mathbb{R}^d et soit $u_n : X \rightarrow Y$ t.q. $\sum_{n \geq 0} u_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{CVU \text{ sur } X} S$ avec u_n intégrable au sens de Riemann pour tout n . Alors :

1. S est intégrable au sens de Riemann sur X ;
2. la suite $\int_X S_n(x) dx$ converge vers $\int_X S(x) dx$.

Démonstration. EXERCICE. □

Théorème 1.44. Soit $\Omega \subset \mathbb{R}^d$, un ouvert non-nul et soit $u_n : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ de classe $C^p(\Omega, \mathbb{R})$ avec $p \in \mathbb{N}^*$. Supposons :

- $\sum_{n \geq 0} u_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{CVS \text{ sur } \Omega} S$;
- $\forall \alpha \in \mathbb{N}^d$ t.q. $|\alpha| := \sum_{i=1}^d \alpha_i \leq p : \sum_{n \geq 0} \frac{\partial^{|\alpha|}}{\partial x_1^{\alpha_1} \dots \partial x_d^{\alpha_d}} u_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{CVS \text{ sur } \Omega} s_\alpha$;
- lorsque $|\alpha| = p$, la convergence ci-dessus est uniforme sur les compacts de Ω .

Alors :

1. $S \in C^p(\Omega, \mathbb{R})$;

$$2. \forall \alpha \in \mathbb{N}^d : \frac{\partial^{|\alpha|}}{\partial x_1^{\alpha_1} \dots \partial x_d^{\alpha_d}} S = \sum_{n \geq 0} \frac{\partial^{|\alpha|}}{\partial x_1^{\alpha_1} \dots \partial x_d^{\alpha_d}} u_n ;$$

3. Il y a convergence uniforme sur les compacts de Ω des séries de dérivées partielles d'ordre 0 à $p - 1$.

1.4.2 Convergence normale

Définition 1.45. Soient $X \neq \emptyset$ et Y un espace vectoriel normé. On dit que la série de terme général $u_n : X \rightarrow Y$ converge normalement sur X lorsque :

$$\sum_{n \geq 0} \|u_n\|_{\infty, X} < +\infty.$$

Définition 1.46. On dit que la série de terme général $u_n : X \rightarrow Y$ vérifie le critère de Weierstrass lorsqu'il existe $(M_n)_{n \in \mathbb{N}}$ telle que :

- $\forall n \in \mathbb{N} : \forall x \in X : \|u_n(x)\|_E \leq M_n ;$
- $\sum_{n \geq 0} M_n < +\infty.$

Remarque. $\sum_{n \geq 0} u_n$ converge normalement sur X si et seulement si elle vérifie le critère de Weierstrass.

Proposition 1.47. Si $(E, \|\cdot\|_E)$ est un espace vectoriel normé complet, et si $\sum_{n \geq 0} u_n$ converge normalement sur X alors $\sum_{n \geq 0} u_n$ converge uniformément sur X .

Démonstration. Écrivons $S_n = \sum_{k=0}^n u_k \in B(X, E)$. Par convergence normale, la suite $\sigma_n = \sum_{k \geq 0} \|u_k\|_{\infty, X}$ converge. De plus, (σ_n) est de Cauchy dans \mathbb{R}^+ . Donc :

$$\forall \varepsilon > 0 : \exists N \in \mathbb{N} \text{ t.q. } \forall n, m \geq N : |\sigma_n - \sigma_m| < \varepsilon.$$

Ainsi :

$$\begin{aligned} \|S_n - S_m\|_{\infty, X} &= \left\| \sum_{k=\min(m,n)+1}^{\max(m,n)} u_k \right\|_{\infty, X} \leq \sum_{k=\min(m,n)+1}^{\max(m,n)} \|u_k\|_{\infty, X} \\ &\leq |\sigma_n - \sigma_m| < \varepsilon. \end{aligned}$$

Donc $(S_n)_n$ est de Cauchy dans $(B(X, E), \|\cdot\|_{\infty, X})$. Cet espace est complet car $(E, \|\cdot\|_E)$ l'est (Théorème 1.35). Et donc, $(S_n)_n$ converge uniformément sur X . \square

Remarque. On peut écrire :

$$CVN \underset{\text{complet}}{\Rightarrow} CVU \Rightarrow CVS,$$

mais les réciproques sont habituellement fausses.

Corollaire 1.48. Si $f_n : X \rightarrow Y$ (avec Y un espace vectoriel normé complet) est t.q. :

$$\begin{cases} \forall n \in \mathbb{N} : \exists M_n \geq 0 \text{ t.q. } \|f_{n+1} - f_n\|_{\infty, X} \leq M_n \\ \sum_{m \geq 0} M_m < +\infty, \end{cases}$$

alors $(f_n)_{n \in \mathbb{N}}$ converge uniformément sur X .

Démonstration. La série de terme général $u_n = f_{n+1} - f_n$ converge normalement sur X car elle vérifie le critère de Weierstrass sur X . Par complétude de Y , la série $\sum u_n$ converge uniformément sur X .

Pour $n \in \mathbb{N}$, on calcule :

$$S_n = \sum_{k=0}^n u_k = f_{n+1} - f_0.$$

Donc la suite $(f_n)_{n \in \mathbb{N}}$ converge uniformément sur X . □

1.4.3 Transformation d'Abel

Théorème 1.49. Soient Y un espace vectoriel normé complet, $(g_n)_{n \in \mathbb{N}} \in Y^{\mathbb{N}}$, et $(f_n)_{n \in \mathbb{N}} \in (\mathbb{R}^+)^{\mathbb{N}}$. Supposons :

$$\left\{ \begin{array}{l} \exists M \geq 0 \text{ t.q. } \forall n \in \mathbb{N} : \left\| \sum_{k=0}^n g_k \right\|_Y \leq M \\ f_n \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} 0 \text{ en décroissant.} \end{array} \right.$$

Alors $f_n g_n$ est le terme général d'une série convergente.

Démonstration. On pose :

$$\forall k \in \mathbb{N}^* : G_k = \sum_{m=0}^k g_m$$

Calculons, pour $n, p \in \mathbb{N}^*$:

$$\begin{aligned} S_{n+p} - S_n &= \sum_{k=n+1}^{n+p} f_k g_k = \sum_{k=n+1}^{n+p} f_k (G_k - G_{k-1}) = \sum_{k=n+1}^{n+p} f_k G_k - \sum_{k=n+1}^{n+p} f_k G_{k-1} = \sum_{k=n+1}^{n+p} f_k G_k - \sum_{k=n}^{n+p-1} f_{k+1} G_k \\ &= \sum_{k=n+1}^{n+p-1} G_k (f_k - f_{k+1}) + f_{n+p} G_{n+p} - f_{n+1} G_n. \end{aligned}$$

Ainsi :

$$\begin{aligned} \|S_{n+p} - S_n\|_Y &\leq M \sum_{k=n+1}^{n+p} (f_k - f_{k+1}) + M f_{n+p} + M f_{n+1} = M(f_{n+1} - f_{n+p}) + M(f_{n+p} + f_{n+1}) \\ &= 2M f_{n+1} \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} 0, \end{aligned}$$

et la convergence de dépend pas de p . On a alors que la suite $(S_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est de Cauchy, et par complétude de Y , S_n converge, ce qui implique que la série de terme général $f_n g_n$ converge. □

Théorème 1.50. Soient X un espace vectoriel normé complet et $X \neq 0$. Soient :

$$\begin{aligned} g_n &: X \rightarrow Y, \\ f_n &: X \rightarrow \mathbb{R}^+. \end{aligned}$$

Supposons :

- qu'il existe $M \geq 0$ tel que $\forall n \in \mathbb{N} : \left\| \sum_{k=1}^n g_k \right\|_{\infty, X} \leq M$;
- que $f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{CVU sur } X} 0$ en décroissant.

Alors $f_n g_n$ est le terme général d'une série qui converge uniformément sur X .

Démonstration. Par la preuve précédente, on a :

$$\|S_{n+p} - S_n\|_Y \leq 2Mf_{n+1}(x) \leq 2M\|f_{n+1}\|_{\infty, X}.$$

On déduit donc :

$$\|S_{n+p} - S_n\|_{\infty, X} \leq 2M\|f_{n+1}\|_{\infty, X}.$$

On sait donc que $(S_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est de Cauchy dans $B(X, Y)$. Par complétude de Y , la série de terme général $f_n g_n$ converge uniformément sur X .

On remarque en effet que les S_n sont bornés car $f_n \xrightarrow[n \rightarrow +\infty]{\text{C.V.U. sur } X} 0$, ce qui implique $\|f_n\|_{\infty, X}$ bornée, au moins à partir d'un certain $n \in \mathbb{N}$. De plus, $\|\sum_k g_k\| < M$ assure que g_k est uniformément bornée. \square

1.4.4 Exemple d'une fonction continue sur \mathbb{R} nulle part dérivable

Considérons la fonction $\varphi : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto |x|$ sur $[-1, 1]$ et 2-périodique. La fonction φ est continue sur \mathbb{R} . Posons :

$$\forall k \in \mathbb{N} : u_k : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \left(\frac{3}{4}\right)^k \varphi(4^k x).$$

On sait que $\forall k \in \mathbb{N} : \|u_k\|_{\infty} = \left(\frac{3}{4}\right)^k \in [0, 1]$. Ainsi, la série de terme général u_k converge normalement sur \mathbb{R} par le critère de Weierstrass. Par le Théorème 1.42, la fonction :

$$f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \sum_{k \geq 0} u_k(x)$$

est continue sur \mathbb{R} .

Montrons maintenant la fonction f n'est jamais dérivable.

Construisons α_n et β_n tels que :

$$\begin{cases} \forall n \in \mathbb{N} : \alpha_n \leq x \leq \beta_n, \\ \beta_n - \alpha_n \rightarrow 0, \\ \forall n \in \mathbb{N} : \left| \frac{f(\beta_n) - f(\alpha_n)}{\beta_n - \alpha_n} \right| \geq \frac{1}{2} 3^n. \end{cases}$$

Soit $n \in \mathbb{N}^*$. Choisissez $p \in \mathbb{Z}$ tel que $p = \lfloor 4^n x \rfloor$ (et donc $p \leq 4^n x < p + 1$). Posons $\alpha_n = \frac{p}{4^n}$ et $\beta_n = \frac{p+1}{4^n}$. On a alors :

$$f(\beta_n) - f(\alpha_n) = \sum_{k \geq 0} \left(\varphi(4^k \beta_n) \left(\frac{3}{4}\right)^k - \varphi(4^k \alpha_n) \left(\frac{3}{4}\right)^k \right) = \sum_{k \geq 0} \left(\frac{3}{4}\right)^k \left(\varphi(4^k \beta_n) - \varphi(4^k \alpha_n) \right)$$

On observe que :

— si $k \leq n$, alors $4^k \beta_n = 4^{k-n}(p+1)$ et $4^k \alpha_n = 4^{k-n}p$. Puisque φ est lipschitzienne de constante 1, on a :

$$\varphi(4^k \beta_n) - \varphi(4^k \alpha_n) \leq 4^{k-n}(p+1 - p) = 4^{k-n};$$

— si $k = n$, alors $|\varphi(4^k \beta_n) - \varphi(4^k \alpha_n)| = 1$;

— si $k \geq n$, alors $4^k \alpha_n = 4^{k-n}p \in 4\mathbb{Z} \subset 2\mathbb{Z}$ donc $\varphi(4^k \alpha_n) = 0$. De même, on a $\varphi(4^k \beta_n) = 0$.

Ainsi :

$$f(\beta_n) - f(\alpha_n) = \sum_{k=0}^{n-1} \left(\frac{3}{4}\right)^k \left(\varphi(4^k \beta_n) - \varphi(4^k \alpha_n)\right) + \left(\frac{3}{4}\right)^n \left(\varphi(4^n \beta_n) - \varphi(4^n \alpha_n)\right).$$

Or, par inégalité triangulaire inversée, on a :

$$|f(\beta_n) - f(\alpha_n)| \geq \left(\frac{3}{4}\right)^n \left|\varphi(4^n \beta_n) - \varphi(4^n \alpha_n)\right| - \sum_{k=0}^{n-1} \left(\frac{3}{4}\right)^k 4^{k-n} \geq \frac{1}{2} \left(\frac{3}{4}\right)^n.$$

Et puisque $\beta_n - \alpha_n = 4^{-n}$, il vient :

$$\left| \frac{f(\beta_n) - f(\alpha_n)}{\beta_n - \alpha_n} \right| \geq \frac{1}{2} 3^n,$$

ce qui contredit la dérivabilité en x .

1.5 Séries de puissances

1.5.1 Théorie du rayon

On se donne $(Y, \|\cdot\|)$, un \mathbb{C} -ev complet.

Définition 1.51. On appelle *série de puissance* toute série de fonctions :

$$u_n : \mathbb{C} \rightarrow Y,$$

dont le terme général est sous la forme $u_n(z) = a_n(z - z_0)^n$, avec $z_0 \in \mathbb{C}$ fixé et $(a_n) \subset Y$.

Remarque. $Y = \text{Mat}_{n \times n}(\mathbb{C})$.

Définition 1.52. Définissons $\overline{\mathbb{R}^+} := \mathbb{R}^+ \cup \{+\infty\}$.

Théorème 1.53. Soit $R := \left(\limsup_{n \rightarrow +\infty} \|a_n\|_Y^{\frac{1}{n}} \right)^{-1}$. Quelque soit $z \in \mathbb{C}$:

- si $|z - z_0| \leq R$, alors $\sum_{n \geq 0} u_n(z)$ converge absolument ;
- si $|z - z_0| \geq R$, alors $\sum_{n \geq 0} u_n(z)$ diverge grossièrement (le terme général ne tend pas vers 0 pour $n \rightarrow +\infty$ en norme dans Y).

Démonstration. Soit $z \in \mathbb{C}$ tel que $|z - z_0| < R$. Alors il existe $R' \geq 0$ t.q. $|z - z_0| < R' < R$ et :

$$\frac{1}{R} + \frac{1}{R'} < \frac{1}{|z - z_0|}.$$

Puisque $R^{-1} = \limsup_{n \rightarrow +\infty} \|a_n\|_Y^{\frac{1}{n}}$, il existe $N \in \mathbb{N}$ t.q. :

$$\forall n \geq N : \|a_n\|_Y^{\frac{1}{n}} \leq \limsup_{n \rightarrow +\infty} \|a_n\|_Y^{\frac{1}{n}} = \frac{1}{R} \leq \frac{1}{R'}.$$

Dès lors : $\|a_n\|_Y \leq \frac{1}{(R')^n}$, ou encore $|z - z_0| \|a_n\|_Y \leq \frac{|z - z_0|^n}{(R')^n}$. On a donc :

$$\|(z - z_0)^n a_n\|_Y \leq \left(\frac{|z - z_0|}{R'} \right)^n.$$

Et comme $\left| \frac{z-z_0}{R'} \right| < 1$, on sait que la série de terme général $\frac{|z-z_0|}{R'}$ converge et donc de terme général $\|(z-z_0)^n a_n\|_Y$ converge aussi.

Soit maintenant $z \in \mathbb{C}$ t.q. $|z-z_0| > R$. Il existe $R' > 0$ tel que $|z-z_0| > R' > R$ et $|z-z_0|^{-1} < (R')^{-1} + R^{-1}$. Soit $\varphi : \mathbb{N} \rightarrow \mathbb{N}$ strictement croissante telle que :

$$\forall n \in \mathbb{N} : \frac{1}{R'} \leq \|a_{\varphi(n)}\|_Y^{\frac{1}{\varphi(n)}}.$$

On en déduit :

$$\|a_{\varphi(n)}(z-z_0)^{\varphi(n)}\|_Y = |z-z_0|^{\varphi(n)} \|a_{\varphi(n)}\|_Y \geq \left(\frac{|z-z_0|}{R'} \right)^{\varphi(n)} \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} +\infty.$$

Dès lors, $\sum_{n \geq 0} a_n(z-z_0)^n$ diverge grossièrement. □

Théorème 1.54. Soit $a_n(z-z_0)^n$, le terme général d'une série de puissance. Alors :

- lorsque $0 < R < +\infty$, $\forall r \in (0, R)$: la série de terme général $z \mapsto a_n(z-z_0)^n$ converge normalement sur $B(z_0, r]$;
- lorsque $R = +\infty$, la série de fonctions de terme général $z \mapsto a_n(z-z_0)^n$ converge normalement sur $B(z_0, r]$ pour tout r .

Démonstration. Si $0 < r < R < +\infty$, observons que $|z_0 + r - z_0| < R$. Ainsi, avec le Théorème 1.53, la série de terme général $a_n(z_0 + r)$ converge absolument. Or :

$$\|a_n(z_0 + r)\|_Y = \|a_n\|_Y |z_0 + r - z_0|^n = \|a_n\|_Y r^n.$$

Donc la série de terme général $\|a_n\|_Y r^n$ converge. Observons que :

$$\forall n \in \mathbb{N} : \forall z \in B(z_0, r] : \|u_n(z)\|_Y = \|a_n\|_Y |z-z_0|^n \leq \|a_n\|_Y r^n.$$

Ainsi $\|u_n\|_{\infty, B(z_0, r]} \leq \|a_n\|_Y r^n$. Or $\|a_n\|_Y r^n$ est le terme général d'une série qui converge. Par le critère de Weierstrass, la série de terme général u_n converge normalement sur $B(z_0, r]$.

Si maintenant $R = +\infty$, on prend $r \in \mathbb{R}^+_{>0}$, $|z_0 + r - z_0| = r < R = +\infty$. Avec le Théorème 1.53, on a : que $\sum_{n \geq 0} u_n(z_0 + r)$ converge absolument. Or $\|u_n(z_0 + r)\|_Y = \|a_n\|_Y r^n$. Donc la série de terme général $\|a_n\|_Y r^n$ converge. Puisque l'on a toujours :

$$\|u_n\|_{\infty, B(z_0, r]} \leq \|a_n\|_Y r^n,$$

on a donc $\sum_{n \geq 0} u_n$ converge normalement sur $B(z_0, r]$ par le critère de Weierstrass. □

Corollaire 1.55. Soit $a_n(z-z_0)^n$ une série de puissance dans Y complet et R le rayon associé. Lorsque $R \geq 0$, la série converge normalement sur tout compact de $B(0, r[$.

Démonstration. Si $0 < R < +\infty$, soit $K \subset B(z_0, R[$ un compact. Il existe $r \in (0, R)$ tel que $K \subset B(z_0, r] \subset B(z_0, R[$. La convergence normale sur $B(z_0, r]$ implique la convergence normale sur K .

Si $R = +\infty$, on a $B(z_0, R[= \mathbb{C}$. Soit K , un compact de \mathbb{C} . Il existe $r > 0$ tel que $K \subset B(z_0, r]$, et donc la convergence normale sur $B(z_0, r]$ implique la convergence normale sur K . □

Corollaire 1.56. Lorsque $R > 0$, la fonction $S(z) = \sum_{k \geq 0} a_k(z-z_0)^k$ est une fonction continue sur $B(z_0, R[$.

Démonstration. Les fonctions $u_n : B(z_0, R[\rightarrow Y : z \mapsto a_n(z-z_0)^n$ sont continues sur l'ouvert $B(z_0, R[\subset \mathbb{C}$, et il y a convergence normale (et donc uniforme) de $\sum_{n \geq 0} u_n$ sur les compacts de $B(z_0, R[$. Par le Théorème 1.54, on sait que $S \in C^0(B(z_0, R[, Y)$. □

1.5.2 Étude sur le cercle de convergence

Définition 1.57. On définit le cercle centré en $z_0 \in \mathbb{C}$ et de rayon $R > 0$ par :

$$\mathcal{C}(z_0, R] = \{z \in \mathbb{C} \text{ t.q. } |z - z_0| = R\}.$$

Théorème 1.58. Lorsque $0 < R < +\infty$, s'il existe $z \in \mathcal{C}(z_0, R]$ tel que $\sum_{n \geq 0} a_n (z - z_0)^n$ converge absolument, alors la série de fonctions : $u_n(z) = a_n (z - z_0)^n$ converge normalement sur $B(z_0, R]$.

Démonstration. Soit $z \in \mathcal{C}(z_0, R]$ tel que $\sum_{n \geq 0} a_n (z - z_0)^n$ converge absolument. On a :

$$\|a_n (z - z_0)^n\|_Y = |z - z_0|^n \|a_n\|_Y = R^n \|a_n\|_Y.$$

Puisque $\forall z \in B(z_0, R] : \forall n \in \mathbb{N} : \|u_n(z)\|_Y = |z - z_0|^n \|a_n\|_Y \leq R^n \|a_n\|_Y$, il vient que :

$$\forall n \geq 0 : \|u_n\|_{\infty, B(z_0, R]} \leq R^n \|a_n\|_Y.$$

Et donc $\sum_{n \geq 0} u_n$ converge normalement sur $B(z_0, R]$ par le critère de Weierstrass. \square

Exemple 1.13. $Y = \mathbb{C}$, $\sum_{n \geq 1} \frac{z^n}{n^2}$. On a alors $a_n = \frac{1}{n^2}$, donc :

$$|a_n|^{\frac{1}{n}} = n^{-\frac{2}{n}} = \exp\left(-2 \frac{\ln n}{n}\right) \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} 1,$$

d'où $R = 1$, et il y a convergence en $z = 1$, donc il y a convergence absolue de la série :

$$\sum_{n \geq 1} \frac{\exp(in\theta)}{n^2} \quad \forall \theta \in \mathbb{R},$$

et la convergence de $\sum_{n \geq 1} \frac{z^n}{n^2}$ est normale sur $B(0, 1]$.

Théorème 1.59 (Théorème d'Abel). Si $R \in (0, +\infty)$ et $\exists z \in \mathcal{C}(z_0, R]$ t.q. $\sum_{n \geq 0} a_n (z - z_0)^n$ converge, alors la série de fonctions de terme général $z \mapsto a_n (z - z_0)^n$ converge uniformément sur le segment reliant z_0 à z .

Démonstration. Prenons $z_0 = 0$ et $z \in \mathbb{R}^+_0$. Prenons $x \in [0, z]$, $n, p \in \mathbb{N}^*$. Écrivons :

$$\sum_{k=n}^{n+p} a_k x^k = \sum_{k=n}^{n+p} a_k z^k \left(\frac{x}{z}\right)^k.$$

Notons alors $S_m := \sum_{k=0}^m a_k z^k$, pour tout m . On obtient alors :

$$\begin{aligned} \sum_{k=n}^{n+p} a_k x^k &= \sum_{k=n}^{n+p} (S_k - S_{k-1}) \left(\frac{x}{z}\right)^k = \sum_{k=n}^{n+p} (S_k - S_{n-1}) \left(\frac{x}{z}\right)^k - \sum_{k=n}^{n+p} (S_{k-1} - S_{n-1}) \left(\frac{x}{z}\right)^k \\ &= \sum_{k=n}^{n+p} (S_k - S_{n-1}) \left(\frac{x}{z}\right)^k - \sum_{k=n-1}^{n+p-1} (S_k - S_{n-1}) \left(\frac{x}{z}\right)^{k+1} \\ &= -(S_{n-1} - S_{n-1}) \left(\frac{x}{z}\right)^n + \sum_{k=n}^{n+p-1} (S_k - S_{n-1}) \left(\left(\frac{x}{z}\right)^k - \left(\frac{x}{z}\right)^{k+1} \right) + (S_{n+p} - S_{n-1}) \left(\frac{x}{z}\right)^{n+p}. \end{aligned}$$

Puisque la série de terme général $z \mapsto a_k |z - z_0|^k$ converge, la suite $(S_m)_n$ est de Cauchy dans Y . Soit $\varepsilon > 0$. On sait qu'il existe $N \in \mathbb{N}$ t.q. :

$$\forall k, n > N : \|S_k - S_{n-1}\|_Y \leq \varepsilon.$$

Soit un $n \geq N$, et $p \in \mathbb{N}^*$. Prenons $x \in [0, z]$. On a :

$$\begin{aligned}
\left\| \sum_{k=n}^{n+p} a_k x^k \right\|_Y &\leq \sum_{k=n}^{n+p-1} \left\| (S_k - S_{n-1}) \left(\left(\frac{x}{z} \right)^{k+1} - \left(\frac{x}{z} \right)^k \right) \right\|_Y + \left\| (S_{n+p} - S_{n-1}) \left(\frac{x}{z} \right)^{n+p} \right\|_Y \\
&\leq \sum_{k=n}^{n+p-1} \|S_k - S_{n-1}\| \left(\left(\frac{x}{z} \right)^k - \left(\frac{x}{z} \right)^{k+1} \right) + \|S_{n+p} - S_{n-1}\| \left(\frac{x}{z} \right)^{n+p} \\
&\leq \varepsilon \sum_{k=n}^{n+p-1} \left(\left(\frac{x}{z} \right)^k - \left(\frac{x}{z} \right)^{k+1} \right) + \varepsilon \left(\frac{x}{z} \right)^{n+p} \\
&\leq \varepsilon \left(\left(\frac{x}{z} \right)^n - \left(\frac{x}{z} \right)^{n+p} \right) + \varepsilon \left(\frac{x}{z} \right)^{n+p} \\
&\leq \varepsilon \left(\frac{x}{z} \right)^n.
\end{aligned}$$

Par la suite, on peut dire que pour $n \geq N, p \in \mathbb{N}^*$:

$$\left\| \sum_{k=n}^{n+p} a_k x^k \right\|_{\infty, [0, z]} \leq \varepsilon.$$

On en déduit que la série de terme général $x \mapsto a_k x^k$ est de Cauchy dans $B([0, z], Y)$, et donc, par complétude de Y , convergente. \square

Remarque. Soient $(a_n), (b_n) \subset \mathbb{C}$. On appelle la suite de Cauchy de (a_n) et (b_n) la suite de terme général :

$$c_n := \sum_{k=0}^n a_k b_{n-k}.$$

Théorème 1.60 (Théorème de Cauchy, version CDI 1). Si $\sum_{n \geq 0} a_n$ et $\sum_{n \geq 0} b_n$ convergent absolument, alors $\sum_{n \geq 0} c_n$ converge absolument, et on a :

$$\left(\sum_{n \geq 0} a_n \right) \left(\sum_{n \geq 0} b_n \right) = \sum_{n \geq 0} c_n.$$

Théorème 1.61 (Théorème de Cauchy, version CDI 2). Si $\sum_{n \geq 0} a_n, \sum_{n \geq 0} b_n$, et $\sum_{n \geq 0} c_n$ convergent, alors :

$$\left(\sum_{n \geq 0} a_n \right) \left(\sum_{n \geq 0} b_n \right) = \sum_{n \geq 0} c_n.$$

Démonstration. Par hypothèse de convergence des séries, on a :

$$R_a := R \left(\sum_{n \geq 0} a_n z^n \right), R_b := R \left(\sum_{n \geq 0} b_n z^n \right), R_c := R \left(\sum_{n \geq 0} c_n z^n \right) \geq 1.$$

Posons :

$$\begin{aligned} A : [0, 1] &\rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \sum_{n \geq 0} a_n x^n, \\ B : [0, 1] &\rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \sum_{n \geq 0} b_n x^n, \\ C : [0, 1] &\rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \sum_{n \geq 0} c_n x^n. \end{aligned}$$

Si les R_n sont > 1 , alors $[0, 1]$ est un compact de $B(0, R[$ et donc la somme de la série de terme général $a_n z^n$ est C^0 sur $[0, 1]$, et si $R = 1$, alors la série de puissance converge en $1 \in \mathcal{C}(0, 1]$ et donc la série de terme général $a_n z^n$ converge uniformément sur $[0, 1]$.

Puisque $z \mapsto a_n z^n$ (pareil pour b_n, c_n) est C^0 sur $[0, 1]$, il vient que $A, B, C \in C^0([0, 1], \mathbb{C})$.

Pour $x \in [0, 1)$, les séries $\sum_{n \geq 0} a_n x^n$ convergent **absolument**. De plus :

$$\sum_{k=0}^n a_k x^k \cdot b_{n-k} x^{n-k} = x^n \sum_{k=0}^n a_k b_{n-k} = x^n c_n.$$

Par le Théorème 1.60, on a :

$$\forall x \in [0, 1) : A(x)B(x) = C(x).$$

De même, en passant à la limite (continuité) $x \rightarrow 1$, il vient :

$$\left(\sum_{n \geq 0} a_n \right) \left(\sum_{n \geq 0} b_n \right) = A(1)B(1) = C(1) = \sum_{n \geq 0} c_n.$$

□

1.5.3 Fonctions réelles analytiques

On considère la série de puissances $u_n(x) = a_n(x - x_0)^n$, avec $x, x_0 \in \mathbb{R}$ et x_0 fixé.

Définition 1.62. On appelle *série dérivée formelle* de u_n la série de terme général :

$$u'_n(x) = n a_n (x - x_0)^{n-1}, \quad n \geq 1$$

Remarque. La série dérivée formelle est toujours une série de puissances.

Proposition 1.63. Soient :

$$\begin{aligned} R_1 &:= \mathbb{R} \left(\sum_{n \geq 0} a_n (x - x_0)^n \right), \\ R_2 &:= \mathbb{R} \left(\sum_{n \geq 1} n a_n (x - x_0)^{n-1} \right). \end{aligned}$$

Alors $R_1 = R_2$.

Démonstration. On observe aisément que :

$$R_1^{-1} = \limsup_{n \rightarrow +\infty} \|a_n\|_Y^{\frac{1}{n}},$$

et donc :

$$R_2^{-1} = \limsup_{n \rightarrow +\infty} \|n a_n\|_Y^{\frac{1}{n}} = \limsup_{n \rightarrow +\infty} n^{\frac{1}{n}} \|a_n\|_Y^{\frac{1}{n}} = \limsup_{n \rightarrow +\infty} \|a_n\|_Y^{\frac{1}{n}} = R_1^{-1},$$

car $n^{\frac{1}{n}} \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} 1$. □

Proposition 1.64. Soit $x_0 \in \mathbb{R}$. Supposons $R \geq 0$, et notons :

$$f : (x_0 - R, x_0 + R) \rightarrow Y : x \mapsto \sum_{n \geq 0} a_n (x - x_0)^n.$$

Alors la fonction f est continue sur $(x_0 \pm R)$, et on a :

$$\forall p \in \mathbb{N} : \forall x \in (x_0 \pm R) : f^{(p)}(x) = \sum_{n \geq p} (n(n-1)(n-2) \dots (n-p+1)) a_n (x-x_0)^{n-p} = \sum_{n \geq p} \frac{n!}{(n-p)!} a_n (x-x_0)^{n-p}.$$

Démonstration. On observe que le terme général $u_n(x) = a_n(x - x_0)^n$ est de classe C^∞ sur $(x_0 \pm R)$. La série $u'_n(x) = n a_n(x - x_0)^{n-1}$ converge normalement sur les compacts de $(x_0 \pm R)$ par l'égalité des rayons. Donc $f \in C^1((x_0 \pm R))$ et $f'(x) = \sum_{n \geq 1} n a_n(x - x_0)^{n-1}$.

Par récurrence, on obtient le résultat désiré. □

Corollaire 1.65. Si f est une somme d'une série de puissances $\sum_{n \geq 0} a_n(x - x_0)^n$ de rayon $R \geq 0$ sur $(x_0 \pm R)$, alors :

$$\forall n \in \mathbb{N} : a_n = \frac{f^{(n)}(x_0)}{n!}.$$

Démonstration. Si f est somme de la série de puissance de terme général $a_n(x - x_0)^n$, alors $f \in C^\infty$ sur $(x_0 \pm R)$. Par la Proposition 1.64, on trouve :

$$\forall p \in \mathbb{N} : f^{(p)}(x_0) = \sum_{n \geq p} \frac{n!}{(n-p)!} a_n (x_0 - x_0)^{n-p} = \frac{p!}{0!} a_p (x_0 - x_0)^{p-p} + 0 = p! a_p 1 = p! a_p,$$

et donc $a_p = \frac{f^{(p)}(x_0)}{p!}$. □

Remarque. Les notations suivantes sont dues à Landau :

$$\begin{aligned} u_n \sim v_n &\iff \forall \varepsilon > 0 : \exists N \in \mathbb{N} \text{ t.q. } \forall n \geq N : |u_n - v_n| < \varepsilon |u_n| \\ u_n = o(v_n) &\iff \forall \varepsilon > 0 : \exists N \in \mathbb{N} \text{ t.q. } \forall n \geq N : |u_n| < \varepsilon |v_n| \\ u_n = O(v_n) &\iff \exists N \in \mathbb{N} \text{ t.q. } \forall M \geq 0 : \forall n \geq N : u_n < M |v_n| \end{aligned}$$

Définition 1.66. Soit $U \subset \mathbb{R}$, un ouvert. Une fonction $f : U \rightarrow \mathbb{R}$ est dite *réelle analytique* lorsque :

$$\forall x_0 \in U : \exists \varepsilon > 0, (a_n) \subset \mathbb{R} \text{ t.q. } (x_0 \pm \varepsilon) \subset U \text{ et } \sum_{k=0}^n a_k (x - x_0)^k \text{ converge simplement sur } (x_0 \pm \varepsilon).$$

Définition 1.67 (Définition équivalente). $f : U \subset \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ est dite *réelle analytique* lorsque f est somme de sa série de Taylor sur un voisinage de chaque point de U .

Définition 1.68. Pour $\emptyset \neq U \subset \mathbb{R}$, on pose $\mathcal{A}(U) := \{f : U \rightarrow \mathbb{R} \text{ t.q. } f \text{ est réelle analytique sur } U\}$.

Proposition 1.69. Soit $\emptyset \neq U \subset \mathbb{R}$. Alors $\mathcal{A}(U) \subsetneq C^\infty(U, \mathbb{R})$.

Démonstration. Montrons d'abord l'inclusion. Soit $x_0 \in U$ et soit $\varepsilon > 0$ tel que :

$$f(x) = \sum_{k \geq 0} \frac{f^{(k)}(x_0)}{k!} (x - x_0)^k \text{ sur } (x_0 \pm \varepsilon).$$

On a donc $f|_{(x_0 \pm \varepsilon)} \in C^\infty((x_0 \pm \varepsilon), \mathbb{R})$.

Pour montrer l'inclusion stricte, soit :

$$f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \begin{cases} \exp(-x^{-1}) & \text{si } x > 0 \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}.$$

On sait que $f \in C^\infty(\mathbb{R}, \mathbb{R})$, et $\forall k \in \mathbb{N} : f^{(k)}(0) = 0$. Donc f n'est somme de sa série de Taylor sur aucun voisinage de 0. On a donc $f \notin \mathcal{A}(\mathbb{R})$. \square

Remarque. $f \in \mathcal{A}(\mathbb{R})$ peut avoir, en certains points, un rayon fini. Par exemple $f(x) = \frac{1}{1+x^2}$. Pour $|x| < 1$, on a :

$$f(x) = \frac{1}{1 - (-x^2)} = \sum_{k \geq 0} (-1)^k x^{2k},$$

et $R\left(\sum_{k \geq 0} (-1)^k x^{2k}\right) = \left(\limsup_{n \rightarrow +\infty} ((-1)^n)^{\frac{1}{n}}\right)^{-1} = 1$.

Chapitre 2

Intégration

2.1 Intégrales absolument convergentes

2.1.1 Rappels concernant l'intégrale de Riemann

Définition 2.1. On se place sur un segment $[a, b] \subset \mathbb{R}$. On note :

$$\mathcal{E}([a, b], \mathbb{R}) := \{ \varphi : [a, b] \rightarrow \mathbb{R} \text{ t.q. } \varphi \text{ est en escaliers sur } [a, b] \}.$$

Remarque. \int est bien définie sur $\mathcal{E}([a, b], \mathbb{R})$.

Définition 2.2. La fonction $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ est *R-int* (Riemann intégrable, ou encore intégrable au sens de Riemann) lorsque :

$$\forall \varepsilon > 0 : \exists \varphi, \psi \in \mathcal{E}([a, b], \mathbb{R}) \text{ t.q.}$$

$$(i) \quad \varphi \leq f \leq \psi$$

$$(ii) \quad \int (\psi - \varphi) < \varepsilon$$

Proposition 2.3. De manière équivalente, $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ est R-int sur $[a, b]$ lorsque :

$$\overline{\int} f := \inf_{f \leq \psi \in \mathcal{E}([a, b], \mathbb{R})} \int \psi = \sup_{f \geq \varphi \in \mathcal{E}([a, b], \mathbb{R})} \int \varphi =: \underline{\int} f.$$

Définition 2.4. On note dans ce cas :

$$\int_a^b f(x) dx = \overline{\int}_a^b f(x) dx = \underline{\int}_a^b f(x) dx.$$

Proposition 2.5. Si $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ est R-int sur $[a, b]$, alors f est bornée sur $[a, b]$.

Proposition 2.6. Soient f, g R-int, et $\lambda, \mu \in \mathbb{R}$. Alors les fonctions suivantes sont R-int :

$$\lambda f + \mu g$$

$$\min(f, g)$$

$$\max(f, g)$$

$$|f|$$

Et on a :

(i)

$$\left| \int_a^b f(x) dx \right| \leq \int_a^b |f(x)| dx ;$$

(ii)

$$\int_a^b (\lambda f + \mu g)(x) dx = \lambda \int_a^b f(x) dx + \mu \int_a^b g(x) dx.$$

Démonstration. montrons que $\min(f, g)$ est R-int sur $[a, b]$.

Fixons $\varepsilon > 0$. Soient $\varphi_f, \varphi_g, \psi_f, \psi_g \in \mathcal{E}([a, b], \mathbb{R})$ tels que :

$$\begin{aligned} \varphi_f &\leq f \leq \psi_f, & \int_a^b (\psi_f - \varphi_f) &< \varepsilon \\ \varphi_g &\leq g \leq \psi_g, & \int_a^b (\psi_g - \varphi_g) &< \varepsilon. \end{aligned}$$

Prenons $x \in [a, b]$, et remarquons que :

$$\min(\varphi_f, \varphi_g) \leq f \quad \min(\varphi_f, \varphi_g) \leq g,$$

et donc $\min(\varphi_f, \varphi_g) \leq \min(f, g)$.

Posons $\mathcal{E}([a, b], \mathbb{R}) \ni \tilde{\varphi} := \min(\varphi_f, \varphi_g), \tilde{\psi} := \min(\psi_f, \psi_g)$. On remarque alors :

$$\tilde{\varphi} \leq \min(f, g) \leq \tilde{\psi}.$$

Prenons $x \in [a, b]$. On remarque :

— si $\varphi_f(x) \leq \varphi_g(x)$, on a :

$$\tilde{\psi}(x) - \tilde{\varphi}(x) \leq \psi_f(x) - \varphi_f(x) ;$$

— si $\varphi_g(x) < \varphi_f(x)$, on a :

$$\tilde{\psi}(x) - \tilde{\varphi}(x) \leq \psi_g(x) - \varphi_g(x).$$

Ainsi, en séparant les intégrales en un nombre fini où on a soit (i), soit (ii), on a :

$$\int_a^b (\tilde{\psi} - \tilde{\varphi}) \leq \int_a^b (\psi_f - \varphi_f) + \int_a^b (\psi_g - \varphi_g) \leq 2\varepsilon.$$

□

Corollaire 2.7. $\left| \int_a^b (\lambda f + \mu g)(x) dx \right| \leq |\lambda| \int_a^b |f(x)| dx + |\mu| \int_a^b |g(x)| dx.$

2.1.2 Fonctions absolument intégrables sur un intervalle

Définition 2.8. Soit $I \neq \emptyset$, un intervalle de \mathbb{R} , et $f : I \rightarrow \mathbb{R}$. On dit que f est *abs-int* (*absolument intégrable*) sur I lorsque :

(i) $\forall [a, b] \subset I : f|_{[a, b]}$ est R-int sur $[a, b]$;

(ii) $\sup_{[a, b] \subset I} \int_a^b |f| \leq +\infty.$

Remarque. La condition (ii) revient à dire que $\exists M > 0$ t.q. $\forall [a, b] \subset I : \int_a^b |f| \leq M.$

Définition 2.9. Soit $I \subset \mathbb{R}$, un intervalle. On appelle *suite exhaustive de segments de I* toute suite $([a_n, b_n])_{n \in \mathbb{N}}$ de segments de I tels que :

- (i) la suite est croissante (c-à-d $\forall n \in \mathbb{N} : [a_{n+1}, b_{n+1}] \supseteq [a_n, b_n]$);
- (ii) $\bigcup_{n \in \mathbb{N}} [a_n, b_n] = I$.

Proposition 2.10. Soit $I \neq \emptyset$, un intervalle de \mathbb{R} . I admet une suite exhaustive.

Démonstration. Si I est un fermé, prenons $a, b \in \mathbb{R}$ tels que $I = [a, b]$. La suite $([a_n, b_n])_n = ([a, b])_n$ est exhaustive.

Si I est un ouvert, prenons $a, b \in \mathbb{R}$ tels que $I = (a, b)$. La suite $([a_n, b_n])_n = ([a + \frac{1}{n}, b - \frac{1}{n}])_n$ est exhaustive.

Si I est ouvert d'un côté, et fermé de l'autre, les suites exhaustives $([a, b - \frac{1}{n}])_n$ et $([a + \frac{1}{n}, b])_n$ sont exhaustives. \square

Proposition 2.11. Soit $I \neq \emptyset$ un intervalle de \mathbb{R} . Soit $f : I \rightarrow \mathbb{R}$ abs-int sur I . Soit $([a_n, b_n])_n$ une suite exhaustive de segments de I . Alors :

- (i) la suite définie par :

$$\left(\int_{a_n}^{b_n} f(x) dx \right)_n \subset \mathbb{R}$$

est convergente ;

- (ii) la limite de cette suite ne dépend pas de la suite exhaustive de segments de I choisie.

Définition 2.12. On appelle *intégrale de f sur I* cette valeur, et on la note :

$$\int_I f(x) dx.$$

Démonstration. Soit $([a_n, b_n])$ une suite exhaustive de segments de I . Posons pour $n \in \mathbb{N} : \alpha_n = \int_{a_n}^{b_n} |f|$. La suite $(\alpha_n)_n$ est croissante et majorée donc (α_n) converge vers un certain $\ell \in \mathbb{R}^+$. En particulier, (α_n) est de Cauchy dans \mathbb{R} . Considérons maintenant $(\beta_n)_n$, où $\beta_n := \int_{a_n}^{b_n} f$. Observons que pour $p, n \in \mathbb{N}$:

$$\beta_{n+p} - \beta_n = \int_{a_{n+p}}^{b_{n+p}} f - \int_{a_n}^{b_n} f = \int_{a_{n+p}}^{a_n} f + \int_{a_n}^{b_n} f + \int_{b_n}^{b_{n+p}} f - \int_{a_n}^{b_n} f = \int_{a_{n+p}}^{a_n} f + \int_{b_n}^{b_{n+p}} f.$$

Ainsi :

$$|\beta_{n+p} - \beta_n| \leq \int_{a_{n+p}}^{a_n} |f| + \int_{b_n}^{b_{n+p}} |f| \leq \int_{a_{n+p}}^{a_n} |f| + \int_{a_n}^{b_n} |f| + \int_{b_n}^{b_{n+p}} |f| - \int_{a_n}^{b_n} |f| = \alpha_{n+p} - \alpha_n.$$

La suite $(\beta_n)_n$ est donc bornée par une suite de Cauchy (et est donc de Cauchy) dans \mathbb{R} . Par complétude de \mathbb{R} , $(\beta_n)_n$ converge dans \mathbb{R} .

Montrons maintenant que cette limite ne dépend pas de la suite exhaustive. Soit $[\tilde{a}_n, \tilde{b}_n]$ une suite exhaustive de I . On sait que $\tilde{\beta}_n = \int_{\tilde{a}_n}^{\tilde{b}_n} f$ converge. On veut montrer que $\tilde{\beta}_n$ a la même limite que β_n . On construit donc une nouvelle suite exhaustive de I . On choisit $[\tilde{a}_0, \tilde{b}_0] = [a_0, b_0]$. Il existe $N_1 \geq 0$ t.q. $\forall n \geq N_1 : [a_0, b_0] \subset [\tilde{a}_n, \tilde{b}_n]$. On pose ensuite $[\tilde{a}_1, \tilde{b}_1] = [\tilde{a}_{N_1}, \tilde{b}_{N_1}]$. Il existe $N_2 \geq N_1$ t.q. $\forall n \geq N_2 : [\tilde{a}_1, \tilde{b}_1] \subset [a_n, b_n]$. On pose donc $[\tilde{a}_2, \tilde{b}_2] = [a_{N_2}, b_{N_2}]$.

On construit donc $\varphi : \mathbb{N} \rightarrow \mathbb{N}$ strictement croissante telle que pour tout p :

$$\begin{aligned} [\tilde{a}_{2p}, \tilde{b}_{2p}] &= [a_{\varphi(2p)}, b_{\varphi(2p)}], \\ [\tilde{a}_{2p+1}, \tilde{b}_{2p+1}] &= [\tilde{a}_{\varphi(2p+1)}, \tilde{b}_{\varphi(2p+1)}]. \end{aligned}$$

Donc la suite $([\tilde{a}_p, \tilde{b}_p])_p$ est exhaustive. La suite $\left(\int_{\tilde{a}_p}^{\tilde{b}_p} f \right)_p$ converge vers $\tilde{\beta}$ dans \mathbb{R} .

Puisque :

$$\begin{aligned} \int_{\tilde{a}_{2p}}^{\tilde{b}_{2p}} f &= \int_{a_{\varphi(2p)}}^{b_{\varphi(2p)}} f = \beta_{\varphi(2p)} \xrightarrow{p \rightarrow +\infty} \beta = \bar{\beta} \\ \int_{\tilde{a}_{2p+1}}^{\tilde{b}_{2p+1}} f &= \int_{\tilde{a}_{\varphi(2p+1)}}^{\tilde{b}_{\varphi(2p+1)}} f = \tilde{\beta}_{\varphi(2p+1)} \xrightarrow{p \rightarrow +\infty} \tilde{\beta} = \bar{\beta}, \end{aligned}$$

on déduit $\beta = \bar{\beta} = \tilde{\beta}$. Les limites sont donc les mêmes, peu importe les suites exhaustives choisies. \square

Proposition 2.13. Soit $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ R-int sur $[a, b]$. Alors f est abs-int sur $[a, b]$, et on a :

$$\int_{[a,b]} f = \int_a^b f.$$

Démonstration. f est R-int, et donc est R-int sur tout segment de $[a, b]$. Soit $([a_n, b_n])_n$, une suite exhaustive de segments de $[a, b]$. Il existe $N \in \mathbb{N}$ t.q. $\forall n \geq N : [a_n, b_n] = [a, b]$. Ainsi, pour $n \geq N$, on a :

$$\int_{a_n}^{b_n} f = \int_a^b f.$$

En passant à la limite pour $n \rightarrow +\infty$, on a :

$$\int_{[a,b]} f = \int_a^b f.$$

\square

Proposition 2.14. L'ensemble $L^1(I) := \{f : I \rightarrow \mathbb{R} \text{ t.q. } f \text{ est abs-int sur } I\}$ est un \mathbb{R} -ev. De plus, l'application :

$$\int : L^1(I) \rightarrow \mathbb{R} : f \mapsto \int_I f$$

est une forme linéaire sur $L^1(I)$.

Démonstration. EXERCICE. \square

2.1.3 Fonctions absolument intégrables vues comme fonction des bornes

Proposition 2.15. Soit $I \subset \mathbb{R}$, un intervalle non-vide de \mathbb{R} . Si la fonction $f : I \rightarrow \mathbb{R}$ est abs-int sur I , alors elle l'est sur $I \cap (-\infty, a]$ et $[a, +\infty)$ pour tout $a \in \mathbb{R}$, et on a :

$$\int_I f = \int_{I \cap (-\infty, a]} f + \int_{I \cap [a, +\infty)} f.$$

Démonstration. Soit $[\alpha, \beta] \subset [a, +\infty) \cap I$. $[\alpha, \beta]$ est un segment de I et f est abs-int sur I . f est donc abs-int sur tout segment de I , en particulier sur $[\alpha, \beta]$. De plus, il existe $M \geq 0$ tel que pour tout segment $[u, v]$ de I , on a :

$$\int_u^v |f| \leq M.$$

Ainsi :

$$\int_{\alpha}^{\beta} |f| \leq M.$$

f est donc abs-int sur $I \cap [a, +\infty)$. On raisonne de manière similaire pour $(-\infty, a]$.

Montrons maintenant l'égalité. Soit $[\alpha_n, \beta_n]$, une suite de segments de I . Il existe $N \in \mathbb{N}$ tel que :

$$\forall n \geq N : \alpha_n \leq a \leq \beta_n.$$

Il vient alors que $([\alpha_n, a])_n$ est une suite exhaustive de $I \cap (-\infty, a]$, et $([a, \beta_n])_n$ est une suite exhaustive de $I \cap [a, +\infty)$. Pour $n \geq N$, on a alors :

$$\int_{\alpha_n}^{\beta_n} f = \int_{\alpha_n}^a f + \int_a^{\beta_n} f.$$

En passant à la limite pour $n \rightarrow +\infty$, on trouve :

$$\int_I f = \int_{I \cap (-\infty, a]} f + \int_{I \cap [a, +\infty)} f.$$

□

Proposition 2.16. Soient $I \subset \mathbb{R}$, $a \in I$, et $f : I \rightarrow \mathbb{R}$. Si f est abs-int sur $I \cap (-\infty, a]$ et sur $I \cap [a, +\infty)$, alors f est abs-int sur I , et on a :

$$\int_I f = \int_{I \cap (-\infty, a]} f + \int_{I \cap [a, +\infty)} f.$$

Démonstration. Soit $[\alpha, \beta]$ un segment de I . Si $a < \alpha$, ou $a > \beta$, c'est trivial.

Supposons alors $\alpha \leq a \leq \beta$. f est R-int sur $[\alpha, a]$ et sur $[a, \beta]$. f est donc R-int sur $[\alpha, \beta]$. De plus, il existe $M^+, M^- > 0$ tels que :

$$\sum_{[u,v] \subset (-\infty, a] \cap I} \int_u^v f \leq M^- \quad \text{et} \quad \sup_{[u,v] \subset I \cap [a, +\infty)} \int_u^v |f| \leq M^+.$$

On peut donc dire que $\int_{\alpha}^{\beta} |f| \leq M^+ + M^-$. On a alors f abs-int sur I et on peut appliquer la proposition précédente pour :

$$\int_I f = \int_{I \cap (-\infty, a]} f + \int_{I \cap [a, +\infty)} f.$$

□

Proposition 2.17. Soient $I \subset \mathbb{R}$, un intervalle non-vide, et $f : I \rightarrow \mathbb{R}$ abs-int. La fonction $F : I \rightarrow \mathbb{R} : x \rightarrow \int_{I \cap (-\infty, x]} f$ est localement lipschitzienne.

Démonstration. Soit $x_0 \in I$. Supposons que x_0 n'est pas un bord de I (sinon EXERCICE). Supposons qu'il existe $\delta > 0$ t.q. $(x_0 \pm \delta) \subset I$. La fonction f est R-int sur $[x_0 \pm \frac{\delta}{2}]$ et donc sa valeur absolue est bornée sur ce segment par $M(x_0, \delta)$. Pour $x, y \in [x_0 \pm \frac{\delta}{2}]$, avec $x < y$, on déduit :

$$F(y) - F(x) = \int_{I \cap (-\infty, y]} f - \int_{I \cap (-\infty, x]} f = \int_{I \cap (-\infty, x]} f + \int_x^y f - \int_{I \cap (-\infty, x]} f = \int_x^y f.$$

D'où :

$$|F(y) - F(x)| = \left| \int_x^y f \right| \leq M(x_0, \delta)(y - x).$$

□

Corollaire 2.18. Si f est abs-int sur I , alors F est continue sur I .

Proposition 2.19. Si f est abs-int sur I , et continue en $x_0 \in I$, alors F est dérivable en x_0 et on a :

$$F'(x_0) = f(x_0).$$

Corollaire 2.20. Si f est abs-int sur I et de classe C^k sur un voisinage de $x_0 \in I$, alors F est de classe C^{k+1} sur un voisinage de x_0 et on a, sur ce voisinage :

$$\forall p \in \{0, \dots, k\} : F^{(p+1)}(x) = f^{(p)}(x).$$

Remarque. Si le voisinage est ouvert pour f , alors on a le même voisinage pour F .

Démonstration. $F(x) = F(x_0) + \int_{x_0}^x f(t) dt.$ □

Remarque. C'est donc le théorème fondamental du calcul différentiel et intégral qui est revu ici.

2.1.4 Critères d'intégration absolue

Proposition 2.21 (Critère de comparaison). Soit $I \subset \mathbb{R}$ un intervalle non-vide et $f, g : I \rightarrow \mathbb{R}$ avec :

- $\forall x \in X : |f(x)| \leq g(x)$;
- f, g R-int sur tout segment de I .

Si g est abs-int sur I , alors f l'est aussi, et on a :

$$\int_I |f| \leq \int_I g.$$

Démonstration. Il existe $M_g \geq 0$ t.q. :

$$\forall [u, v] \subset I : \int_u^v g \leq M_g.$$

Ainsi, si $[a, b] \subset I$ est un segment, on a f R-int sur $[a, b]$ et :

$$\int_a^b |f| \leq \int_a^b g \leq M_g,$$

avec M_g donc indépendant de $[a, b]$. Ceci montre que f est abs-int sur I et que :

$$\int_I |f| \leq \int_I g.$$

□

Remarque. Soient $f, g : [a, b) \rightarrow \mathbb{R}$. On dit que f est équivalent à g en b^- lorsque :

$$\forall \varepsilon > 0 : \exists \eta > 0 \text{ t.q. } \forall x \in [b - \eta, b) : |f(x) - g(x)| \leq \varepsilon |f(x)|.$$

Proposition 2.22. Soit $I = [a, b)$, et soit $f, g : I \rightarrow \mathbb{R}$, R-int sur tout segment de I . Alors :

1. si $f \underset{b^-}{\sim} g(x)$, alors f est abs-int sur I si et seulement si g l'est ;
2. dans le cas abs-int, on a :

$$\int_x^b |f| \underset{b^-}{\sim} \int_x^b g.$$

Dans le cas non-abs-int, on a :

$$\int_a^x |f| \underset{b^-}{\sim} \int_a^x g.$$

Démonstration.

— Supposons f abs-int. Pour $\varepsilon = 1$, il existe $\eta > 0$ tel que :

$$\forall x \in [b - \eta, b) : \left| |f(x)| - g(x) \right| \leq \varepsilon |f(x)| = |f(x)|.$$

On en déduit $(0 \leq g(x) \leq 2|f(x)|)$ sur $[b - \eta, b)$. Ainsi, par le critère de comparaison, g est abs-int sur $[b - \eta, b)$. De plus, g est abs-int sur $[a, b - \eta]$ pour tout η , et donc g est abs-int sur $[a, b)$. On montre que si g est abs-int, alors f est abs-int, de la même manière (critère de comparaison).

— Dans le cas abs-int, fixons $\varepsilon > 0$. Il existe $\eta > 0$ tel que pour $x \in [b - \eta, b)$, on a $\left| |f(x)| - g(x) \right| \leq \varepsilon g(x)$. Pour $x > b - \eta$, il vient :

$$\left| \int_x^b |f| - \int_x^b g \right| \leq \int_x^b \left| |f| - g \right|,$$

d'où $\int_x^b |f(t)| dt$ abs-int.

Dans le cas non-abs-int, fixons $\varepsilon > 0$. Il existe η_1 tel que pour $x \in [b - \eta_1, b)$, on a :

$$\left| |f(x)| - g(x) \right| \leq \varepsilon g(x).$$

Pour $x \geq b - \eta_1$, on a :

$$\left| \int_a^x |f| - \int_a^x g \right| \leq \int_a^{b-\eta_1} \left| |f(t)| - g(t) \right| dt + \int_{b-\eta_1}^x \left| |f(t)| - g(t) \right| dt.$$

Puisque g n'est pas abs-int sur $[a, b)$, il existe $\eta_2 \in (b, b + \eta_1)$ tel que pour $x \geq b - \eta_2$, on a :

$$\frac{\int_a^{b-\eta_1} \left| |f| - g \right|}{\int_a^x g} \leq \varepsilon.$$

Par suite, on a pour $x \geq b - \eta_2$:

$$\left| \int_a^x |f| - \int_a^x g \right| \leq \varepsilon \int_a^x g + \varepsilon \int_{b-\eta_1}^x g \leq 2\varepsilon \int_a^x g.$$

□

2.1.5 Fonctions de référence de Riemann

Proposition 2.23. Soit $\alpha \in \mathbb{R}$. $x \mapsto x^{-\alpha}$ est abs-int sur $[1, +\infty)$ si et seulement si $\alpha > 1$.

Démonstration. Remarquons que $x \mapsto x$ est continue sur $[1, +\infty)$, et donc R-int sur tout segment de $[1, +\infty)$. De plus, elle est positive sur $[1, +\infty)$. Pour $X \geq 1$, on a :

$$\int_1^X \left| \frac{1}{x^\alpha} \right| dx = \int_1^X \frac{dx}{x^\alpha} = \int_1^X x^{-\alpha} dx.$$

— si $\alpha \neq 1$, alors :

$$\int_1^X x^{-\alpha} dx = \frac{1}{1-\alpha} \left[x^{1-\alpha} \right]_1^X = \frac{X^{1-\alpha}}{1-\alpha} = \frac{1}{1-\alpha};$$

— si $\alpha \geq 1$, alors :

$$\int_1^x \frac{dx}{x^\alpha} \xrightarrow{x \rightarrow +\infty} \frac{1}{1-\alpha},$$

et :

$$\int_1^x |x^{-\alpha}| dx \leq \frac{1}{1-\alpha}.$$

Donc l'intégrale de $x \mapsto x^{-\alpha}$ sur les segments de $[1, +\infty)$ est majorée indépendamment du segment, donc cette fonction est abs-int sur $[1, +\infty)$.

— si $\alpha \leq 1$, alors :

$$\int_1^x \frac{dx}{x^\alpha} \xrightarrow{x \rightarrow +\infty} +\infty.$$

Donc l'intégrale de $x \mapsto x^{-\alpha}$ sur les segments de $[1, +\infty)$ n'est pas majorée indépendamment du segment, donc cette fonction n'est pas abs-int sur $[1, +\infty)$.

Finalement, si $\alpha = 1$, alors :

$$\int_1^x \frac{dx}{x} = [\ln x]_1^x = \ln x \xrightarrow{x \rightarrow +\infty} +\infty.$$

À nouveau, l'intégrale n'est pas bornée sur les segments de $[1, +\infty)$, indépendamment du segment, et donc $x \mapsto x^{-1}$ n'est pas abs-int sur $[1, +\infty)$. \square

Proposition 2.24. Soit $\alpha \in \mathbb{R}$. $x \mapsto x^{-\alpha}$ est abs-int sur $(0, 1]$ si et seulement si $\alpha \leq 1$.

Démonstration. EXERCICE. \square

Exemple 2.1. La fonction $x \mapsto \frac{1}{\sqrt{x}} = x^{-\frac{1}{2}}$ est absolument intégrable sur $(0, 1]$.

2.1.6 Théorème du changement de variable

Théorème 2.25. Soient I, J , deux intervalles non-vides de \mathbb{R} et non réduits à un point. Soit $\varphi : I \rightarrow J$ bijective et strictement croissante de classe C^1 sur I . Soit $f : J \rightarrow \mathbb{R}$ R-int sur tout segment de J . La fonction f est abs-int sur J si et seulement si $(f \circ \varphi) \cdot \varphi' : I \rightarrow \mathbb{R}$ est abs-int sur I , et on a :

$$\int_I ((f \circ \varphi) \varphi') (x) dx = \int_J f(y) dy.$$

Démonstration. Soit $([a_n, b_n])_n$ une suite exhaustive de segments de I . La suite $([\varphi(a_n), \varphi(b_n)])_n$ est une suite exhaustive de segments de J (car φ est bijective). Puisque :

$$\forall n \in \mathbb{N} : \int_{a_n}^{b_n} |(f \circ \varphi) \varphi'| = \int_{a_n}^{b_n} |(f \circ \varphi)| \varphi' = \int_{\varphi(a_n)}^{\varphi(b_n)} |f|,$$

par CDI 1, on conclut que $(f \circ \varphi) \varphi'$ est abs-int sur I si f l'est sur J .

On raisonne de manière similaire avec φ^{-1} (qui existe car φ est une bijection) pour montrer que f est abs-int sur J si $(f \circ \varphi) \varphi'$ l'est sur I .

Dans ce cas, si $([a_n, b_n])_n$ est une suite exhaustive de segments de I , on a :

$$\forall n \geq 0 : \int_{a_n}^{b_n} (f \circ \varphi) \varphi' = \int_{\varphi(a_n)}^{\varphi(b_n)} f.$$

En passant à la limite pour $n \rightarrow +\infty$, on obtient :

$$\int_I (f \circ \varphi) \varphi' = \int_J f,$$

car $([\varphi(a_n), \varphi(b_n)])_n$ est une suite exhaustive de J . □

2.2 Intégrales convergentes

2.2.1 Définitions et exemples

Définition 2.26. Soit $I \subset \mathbb{R}$, un intervalle non-vidé, et soit $f : I \rightarrow \mathbb{R}$ R-int sur tous les segments de I . On dit que l'intégrale de f sur I converge lorsque :

- (i) $\forall ([a_n, b_n])_n$ exhaustive de I : $\left(\int_{a_n}^{b_n} f\right)_n$ converge dans \mathbb{R} ;
- (ii) la limite ne dépend pas de la suite exhaustive choisie.

On note cette limite $\int_I f$.

Proposition 2.27. Si f est abs-int sur I , alors son intégrale sur I converge et on a :

$$\int_I f(x) dx = \int_I f(x) dx,$$

c-à-d, les deux notions ont le même sens pour la même notation.

Démonstration. Par le résultat X □

Exemple 2.2. La fonction $x \mapsto \frac{\sin x}{x}$ a une intégrale convergente sur $[1, +\infty)$ mais n'est pas abs-int sur $[1, +\infty)$.

On remarque que $\frac{\sin x}{x}$ est continue sur $[1, +\infty)$ et donc R-int sur tout segment de I . Soit $([a_n, b_n])_n$, une suite exhaustive de segments de $[1, +\infty)$. Pour $n \in \mathbb{N}$, écrivons :

$$\int_{a_n}^{b_n} \frac{\sin x}{x} dx = \left[-\frac{\cos x}{x} \right]_{a_n}^{b_n} + \int_{a_n}^{b_n} \frac{\cos x}{x^2} dx.$$

On sait que $\left| \frac{\cos x}{x^2} \right| \leq \frac{1}{x^2}$ sur $[1, +\infty)$. Par le critère de comparaison, puisque $x \mapsto \frac{1}{x^2}$ est abs-int sur $[1, +\infty)$, on sait que $x \mapsto \frac{\cos x}{x^2}$ l'est également. Ainsi, la suite :

$$\left(\int_{a_n}^{b_n} \frac{\cos x}{x^2} dx \right)_n$$

converge dans \mathbb{R} vers une limite qui ne dépend pas de la suite $([a_n, b_n])_n$ choisie. Par ailleurs :

$$\left[-\frac{\cos x}{x} \right]_{a_n}^{b_n} = \frac{-\cos b_n}{b_n} + \frac{\cos a_n}{a_n} \xrightarrow{[a_n, b_n] \rightarrow [1, +\infty)} 0 + \cos 1.$$

Donc la suite $\left(\int_{a_n}^{b_n} \frac{\sin x}{x} dx \right)_n$ converge vers une limite indépendante de la suite exhaustive de segments choisie. Donc l'intégrale de $x \mapsto \frac{\sin x}{x}$ converge dans $[1, +\infty)$.

Montrons maintenant que la fonction n'est pas abs-int. Soit $n \in \mathbb{N}^*$. On sait :

$$\int_{\pi}^{n\pi} \left| \frac{\sin x}{x} \right| dx = \sum_{k=1}^{n-1} \int_{k\pi}^{(k+1)\pi} \left| \frac{\sin x}{x} \right| dx \geq \sum_{k=1}^{n-1} \int_{k\pi}^{(k+1)\pi} \frac{|\sin x|}{(k+1)\pi} dx \geq \sum_{k=1}^{n-1} \frac{\int_0^\pi |\sin x|}{(k+1)\pi} = \frac{\int_0^\pi |\sin x|}{\pi} \sum_{k=1}^{n-1} \frac{1}{k+1} \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} +\infty.$$

On a donc bien $x \mapsto \frac{\sin x}{x}$ non-abs-int sur $[1, +\infty)$.

Exemple 2.3. $\text{sign} : x \mapsto \begin{cases} 1 & \text{si } x > 0 \\ 0 & \text{si } x = 0 \\ -1 & \text{si } x < 0 \end{cases}$ n'admet pas d'intégrale convergente dans \mathbb{R} . Par exemple :

$$\int_{-n}^{n^2} \text{sign}(x) dx = n^2 - n \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} +\infty.$$

Proposition 2.28. Soient $I \subset \mathbb{R}$, un intervalle non-vide, $f : I \rightarrow \mathbb{R}$, R -int sur tout segment de I . L'intégrale de f converge sur I si et seulement si pour toute suite exhaustive de segments $([a_n, b_n])_n$ de I , la suite $\left(\int_{a_n}^{b_n} f(x) dx\right)_n$ est de Cauchy.

Démonstration. TODO □

2.2.2 Rappel : deuxième formule de la moyenne

Pour rappel, la première formule de la moyenne est donnée par :

Soient $f, g : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$, de classe C^0 sur $[a, b]$, avec $g \geq 0$. Il existe $c \in [a, b]$ tel que :

$$\int_a^b (fg)(t) dt = f(c) \int_a^b g(t) dt.$$

Proposition 2.29. Soit $[a, b]$, un segment de \mathbb{R} , et soient $f, g : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$, avec f R -int sur $[a, b]$, et $g \geq 0$, décroissante sur $[a, b]$. Alors il existe $c \in [a, b]$ tel que :

$$\int_a^b (fg)(t) dt = g(a) \int_a^c f(t) dt.$$

Démonstration. On fixe $N \in \mathbb{N}^*$, et on pose $t_n := a + n \frac{b-a}{N}$ pour $0 \leq n \leq N$. Écrivons :

$$I_N := \sum_{k=0}^{N-1} \int_{t_k}^{t_{k+1}} f(t)g(t_k) dt.$$

On observe alors :

$$I_N - \int_a^b (fg)(t) dt = \sum_{k=0}^{N-1} f(t_k)(g(t_k) - g(t_{k+1})).$$

On trouve donc :

$$\begin{aligned} \left| I_N - \int_a^b (fg)(t) dt \right| &\leq \sum_{k=0}^{N-1} \int_{t_k}^{t_{k+1}} |f(t)| |g(t_k) - g(t)| dt = \sum_{k=0}^{N-1} \int_{t_k}^{t_{k+1}} |f(t)| (g(t_k) - g(t)) dt \\ &\leq \sum_{k=0}^{N-1} \int_{t_k}^{t_{k+1}} |f(t)| (g(t_k) - g(t_{k+1})) dt. \end{aligned}$$

Rappelons que la fonction $K : [a, b] \rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \int_a^x |f(t)| dt$ est lipschitzienne de constante $\|f\|_{\infty, [a, b]} =: M$. Ainsi :

$$\begin{aligned} \left| I_N - \int_a^b (fg)(t) dt \right| &\leq \sum_{k=0}^{N-1} |K(t_{k+1}) - K(t_k)| (g(t_k) - g(t_{k+1})) \leq M \sum_{k=0}^{N-1} (t_{k+1} - t_k) (g(t_k) - g(t_{k+1})) \\ &= \frac{M(b-a)}{N} \sum_{k=0}^{N-1} (g(t_k) - g(t_{k+1})) \leq \frac{M(b-a)}{N} (g(a) - g(b)) \xrightarrow{N \rightarrow +\infty} 0. \end{aligned}$$

On en déduit que $(I_N)_{N \geq 1}$ converge, et :

$$\lim_{N \rightarrow +\infty} I_N = \int_a^b (fg)(t) dt.$$

Par ailleurs, pour $N \geq 1$, on a :

$$I_N = \sum_{k=0}^{N-1} \int_{t_k}^{t_{k+1}} f(x) dx g(t_k).$$

Posons ensuite :

$$F : [a, b] \rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \int_a^x f(t) dt.$$

On sait que F est continue sur le segment $[a, b]$, donc minorée par m et majorée par M . En appliquant une transformation d'Abel, on trouve :

$$\begin{aligned} I_N &= \sum_{k=0}^{N-1} (F(t_{k+1}) - F(t_k)) g(t_k) = \sum_{k=0}^{N-1} F(t_{k+1}) g(t_k) - \sum_{k=0}^{N-1} F(t_k) g(t_k) \\ &= \sum_{k=1}^N F(t_k) g(t_{k-1}) - \sum_{k=0}^{N-1} F(t_k) g(t_k) \\ &= -F(t_0) g(t_0) + \sum_{k=1}^{N-1} F(t_k) (g(t_{k-1}) - g(t_k)) + F(t_N) g(t_{N-1}). \end{aligned}$$

Par suite, on sait que $F(t_0) = F(a) = \int_a^a f = 0$, on peut donc exprimer :

$$m \sum_{k=1}^{N-1} (g(t_{k-1}) - g(t_k)) g(t_k) + m g(t_{N-1}) \leq I_N \leq M \sum_{k=1}^{N-1} (g(t_{k-1}) - g(t_k)) + M g(t_{N-1}).$$

En développant les sommes, on trouve :

$$m g(a) \leq I_N \leq M g(a).$$

En passant à la limite pour $N \rightarrow +\infty$, on trouve :

$$m g(a) \leq \int_a^b (fg)(t) dt \leq M g(a).$$

Distinguons alors deux cas :

- si $g(a) = 0$, alors $g \equiv 0$ sur $[a, b]$, et donc tout $c \in [a, b]$ convient ;
- si $g(a) \neq 0$, alors :

$$m \leq \frac{1}{g(a)} \int_a^b (fg)(t) dt \leq M.$$

La fonction F étant continue sur le segment $[a, b]$, par le théorème des valeurs intermédiaires, il existe $c \in [a, b]$ tel que :

$$F(c) = \frac{1}{g(a)} \int_a^b (fg)(t) dt,$$

et donc en remultipliant par $g(a)$ de par et d'autre, on obtient :

$$g(a) F(c) = g(a) \int_a^c f(t) dt = \int_a^b (fg)(t) dt.$$

□

2.2.3 Critère d'Abel

Proposition 2.30 (Critère d'Abel pour la convergence des intégrales). Soient $-\infty < a < b \leq +\infty$, $f, g : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ telles que :

— f est R-int sur tout segment de $[a, b]$ et il existe $M \geq 0$ tel que :

$$\forall x \in [a, b] : \left| \int_a^x f(t) dt \right| \leq M ;$$

— g est positive et décroissante vers 0 en b^- sur $[a, b]$.

Alors l'intégrale de fg converge sur I .

Démonstration. Soit $([a_n, b_n])_n$ une suite exhaustive de segments de $[a, b]$. Posons, pour $n \in \mathbb{N}$:

$$\alpha_n := \int_{a_n}^{b_n} (fg)(t) dt.$$

Observons pour $n, p \in \mathbb{N}$:

$$\alpha_{n+p} - \alpha_n = \int_{a_{n+p}}^{b_{n+p}} (fg)(t) dt - \int_{a_n}^{b_n} (fg)(t) dt.$$

Puisque $a_n = a$ à partir d'un certain $N \in \mathbb{N}$, on peut écrire :

$$\alpha_{n+p} - \alpha_n = \int_{b_n}^{b_{n+p}} (fg)(t) dt = g(b_n) \int_{b_n}^{c_{n+p}} f(t) dt,$$

pour un certain $c_{n+p} \in [b_n, b_{n+p}]$ par la deuxième formule de la moyenne. On trouve finalement :

$$|\alpha_{n+p} - \alpha_n| \leq g(b_n) \left| \int_{b_n}^{c_{n+p}} f(t) dt - \int_{b_n}^{b_n} f(t) dt \right| \leq 2Mg(b_n) \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} 0,$$

par décroissance de g vers 0.

La suite (α_n) est donc une suite de Cauchy, ce qui implique que l'intégrale de (fg) converge sur $[a, b]$, par le critère de Cauchy. \square

Exemple 2.4. Prenons $\beta \in (0, 1)$. La fonction $x \mapsto \frac{\sin x}{x^\beta}$ est d'intégrale convergente sur $[1, +\infty)$ car :

— $f : [1, +\infty) : x \mapsto \sin x$ est R-int sur tous les segments de $[1, +\infty)$, et pour $x \geq 1$, on a :

$$\left| \int_1^x \sin t dt \right| \leq 2 ;$$

— g est positive et décroissante vers 0 en $+\infty$.

La convergence est assurée par le critère d'Abel.

Exemple 2.5. Les fonctions $x \mapsto \sin(x^2)$ et $x \mapsto \cos(x^2)$ sont d'intégrale convergente sur \mathbb{R}^+ . Soit $([\alpha_n, \beta_n])_n$, une suite exhaustive de segments de \mathbb{R}^+ . Pour $n \geq 0$, écrivons :

$$\int_{\alpha_n}^{\beta_n} \sin(x^2) dx = \int_{\alpha_n^2}^{\beta_n^2} \sin t \frac{dt}{\sqrt{t}}$$

pour $t = x^2$, $dt = 2x dx$. On a donc :

$$\frac{1}{2} \int_{\alpha_n^2}^{\beta_n^2} \sin t \frac{dt}{\sqrt{t}} = \frac{1}{2} \int_{\alpha_n^2}^{\beta_n^2} \sin t \frac{dt}{\sqrt{t}} + \frac{1}{2} \int_{\alpha_n^2}^{\beta_n^2} \sin t \frac{dt}{\sqrt{t}}.$$

La fonction $t \mapsto \frac{\sin t}{\sqrt{t}}$ est C^0 sur $(0, 1]$ et prolongeable en 0 par continuité. Elle est donc abs-int sur $(0, 1]$. Donc $\int_{\alpha_n^2}^1 \sin t \frac{dt}{\sqrt{t}}$ converge et la limite ne dépend pas de la suite $\alpha_n \rightarrow 0$ choisie. La fonction $t \mapsto \sin t$ est R-int sur tout segment de $[1, +\infty)$, avec :

$$\left| \int_1^x \sin t \, dt \right| \leq 2.$$

La fonction $t \mapsto \frac{1}{\sqrt{t}}$ est décroissante vers 0 en $+\infty$. Alors par le critère d'Abel, $\int_1^{\beta_n^2} \sin t \frac{dt}{\sqrt{t}}$ converge et la limite ne dépend pas de la suite $\beta \rightarrow +\infty$ choisie.

On en déduit que $x \mapsto \sin(x^2)$ est d'intégrale convergente sur \mathbb{R}^+ . On raisonne de manière similaire pour $x \mapsto \cos(x^2)$.

Chapitre 3

Intégrales à paramètres

3.1 Fonctions définies par une intégrale sur un segment fixe

3.1.1 Un résultat de continuité

Définition 3.1. L'ensemble X est dit *localement compact* lorsque :

$$\forall x \in X : \forall O \text{ ouvert} : x \in O \Rightarrow \exists V \in \mathcal{V}(x) \text{ t.q. } O \subset V.$$

Proposition 3.2. Soit $[a, b]$ un segment de \mathbb{R} , et (X, d) un espace métrique localement compact. Si $f : X \times [a, b] \rightarrow \mathbb{R} : (x, t) \mapsto f(x, t)$ est continue sur $X \times [a, b]$, alors :

$$F : X \rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \int_a^b f(x, t) dt$$

est définie, et continue sur X .

Démonstration. Soit $x \in X$. $t \mapsto f(x, t)$ est continue sur $[a, b]$, donc R-int sur $[a, b]$. La fonction F est donc en effet définie.

Soit $x \in X$ et soit $V \in \mathcal{V}(x)$ compact dans X . La fonction :

$$V \times [a, b] \rightarrow \mathbb{R} : (x, t) \mapsto f(x, t)$$

est continue sur $X \times [a, b]$. En particulier, par le théorème de Heine, elle est uniformément continue sur $V \times [a, b]$, car $V \times [a, b]$ est compact. Soit $\varepsilon > 0$ et soit $x_0 \in X$. Il existe $\eta > 0$ et $\delta > 0$ tels que : $\forall x, y \in X : \forall t, t' \in [a, b]$, si $d(x, y) < \eta$ et $|t' - t| < \delta$, et $B(x_0, \eta) \subset V$, alors $|f(x, t) - f(y, t')| \leq \varepsilon$.

En particulier, pour $x \in B(x_0, \eta)$ et $t \in [a, b]$, on a :

$$|f(x, t) - f(x_0, t)| < \varepsilon.$$

Par intégration, on trouve :

$$|F(x) - F(x_0)| \leq \int_a^b |f(x, t) - f(x_0, t)| dt \leq \varepsilon(b - a).$$

□

Remarque. Cette proposition est encore vraie pour un compact $\prod_{i=1}^n [a_i, b_i]$, au lieu de $[a, b]$.

Exemple 3.1. Que dire de $\lim_{x \rightarrow 0^+} \int_0^1 \sin(\exp(-xt) - 1) dt$?

$f : [0, 1] \times [0, 1] \rightarrow \mathbb{R} : (x, t) \mapsto \sin(\exp(-xt) - 1)$ est continue sur $[0, 1] \times [0, 1]$, d'où $F(x) = \int_0^1 f(x, t) dt$ est de classe C^0 sur $[0, 1]$, avec la proposition précédente. Donc $F(x) \xrightarrow{x \rightarrow 0^+} 0$.

3.1.2 Un résultat de dérivabilité

Proposition 3.3. Soient $X \subset \mathbb{R}^d$, un ouvert non-vide, $[a, b] \subset \mathbb{R}$, un segment, et $f : X \times [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$, continue sur $X \times [a, b]$ admettant une dérivée partielle par rapport à tout x_i en tout point de X tel que :

$$\forall i \in \llbracket 1, d \rrbracket : X \times [a, b] \rightarrow \mathbb{R} : \frac{\partial f}{\partial x_i}(x, t) \in C^0(X \times [a, b], \mathbb{R}).$$

Alors la fonction $F : X \rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \int_a^b f(x, t) dt$ est de classe C^1 sur $X \times [a, b]$, et on a :

$$\forall i \in \llbracket 1, d \rrbracket : \frac{\partial F}{\partial x_i}(x) = \int_a^b \frac{\partial f}{\partial x_i}(x, t) dt.$$

Démonstration. Pour $x_0 \in X, \delta > 0$ t.q. $B(x_0, \delta) \subset X$, puisque $x \mapsto f(x, t)$ est de classe C^1 sur $B(x_0, \delta)$, pour $t \in [a, b]$, on peut écrire :

$$f(x_0 + he_i, t) - f(x_0, t) = \int_0^h \frac{\partial f}{\partial x_i}(x_0 + se_i, t) ds.$$

Ces fonctions étant continues, elles sont R-int, et on a :

$$\int_a^b (f(x_0 + he_i, t) - f(x_0, t)) dt = \int_a^b \int_0^h \frac{\partial f}{\partial x_i}(x_0 + se_i, t) ds dt = \int_a^b h \int_0^1 \frac{\partial f}{\partial x_i}(x_0 + hse_i, t) ds dt.$$

Pour $h \in \left[-\frac{\delta}{2}, \frac{\delta}{2}\right] \setminus \{0\}$, et en posant :

$$g = \left[-\frac{\delta}{2}, \frac{\delta}{2}\right] \times ([0, 1] \times [a, b]) : (h, (s, t)) \mapsto \frac{\partial f}{\partial x_i}(x_0 + hse_i, t),$$

on a :

$$\frac{1}{h} \int_a^b (f(x_0 + he_i, t) - f(x_0, t)) dt = \int_a^b \int_0^1 g(h, (s, t)) ds dt.$$

Or la fonction g est continue sur son compact de définition, par continuité de f . Par la Proposition 3.2, on sait que la fonction :

$$h \mapsto \int_a^b \int_0^1 g(h, (s, t)) ds dt \in C^0\left(\left[-\frac{\delta}{2}, \frac{\delta}{2}\right], \mathbb{R}\right).$$

Par cette continuité, on déduit que la fonction $h \mapsto \frac{1}{h} (F(x_0 + he_i) - F(x_0))$ admet une limite finie en $h = 0$ qui est $\int_a^b \int_0^1 g(0, (s, t)) ds dt$. On en déduit que f admet une dérivée partielle par rapport à x_i en x_0 , et on a :

$$\frac{\partial F}{\partial x_i} = \int_a^b \int_0^1 \frac{\partial f}{\partial x_i}(x_0 + 0, t) ds dt = \int_a^b \frac{\partial f}{\partial x_i}(x_0, t) \int_0^1 ds dt = \int_a^b \frac{\partial f}{\partial x_i}(x_0, t) dt.$$

À nouveau, par la Proposition 3.2 appliquée à $(x, t) \mapsto \frac{\partial f}{\partial x_i}(x, t)$, on obtient $\frac{\partial F}{\partial x_i} \in C^0(X, \mathbb{R})$, ce qui implique $F \in C^1(X, \mathbb{R})$, et on a bien la formule ci-dessus. \square

3.2 Fonction définies par des intégrales sur un segment variable

3.2.1 Un résultat de continuité

Théorème 3.4. Soit $f : [\alpha, \beta] \times [a, b] \xrightarrow{C^0} \mathbb{R}$. La fonction $F : [\alpha, \beta] \times [a, b] \rightarrow \mathbb{R} : (x, T) \mapsto \int_a^T f(x, t) dt$ est continue sur $[\alpha, \beta] \times [a, b]$.

Démonstration. Soient $(x, T) \in [\alpha, \beta] \times [a, b]$, $(\Delta x, \Delta T) \in \mathbb{R}^2$ tels que :

$$(x + \Delta x, T + \Delta T) \in [\alpha, \beta] \times [a, b].$$

Écrivons alors :

$$\begin{aligned} F(x + \Delta x, T + \Delta T) - F(x, T) &= \int_a^{T+\Delta T} f(x + \Delta x, t) dt - \int_a^T f(x, t) dt \\ &= \int_a^T f(x + \Delta x, t) dt + \int_T^{T+\Delta T} f(x + \Delta x, t) dt - \int_a^T f(x, t) dt \\ &= \int_a^T (f(x + \Delta x, t) - f(x, t)) dt + \int_T^{T+\Delta T} f(x + \Delta x, t) dt. \end{aligned}$$

Par continuité de f sur le compact $[\alpha, \beta] \times [a, b]$ et le théorème de Heine, on peut dire que f est uniformément continue sur ce compact. On a alors pour $\varepsilon > 0$, il existe $\eta > 0$ tel que si $|\Delta x| \leq \eta$, alors :

$$\forall t \in [a, b] : |f(x + \Delta x, t) - f(x, t)| < \frac{\varepsilon}{b - a},$$

et donc :

$$\left| \int_a^T (f(x + \Delta x, t) - f(x, t)) dt \right| \leq (T - a) \max_{t \in [a, b]} |f(x + \Delta x, t) - f(x, t)| \leq \varepsilon.$$

Par ailleurs, la fonction f est bornée sur son compact de définition. Donc il existe $M > 0$ tel que $\forall (y, t) \in [\alpha, \beta] \times [a, b] : |f(y, t)| \leq M$. Si $|\Delta T| < \frac{\varepsilon}{M}$, on observe :

$$\left| \int_T^{T+\Delta T} f(x + \Delta x, t) dt \right| \leq M |\Delta T| < \varepsilon.$$

Dès lors, pour $|\Delta x| < \eta$ et $|\Delta T| < \frac{\varepsilon}{M}$, on a :

$$|F(x + \Delta x, T) - F(x, T)| < \varepsilon.$$

On a en effet trouvé un voisinage de (x, T) qui est envoyé sur un voisinage de $F(x, T)$. La fonction F est donc continue. \square

Corollaire 3.5. Soit $f : [\alpha, \beta] \times [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ continue. Soient $\phi, \psi : [\alpha, \beta] \rightarrow [a, b]$ continues sur $[\alpha, \beta]$. La fonction $F : [\alpha, \beta] \rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \int_{\phi(x)}^{\psi(x)} f(x, t) dt$ est continue sur $[\alpha, \beta]$.

Démonstration. Posons $G : [\alpha, \beta] \times [a, b] \rightarrow \mathbb{R} : (x, T) \mapsto \int_a^T f(x, t) dt$. Par le théorème précédent, on peut dire $G \in C^0([\alpha, \beta] \times [a, b], \mathbb{R})$. De plus, pour $x \in [a, b]$, on peut écrire :

$$F(x) = \int_a^{\psi(x)} f(x, t) dt - \int_a^{\phi(x)} f(x, t) dt = G(x, \psi(x)) - G(x, \phi(x)).$$

Par continuité des fonctions G, ψ, ϕ , on sait que $x \mapsto G(x, \psi(x))$ et $x \mapsto G(x, \phi(x))$ sont continues sur $[\alpha, \beta]$ par composition de fonctions continues. Ensuite, on peut dire que F est continue sur $[\alpha, \beta]$ par différence de fonctions continues. \square

3.2.2 Un résultat de dérivabilité

Théorème 3.6. Soit $f : [\alpha, \beta] \times [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ continue sur $[\alpha, \beta] \times [a, b]$ telle que $\frac{\partial f}{\partial x}$ existe en tout point de $[\alpha, \beta] \times [a, b]$ et $(x, t) \mapsto \frac{\partial f}{\partial x}(x, t)$ est continue sur $[\alpha, \beta] \times [a, b]$. Alors la fonction $F : [\alpha, \beta] \times [a, b] \rightarrow \mathbb{R} : (x, T) \mapsto \int_a^T f(x, t) dt$ est de classe C^1 sur $[\alpha, \beta] \times [a, b]$ avec :

$$\frac{\partial F}{\partial x}(x, t) = \int_a^T \frac{\partial f}{\partial x}(x, t) dt \quad \text{et} \quad \frac{\partial F}{\partial T}(x, T) = f(x, T).$$

Démonstration. Avec le résultat de dérivabilité sur segment fixe (Proposition 3.3), on sait que $\frac{\partial F}{\partial x}(x, T)$ existe en tout point et vaut $\frac{\partial F}{\partial x}(x, T) = \int_a^T \frac{\partial f}{\partial x}(x, t) dt$, avec $\frac{\partial f}{\partial x}(x, T) \in C^0([\alpha, \beta] \times [a, b], \mathbb{R})$ par le Théorème 3.4.

De plus, par CDI 1, on sait que $\frac{\partial F}{\partial T}(x, T)$ existe et vaut $f(x, T)$ (continue par hypothèse) car $f(x, \cdot) \in C^0([a, b], \mathbb{R})$. On sait également que $T \mapsto \int_a^T \frac{\partial f}{\partial T}(x, t) dt \in C^1([\alpha, \beta] \times [a, b], \mathbb{R})$.

On a donc bien $F \in C^1([\alpha, \beta] \times [a, b], \mathbb{R})$. \square

Proposition 3.7. Soit $f : [\alpha, \beta] \times [a, b] \xrightarrow{C^0} \mathbb{R}$ telle que $\frac{\partial f}{\partial x}$ existe et est continue en tout point du compact de définition de f . Soient $\psi, \phi : [\alpha, \beta] \xrightarrow{C^1} [a, b]$. La fonction $F : [\alpha, \beta] \rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \int_{\phi(x)}^{\psi(x)} f(x, t) dt$ est de classe C^1 sur $[\alpha, \beta]$ et on a :

$$\forall x \in [\alpha, \beta] : F'(x) = \psi'(x)f(x, \psi(x)) - \phi'(x)f(x, \phi(x)) + \int_{\phi(x)}^{\psi(x)} \frac{\partial f}{\partial x}(x, t) dt.$$

Démonstration. La fonction $G : [\alpha, \beta] \times [a, b] \rightarrow \mathbb{R} : (x, T) \mapsto \int_a^T f(x, t) dt$ est de classe C^1 par le Théorème 3.6, et on a :

$$\frac{\partial G}{\partial x}(x, T) = \int_a^T \frac{\partial f}{\partial x}(x, t) dt \quad \text{et} \quad \frac{\partial G}{\partial T}(x, T) = f(x, T).$$

Par composition de fonctions de classe C^1 , on sait que $x \mapsto G(x, \phi(x))$ et $x \mapsto G(x, \psi(x))$ sont de classe C^1 sur $[\alpha, \beta]$. Par ailleurs, pour $x \in [\alpha, \beta]$, on a :

$$F(x) = G(x, \psi(x)) - G(x, \phi(x)).$$

Par différence, on trouve donc $F \in C^1([\alpha, \beta], \mathbb{R})$, et pour $x \in [\alpha, \beta]$, on trouve :

$$\begin{aligned} F'(x) &= \frac{\partial G}{\partial x}(x, \psi(x)) + \frac{\partial G}{\partial T}(x, \psi(x))\psi'(x) - \frac{\partial G}{\partial x}(x, \phi(x)) - \frac{\partial G}{\partial T}(x, \phi(x))\phi'(x) \\ &= \int_a^{\psi(x)} \frac{\partial f}{\partial x}(x, t) dt + \psi'(x)f(x, \psi(x)) - \int_a^{\phi(x)} \frac{\partial f}{\partial x}(x, t) dt - \phi'(x)f(x, \phi(x)) \\ &= \int_{\phi(x)}^{\psi(x)} \frac{\partial f}{\partial x}(x, t) dt + \psi'(x)f(x, \psi(x)) - \phi'(x)f(x, \phi(x)). \end{aligned}$$

\square

3.3 Fonctions définies par des intégrales convergentes

3.3.1 Exemple

Soit $f : \mathbb{R}^+ \times \mathbb{R}^+ \rightarrow \mathbb{R}^+ : (x, t) \mapsto x \exp(-xt)$. Que dire de $F(x) = \int_0^{+\infty} f(x, t) dt$?

Fixons $x \in \mathbb{R}^+$. La fonction $t \mapsto x \exp(-xt)$ est R-int sur tout segment de \mathbb{R}^+ . De plus, $|f(x, t)| t^2 \xrightarrow{t \rightarrow +\infty} 0$ si $x > 0$. Donc il existe $A_n \geq 0$ tel que :

$$\forall t \geq A_n : |f(x, t)| \leq \frac{1}{t^2}.$$

Par le critère de comparaison, la fonction $t \mapsto f(\cdot, t)$ est abs-int sur $[A_n, +\infty)$. Si la fonction est abs-int sur $[0, A_n]$, alors elle l'est sur $[0, +\infty)$. Lorsque $x = 0$, alors la fonction $t \mapsto f(x, t) = 0$, donc $F(0) = 0$ est bien défini.

Pour tout $x \geq 0$, on trouve :

$$F(x) = \lim_{T \rightarrow +\infty} - \int_0^T x \exp(-xt) dt = \lim_{T \rightarrow +\infty} - [\exp(-xt)]_0^T = \lim_{T \rightarrow +\infty} - (\exp(-xT) - 1) = 1.$$

On en déduit que la fonction F est discontinue en 0. La fonction f est en fait de classe C^∞ , mais $F(x) := \int_0^{+\infty} f(x, t) dt$ admet un point de discontinuité en $x = 0$.

3.3.2 Notion d'intégrales uniformément convergentes

Définition 3.8. Soient $X \neq \emptyset, I \subset \mathbb{R}$, un intervalle non-vide. Soit $f : X \times I \rightarrow \mathbb{R}$ telle que :

$$\forall x \in X : t \mapsto f(x, t) \text{ est d'intégrale convergente sur } I,$$

à savoir :

$$\forall x \in X : \forall \varepsilon > 0 : \exists K_{\varepsilon, x} \subset I \text{ segment t.q. } \forall \tilde{K} \subset I \text{ segment} : \left[K_{\varepsilon, x} \subset \tilde{K} \Rightarrow \left| \int_{\tilde{K}} f(x, t) dt - \int_I f(x, t) dt \right| < \varepsilon. \right]$$

On dit que l'intégrale de f sur I converge uniformément sur X lorsque $K_{\varepsilon, x}$ ne dépend pas de x , c'est-à-dire lorsque :

$$\forall \varepsilon > 0 : \exists K_\varepsilon \subset I \text{ segment t.q. } \forall \tilde{K} \subset I \text{ segment} : \left[K_\varepsilon \subset \tilde{K} \Rightarrow \forall x \in X : \left| \int_{\tilde{K}} f(x, t) dt - \int_I f(x, t) dt \right| < \varepsilon \right].$$

Remarque. Lorsque $I = [a, +\infty)$, cela revient à avoir :

$$\forall \varepsilon > 0 : \exists Y > 0 \text{ t.q. } \forall x \in X : \left| \int_Y^{+\infty} f(x, t) dt \right| < \varepsilon.$$

Lorsque $I = [a, b]$, avec $a < b < +\infty$, cela revient à avoir :

$$\forall \varepsilon > 0 : \exists \delta \in (0, b - a) \text{ t.q. } \forall x \in X : \left| \int_{b-\delta}^b f(x, t) dt \right| < \varepsilon.$$

Dans l'exemple 3.3.1, $f(x, t) = x \exp(-xt)$, $X = I = \mathbb{R}^+$, on pouvait dire :

$$\int_Y^{+\infty} f(x, t) dt = \begin{cases} -\exp(-xt) & \text{si } x > 0, \\ 0 & \text{sinon.} \end{cases}$$

On en déduit :

$$\sup_{x \in X} \left| \int_Y^{+\infty} f(x, t) dt \right| = 1.$$

On en déduit que l'intégrale de $t \mapsto x \exp(-xt)$ n'est pas convergente uniformément sur \mathbb{R}^+ .

Théorème 3.9. Soient (X, d) un espace métrique, $I \subset \mathbb{R}$, un intervalle non-vidé. Soit $f : X \times I \xrightarrow{C^0} \mathbb{R}$. On suppose que l'intégrale de $t \mapsto f(x, t)$ converge sur I uniformément sur X . Alors la fonction $F : X \rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \int_I f(x, t) dt$ est continue sur X .

Démonstration. Soit $([a_n, b_n])_n$, une suite exhaustive de segments de I . Pour tout $n \in \mathbb{N}$, on pose :

$$F_n : X \rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \int_{a_n}^{b_n} f(x, t) dt.$$

On observe que ces F_n sont continues par le Théorème 3.2 car $[a_n, b_n]$ est un segment fixe (compact) et $f \in C^0(X \times I, \mathbb{R})$ par hypothèse.

Prenons, $n, p \in \mathbb{N}, x \in X$. Calculons :

$$\begin{aligned} F_{n+p}(x) - F_n(x) &= \int_{a_{n+p}}^{b_{n+p}} f(x, t) dt - \int_{a_n}^{b_n} f(x, t) dt \\ &= \int_{a_{n+p}}^{b_{n+p}} f(x, t) dt - \int_I f(x, t) dt + \int_I f(x, t) dt - \int_{a_n}^{b_n} f(x, t) dt. \end{aligned}$$

Pour $\varepsilon > 0$, il existe $N_\varepsilon \in \mathbb{N}$ tel que pour $n, p \in \mathbb{N}$ et $x \in X$, par continuité des F_n et puisque $[a_n, b_n] \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} I$, on peut dire :

$$|F_{n+p}(x) - F_n(x)| \leq \left| \int_{a_{n+p}}^{b_{n+p}} f(x, t) dt - \int_I f(x, t) dt \right| + \left| \int_I f(x, t) dt - \int_{a_n}^{b_n} f(x, t) dt \right| \leq 2\varepsilon.$$

La suite $(F_n)_n$ est donc uniformément de Cauchy, on en déduit qu'elle converge uniformément sur X . Sa limite simple (limite de convergence simple) étant F , il vient que $f \in C^0(X, \mathbb{R})$. \square

Théorème 3.10. Soient $X \subset \mathbb{R}^d$, un ouvert non-vidé, $I \subset \mathbb{R}$, un intervalle non-vidé, et $f : X \times I \xrightarrow{C^0} \mathbb{R}$ telle que pour tout $i \in \llbracket 1, d \rrbracket$, f admet une dérivée partielle continue par rapport à x_i pour tout point de $X \times I$. Si l'intégrale sur I de $t \mapsto f(x, t)$ converge uniformément sur X et si pour tout $i \in \llbracket 1, d \rrbracket$, l'intégrale sur I de $t \mapsto \frac{\partial f}{\partial x_i}(x, t)$ converge uniformément sur X , alors la fonction définie par :

$$F : X \times \mathbb{R} : x \mapsto \int_I f(x, t) dt$$

est de classe C^1 sur X , et on a :

$$\frac{\partial F}{\partial x_i}(x) = \int_I \frac{\partial f}{\partial x_i}(x, t) dt.$$

Démonstration. EXERCICE. \square

3.3.3 Théorème de Fubini

Théorème 3.11 (Théorème de Fubini, version CDI 1). Soit $f : [\alpha, \beta] \times [a, b] \xrightarrow{C^0} \mathbb{R}$. Les fonctions :

$$\begin{cases} F : [\alpha, \beta] \rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \int_a^b f(x, t) dt \\ G : [a, b] \rightarrow \mathbb{R} : t \mapsto \int_\alpha^\beta f(x, t) dx \end{cases}$$

sont continues sur leur segment de définition, et on a :

$$\int_\alpha^\beta F(x) dx = \int_a^b G(t) dt.$$

Démonstration. Par la Proposition 3.2, on sait que F, G sont continues sur leur segment de définition. On pose :

$$\begin{cases} H_1 : [\alpha, \beta] \rightarrow \mathbb{R} : X \mapsto \int_\alpha^X F(x) dx \\ H_2 : [\alpha, \beta] \rightarrow \mathbb{R} : X \mapsto \int_a^b \int_\alpha^X f(x, t) dx dt \end{cases}$$

Par CDI 1, on sait que $H_1 \in C^1([\alpha, \beta], \mathbb{R})$ avec $H_1'(x) = F(x)$. Par la Proposition 3.3, on trouve $H_2 \in C^1([\alpha, \beta], \mathbb{R})$ avec $H_2'(X) = \int_a^b \frac{\partial}{\partial x_i} \int_\alpha^X f(x, t) dx dt = \int_a^b f(X, t) dt = F(X)$.

On en déduit $H_1'(x) = H_2'(x)$, ou encore $H_1'(x) - H_2'(x) = 0$, ce qui indique que la fonction $H_1 - H_2$ est constante sur le segment $[\alpha, \beta]$. De plus, on trouve :

$$H_1(\alpha) = \int_\alpha^\alpha F(x) dx = 0 = \int_a^b 0 dt = H_2(\alpha).$$

On a donc $H_1 - H_2 = 0$, ou encore $H_1 = H_2$ sur $[\alpha, \beta]$. En particulier, $H_1(\beta) = H_2(\beta)$, ce qui est précisément :

$$\int_\alpha^\beta F(x) dx = H_1(\beta) = H_2(\beta) = \int_a^b \int_\alpha^\beta f(x, t) dx dt = \int_a^b G(t) dt.$$

□

Théorème 3.12 (Théorème de Fubini, version CDI 2). Soient $[\alpha, \beta]$, un segment, $I \subset \mathbb{R}$, un intervalle non-vide, et $f : [\alpha, \beta] \xrightarrow{C^0} \mathbb{R}$ telle que l'intégrale sur I de $t \mapsto f(x, t)$ converge uniformément sur $[\alpha, \beta]$. Alors :

1. la fonction $F : [\alpha, \beta] \rightarrow \mathbb{R} : x \mapsto \int_I f(x, t) dt$ est continue sur $[\alpha, \beta]$;
2. la fonction $G : I \rightarrow \mathbb{R} : t \mapsto \int_\alpha^\beta f(x, t) dx$ est continue sur I ;
3. G est d'intégrale convergente sur I .

De plus, on a :

$$\int_\alpha^\beta F(x) dx = \int_I G(t) dt.$$

Démonstration. F et G sont continues sur $[\alpha, \beta]$ par la Proposition 3.2. Fixons $\varepsilon > 0$. Soit $([a_n, b_n])_n$ une suite exhaustive de segments de I . Par convergence sur I uniforme sur $[\alpha, \beta]$ de l'intégrale de $t \mapsto f(x, t)$, il existe $N_\varepsilon \in \mathbb{N}$ tel que :

$$\forall n \geq N_\varepsilon : \forall x \in [\alpha, \beta] : \left| \int_{a_n}^{b_n} f(x, t) dt - \int_I f(x, t) dt \right| \leq \frac{\varepsilon}{\beta - \alpha}.$$

On en déduit :

$$\left| \int_{\alpha}^{\beta} \int_{a_n}^{b_n} f(x, t) dt dx - \int_{\alpha}^{\beta} \int_I f(x, t) dt dx \right| \leq \int_{\alpha}^{\beta} \left| \int_{a_n}^{b_n} f(x, t) dt - \int_I f(x, t) dt \right| dx \leq (\beta - \alpha) \frac{\varepsilon}{\beta - \alpha} = \varepsilon.$$

Par le théorème 3.12, on peut écrire :

$$\int_{\alpha}^{\beta} \int_{a_n}^{b_n} f(x, t) dt dx = \int_{a_n}^{b_n} \int_{\alpha}^{\beta} f(x, t) dx dt.$$

Prenons alors $n \geq N_{\varepsilon}$, on observe :

$$\varepsilon \geq \left| \int_{\alpha}^{\beta} \int_{a_n}^{b_n} f(x, t) dt dx - \int_{\alpha}^{\beta} \int_I f(x, t) dt dx \right| = \left| \int_{a_n}^{b_n} \int_{\alpha}^{\beta} f(x, t) dx dt - \int_{\alpha}^{\beta} \int_I f(x, t) dt dx \right| = \left| \int_{a_n}^{b_n} G(t) dt - \int_{\alpha}^{\beta} F(x) dx \right|.$$

Cela fournit la convergence de l'intégrale de G sur I , et le fait que :

$$\int_I G(t) dt = \int_{\alpha}^{\beta} F(x) dx.$$

□

3.3.4 Critères de convergence uniforme d'intégrales

Théorème 3.13 (Équivalent du critère de Weierstrass des séries sur les intégrales). *Soient $X \neq \emptyset$, $I \subset \mathbb{R}$, un intervalle non-vidé, et $f : X \times I \rightarrow \mathbb{R}$ telle que pour tout $x \in X$, on a $t \mapsto f(x, t)$ R -int sur tout segment de I . On suppose qu'il existe une fonction $\varphi : I \rightarrow \mathbb{R}$ abs-int sur I telle que :*

$$\forall (x, t) \in X \times I : |f(x, t)| \leq \varphi(t).$$

Alors l'intégrale de $t \mapsto f(x, t)$ converge sur I uniformément sur X .

Démonstration. Fixons $x \in X$. La fonction $t \mapsto f(x, t)$ est abs-int sur I par le critère de comparaison avec φ (Proposition 2.21). Puisque φ est abs-int sur I , pour $\varepsilon > 0$ fixé, il existe $K_{\varepsilon} \subset I$ segment tel que :

$$\forall K \subset I \text{ segment} : \left(K_{\varepsilon} \subset K \Rightarrow \left| \int_K f(x, t) dt - \int_I f(x, t) dt \right| \leq \varepsilon \right).$$

Pour $x \in X$, $K \subset I$ segment t.q. $K_{\varepsilon} \subset K$, écrivons :

$$\begin{aligned} \int_{K_{\varepsilon}} f(x, t) dt - \int_I f(x, t) dt &= \left| \int_{a_{\varepsilon}}^{b_{\varepsilon}} f(x, t) dt - \int_I f(x, t) dt \right| = \left| \int_{\inf I}^{a_{\varepsilon}} f(x, t) dt + \int_{b_{\varepsilon}}^{\sup I} f(x, t) dt \right| \\ &\leq \int_{\inf I}^{a_{\varepsilon}} |f(x, t)| dt + \int_{b_{\varepsilon}}^{\sup I} |f(x, t)| dt \leq \int_{\inf I}^{a_{\varepsilon}} \varphi(t) dt + \int_{b_{\varepsilon}}^{\sup I} \varphi(t) dt \\ &= \left| \int_I \varphi(t) dt - \int_{K_{\varepsilon}} \varphi(t) dt \right| \leq \varepsilon, \end{aligned}$$

par choix de K_{ε} . On a donc bien la convergence sur I uniforme sur X de $t \mapsto f(x, t)$.

□

Théorème 3.14 (Équivalent du critère d'Abel des séries sur les intégrales). Soit $I = [a, b)$, où $a < b \leq +\infty$. Soient $X \neq \emptyset$, et $I \subset \mathbb{R}$, un intervalle non-vide, et $f, g : X \times I \rightarrow \mathbb{R}$ tels que :

- $\forall x \in X : t \mapsto f(x, t)$ et $t \mapsto g(x, t)$ sont R -int sur tout segment de I ;
- $\exists M \geq 0, a \in I$ t.q. $\forall T \in I : \forall x \in X : \left| \int_a^T f(x, t) dt \right| \leq M$;
- $t \mapsto g(x, t)$ converge vers 0 en décroissant en b^- uniformément par rapport à x .

Alors $t \mapsto f(x, t)g(x, t)$ est d'intégrale convergente sur I uniformément sur X .

Démonstration. Soit $([a_n, b_n])_n$ une suite exhaustive de segments de I . Puisque $I = [a, b)$, il existe $N \in \mathbb{N}$ tel que pour $n \geq N$, on a $a_n \equiv a$. Pour $x \in X, n, p \in \mathbb{N}$, écrivons :

$$\int_a^{b_{n+p}} f(x, t)g(x, t) dt - \int_a^{b_n} f(x, t)g(x, t) dt = \int_{b_n}^{b_{n+p}} f(x, t)g(x, t) dt = g(x, b_n) \int_{b_n}^{c_{n,p}(x)} f(x, t) dt,$$

par la seconde formule de la moyenne. On en déduit alors :

$$\left| \int_a^{b_{n+p}} f(x, t)g(x, t) dt - \int_a^{b_n} f(x, t)g(x, t) dt \right| \leq 2g(x, b_n)M.$$

Par hypothèse, on sait que $g(\cdot, b_n)$ converge vers 0 uniformément par rapport à x . On sait donc qu'il existe $N_\varepsilon \in \mathbb{N}$ tel que pour $x \in X, n \geq N_\varepsilon$, on a $0 \leq g(x, b_n) \leq \frac{\varepsilon}{2M}$. Finalement, on en déduit :

$$\forall n \geq N_\varepsilon : \forall n, p \in \mathbb{N} : \forall x \in X : \left| \int_a^{b_{n+p}} f(x, t)g(x, t) dt - \int_a^{b_n} f(x, t)g(x, t) dt \right| \leq \varepsilon.$$

En faisant tendre $p \rightarrow +\infty$, on obtient bien :

$$\forall n \geq N_\varepsilon : \forall x \in X : \left| \int_I f(x, t)g(x, t) dt - \int_a^{b_n} f(x, t)g(x, t) dt \right| \leq \varepsilon.$$

On en déduit alors que $t \mapsto f(x, t)g(x, t)$ admet une intégrale convergente. □