

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Sommes « classiques » de Riemann

Petit détour pour un savoir-faire classique.

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Sommes « classiques » de Riemann

Petit détour pour un savoir-faire classique.

Théorème - Méthode des rectangles

Soit $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ intégrable au sens de Riemann.

On rappelle que :

$$R_n(f) = \frac{b-a}{n} \sum_{i=0}^{n-1} f(x_i) \text{ et } S_n(f) = \frac{b-a}{n} \sum_{i=1}^n f(x_i) \text{ où}$$

$$x_i = a + i \frac{b-a}{n}.$$

Alors

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} R_n(f) = \lim_{n \rightarrow +\infty} S_n(f) = \int_a^b f(t) dt$$

(méthode de calcul approché de $\int_a^b f(t) dt$, dite méthode des rectangles).

Si f est C^1 sur $[a, b]$, la vitesse de convergence est en $\frac{1}{n}$.

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Sommes « classiques » de Riemann

Petit détour pour un savoir-faire classique.

Théorème - Méthode des rectangles

Soit $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ intégrable au sens de Riemann.

On rappelle que :

$$R_n(f) = \frac{b-a}{n} \sum_{i=0}^{n-1} f(x_i) \text{ et } S_n(f) = \frac{b-a}{n} \sum_{i=1}^n f(x_i) \text{ où}$$

$$x_i = a + i \frac{b-a}{n}.$$

Alors

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} R_n(f) = \lim_{n \rightarrow +\infty} S_n(f) = \int_a^b f(t) dt$$

(méthode de calcul approché de $\int_a^b f(t) dt$, dite méthode des rectangles).

Si f est C^1 sur $[a, b]$, la vitesse de convergence est en $\frac{1}{n}$.

Démonstration

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Sommes « classiques » de Riemann. Vitesse de convergence

Démontrons maintenant l'ordre de grandeur de la vitesse de convergence lorsque f est de classe $\mathcal{C}^1$.

On exploite ici un résultat qui généralise le théorème des accroissements finis : théorème de Taylor-Lagrange :

Si F de $\mathcal{C}^1 \cap \mathcal{D}^2([a, b])$, $\exists c \in [a, b]$ tel que

$$F(a) = F(b) + (a - b)F'(a) + \frac{(a-b)^2}{2}F''(c).$$

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Sommes « classiques » de Riemann. Vitesse de convergence

Démontrons maintenant l'ordre de grandeur de la vitesse de convergence lorsque f est de classe $\mathcal{C}^1$.

On exploite ici un résultat qui généralise le théorème des accroissements finis : théorème de Taylor-Lagrange :

Si F de $\mathcal{C}^1 \cap \mathcal{D}^2([a, b])$, $\exists c \in [a, b]$ tel que

$$F(a) = F(b) + (a - b)F'(a) + \frac{(a-b)^2}{2}F''(c).$$

Démonstration

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Sommes « classiques » de Riemann. Vitesse de convergence

Démontrons maintenant l'ordre de grandeur de la vitesse de convergence lorsque f est de classe $\mathcal{C}^1$.

On exploite ici un résultat qui généralise le théorème des accroissements finis : théorème de Taylor-Lagrange :

$$\text{Si } F \text{ de } \mathcal{C}^1 \cap \mathcal{D}^2([a, b]), \exists c \in [a, b] \text{ tel que}$$

$$F(a) = F(b) + (a - b)F'(a) + \frac{(a-b)^2}{2}F''(c).$$

Démonstration

Si f est suffisamment régulière, on pourrait prolonger ce calcul pour avoir un DL plus précis...

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Sommes « classiques » de Riemann. Vitesse de convergence

Démontrons maintenant l'ordre de grandeur de la vitesse de convergence lorsque f est de classe $\mathcal{C}^1$.

On exploite ici un résultat qui généralise le théorème des accroissements finis : théorème de Taylor-Lagrange :

$$\text{Si } F \text{ de } \mathcal{C}^1 \cap \mathcal{D}^2([a, b]), \exists c \in [a, b] \text{ tel que}$$

$$F(a) = F(b) + (a - b)F'(a) + \frac{(a-b)^2}{2}F''(c).$$

Démonstration

Si f est suffisamment régulière, on pourrait prolonger ce calcul pour avoir un DL plus précis...

Exemple Cas particulier courant.

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Savoir-faire

Savoir-faire. Reconnaître les sommes de Riemann à pas constant : limite

Si l'on doit chercher la limite pour $n \rightarrow +\infty$ d'une somme k de a_n à b_n dont le terme général dépend de k ET de n , c'est très probablement une somme de Riemann à pas constant !

1. Factoriser par n afin de transformer tous les k en $\frac{k}{n}$.
2. Ecrire sur un brouillon la formule de Riemann pour mieux identifier.
3. Le facteur devant $\frac{k}{n}$ vaut $b - a$ (premier terme reconnu), le nombre additionné à $\frac{k}{n}(b - a)$ vaut a (second terme reconnu)
4. Dédire la valeur de b . Puis on identifie pour trouver f
5. Factoriser pour faire apparaitre devant la somme $\frac{b-a}{n}$

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Savoir-faire

Savoir-faire. Reconnaître les sommes de Riemann à pas constant : limite

Si l'on doit chercher la limite pour $n \rightarrow +\infty$ d'une somme k de a_n à b_n dont le terme général dépend de k ET de n , c'est très probablement une somme de Riemann à pas constant !

1. Factoriser par n afin de transformer tous les k en $\frac{k}{n}$.
2. Ecrire sur un brouillon la formule de Riemann pour mieux identifier.
3. Le facteur devant $\frac{k}{n}$ vaut $b - a$ (premier terme reconnu), le nombre additionné à $\frac{k}{n}(b - a)$ vaut a (second terme reconnu)
4. Dédire la valeur de b . Puis on identifie pour trouver f
5. Factoriser pour faire apparaitre devant la somme $\frac{b-a}{n}$

On exploite les primitives largement utilisées depuis septembre

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Savoir-faire

Savoir-faire. Reconnaître les sommes de Riemann à pas constant & vitesse de convergence

On a reconnu la formule avec le savoir-faire précédent. Il s'agit de calculer la vitesse de convergence.

1. Remplacer $\ell = \int_a^b f(t)dt$ par

$$F(b) - F(a) = \sum_{k=0}^{n-1} F(x_{k+1}) - F(x_k)$$
2. Il s'agit d'évaluer la différence :

$$\sum_{k=0} [(x_{k+1} - x_k)f(x_k) - (F(x_{k+1}) - F(x_k))].$$
3. La formule de Taylor-Lagrange donne l'existence d'un c_k tel que

$$(x_{k+1} - x_k)f(x_k) - (F(x_{k+1}) - F(x_k)) = \frac{1}{2}(x_{k+1} - x_k)^2 f'(c_k)$$
4. On remplace par leur valeur les x_k :

$$R_n - \ell = \frac{b-a}{2n} \times \frac{b-a}{n} \sum_{k=0}^{n-1} f'(c_k) \sim \frac{(b-a)}{2n} (f(b) - f(a))$$

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Exercice

Attention. Il ne s'agit pas de série !!

Bien que cela y ressemble fortement, les suites R_n ou S_n ne sont pas les sommes partielles de série.

En effet, dans la cas des séries, le terme général ne dépend que de k .

Ici il y a bien un mélange des deux variables : n et k ($\in \llbracket 0, n \rrbracket$)...

Il faut prendre le coup d'oeil pour bien différencier ces deux objets (par ailleurs il ne faut pas non plus confondre série et somme de Riemann)

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Exercice

Attention. Il ne s'agit pas de série !!

Bien que cela y ressemble fortement, les suites R_n ou S_n ne sont pas les sommes partielles de série.

En effet, dans la cas des séries, le terme général ne dépend que de k .

Ici il y a bien un mélange des deux variables : n et k ($\in \llbracket 0, n \rrbracket$)...

Il faut prendre le coup d'oeil pour bien différencier ces deux objets (par ailleurs il ne faut pas non plus confondre série et somme de Riemann)

Exercice

Déterminer la limite quand n tend vers $+\infty$ de $\sum_{k=1}^n \frac{1}{n+k}$.

Quelle est la vitesse de convergence ? (Savoir-faire)

=> Définition des intégrales

=> Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Méthode des trapèzes

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

Corollaire - Méthode des trapèzes

Soit $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ continue. Alors

$$\frac{R_n(f) + S_n(f)}{2} = \frac{b-a}{n} \sum_{i=0}^{n-1} \frac{f(a_i) + f(a_{i+1})}{2} \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} \int_a^b f(t) dt$$

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Intégrale de Kurzweil-Henstock : le pas est défini par une jauge

Définition - Intégrale de f

Soit f une fonction numérique définie sur le segment $[a, b]$.

La fonction f est dite **intégrable sur $[a, b]$, au sens de Kurzweil-Henstock** ou **KH-intégrable sur $[a, b]$** s'il existe un nombre réel S tel que

$$\forall \epsilon > 0, \exists \delta_\epsilon, \text{ jauge sur } [a, b] \text{ tq } \forall \sigma_p \in \mathfrak{S}_\delta, |S(f, \sigma_p) - S| < \epsilon$$

On notera $\mathcal{I}([a, b])$ l'**ensemble des fonctions intégrables sur $[a, b]$** .

Le nombre S ci-dessus est appelé l'intégrale de la fonction f sur $[a, b]$ et est noté $\int_{[a, b]} f(x) dx$ ou...

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Intégrale de Kurzweil-Henstock : le pas est défini par une jauge

Définition - Intégrale de f

Soit f une fonction numérique définie sur le segment $[a, b]$.

La fonction f est dite **intégrable sur $[a, b]$, au sens de Kurzweil-Henstock** ou **KH-intégrable sur $[a, b]$** s'il existe un nombre réel S tel que

$$\forall \epsilon > 0, \exists \delta_\epsilon, \text{ jauge sur } [a, b] \text{ tq } \forall \sigma_p \in \mathfrak{S}_\delta, |S(f, \sigma_p) - S| < \epsilon$$

On notera $\mathcal{I}([a, b])$ l'**ensemble des fonctions intégrables sur $[a, b]$** .

Le nombre S ci-dessus est appelé l'intégrale de la fonction f sur $[a, b]$ et est noté $\int_{[a, b]} f(x)dx$ ou...

Il nous faut donc maintenant préciser ce qu'est l'ensemble $\mathcal{I}([a, b])$.

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

Remarque Existence d'une subdivision δ -fine

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Remarques et exemple

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

Remarque Existence d'une subdivision δ -fine

Exemple Intégrale d'une fonction nulle sauf en un nombre fini de points.

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Remarques et exemple

Remarque Existence d'une subdivision δ -fine

Exemple Intégrale d'une fonction nulle sauf en un nombre fini de points.

Exercice

Si le nombre de points (y_i) est infini mais dénombrable, montrer qu'on a encore $\int_a^b f(t)dt = 0$.

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

Proposition - Unicité de l'intégrale

Si f est R-intégrable sur $[a, b]$, alors f est KH-intégrable.

Si f est intégrable, son intégrale est unique (définie de l'une ou l'autre des façons).

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Unicité de l'intégrale

Proposition - Unicité de l'intégrale

Si f est R-intégrable sur $[a, b]$, alors f est KH-intégrable.

Si f est intégrable, son intégrale est unique (définie de l'une ou l'autre des façons).

Démonstration

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Chacun sa jauge !

L'exemple qui suit, montre qu'il n'est pas nécessaire que la fonction soit bornée pour être KH-intégrable.

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Chacun sa jauge !

L'exemple qui suit, montre qu'il n'est pas nécessaire que la fonction soit bornée pour être KH-intégrable.

Exemple $x \mapsto \frac{1}{\sqrt{x}}$ sur $]0, 1]$.

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Chacun sa jauge !

L'exemple qui suit, montre qu'il n'est pas nécessaire que la fonction soit bornée pour être KH-intégrable.

Exemple $x \mapsto \frac{1}{\sqrt{x}}$ sur $]0, 1]$.

Savoir-faire. A chaque problème sa jauge !

Vous aurez peu d'exercices où il faudra montrer à la main, comme sur l'exemple précédent, la KH-intégrabilité.

Une idée (parmi d'autres) : pour chaque problème, on crée une jauge qui contient le problème.

Puis, on prend la jauge minimale

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Nommer les ensembles

Si la jauge peut être choisie constante, alors la fonction est R -intégrable et donc KH -intégrable, sinon elle est KH -intégrable (ou rien).

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Nommer les ensembles

Si la jauge peut être choisie constante, alors la fonction est R-intégrable et donc KH-intégrable, sinon elle est KH-intégrable (ou rien).

Définition - Ensemble

On note $\mathcal{I}_{\mathcal{R}}([a, b])$ l'ensemble des fonctions R-intégrables sur $[a, b]$.

On note $\mathcal{I}_{\mathcal{KH}}([a, b])$ l'ensemble des fonctions KH-intégrables sur $[a, b]$.

Si on ne précise pas : $\mathcal{I}([a, b])$ est un abus de notation de $\mathcal{I}_{\mathcal{KH}}([a, b])$.

Par abus, on peut aussi oublier de noter $([a, b])$, si le contexte est assez clair.

On rappelle que $\mathcal{C}_M([a, b], \mathbb{R})$ est l'ensemble des fonctions continues par morceaux définies sur $[a, b]$ est à valeurs dans $\mathbb{R}$.

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Nommer les ensembles

Si la jauge peut être choisie constante, alors la fonction est R-intégrable et donc KH-intégrable, sinon elle est KH-intégrable (ou rien).

Définition - Ensemble

On note $\mathcal{I}_{\mathcal{R}}([a, b])$ l'ensemble des fonctions R-intégrables sur $[a, b]$.

On note $\mathcal{I}_{\mathcal{KH}}([a, b])$ l'ensemble des fonctions KH-intégrables sur $[a, b]$.

Si on ne précise pas : $\mathcal{I}([a, b])$ est un abus de notation de $\mathcal{I}_{\mathcal{KH}}([a, b])$.

Par abus, on peut aussi oublier de noter $([a, b])$, si le contexte est assez clair.

On rappelle que $\mathcal{C}_M([a, b], \mathbb{R})$ est l'ensemble des fonctions continues par morceaux définies sur $[a, b]$ est à valeurs dans $\mathbb{R}$.

Un des buts de ce chapitre est de caractériser ces ensembles, donner des exemples. . .

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Passage à la limite sur les sommes de Cauchy

Ces propriétés tombent des celles des sommes de Cauchy, par continuité et croissance de la limite $\lim_{\delta(\sigma_p) \rightarrow 0} S(f, \sigma_p) = \int_a^b f$.

Théorème Extensions des propriétés de l'intégrale

- ▶ $f \mapsto \int_{[a,b]} f$ est une forme linéaire sur $\mathcal{I}([a, b])$ et $\mathcal{C}_M([a, b], \mathbb{R})$.
- ▶ positivité : $f \in \mathcal{I}([a, b]), f \geq 0 \Rightarrow \int_{[a,b]} f \geq 0$
- ▶ croissance : $f, g \in \mathcal{I}([a, b]), f \geq g \Rightarrow \int_{[a,b]} f \geq \int_{[a,b]} g$
- ▶ majoration en v.a. : $f \in \mathcal{C}_M([a, b]) \Rightarrow |f| \in \mathcal{C}_M(\mathbb{R})$ et $\left| \int_{[a,b]} f \right| \leq \int_{[a,b]} |f|$

Mais, on n'a pas nécessairement $|f| \in \mathcal{I}([a, b])$ si $f \in \mathcal{I}(\mathbb{R})$.
mais toujours, si f et $|f| \in \mathcal{I}([a, b])$, alors

$$\left| \int_{[a,b]} f \right| \leq \int_{[a,b]} |f|.$$

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Passage à la limite sur les sommes de Cauchy

Ces propriétés tombent des celles des sommes de Cauchy, par continuité et croissance de la limite $\lim_{\delta(\sigma_p) \rightarrow 0} S(f, \sigma_p) = \int_a^b f$.

Théorème Extensions des propriétés de l'intégrale

- ▶ $f \mapsto \int_{[a,b]} f$ est une forme linéaire sur $\mathcal{I}([a,b])$ et $\mathcal{C}_M([a,b], \mathbb{R})$.
- ▶ positivité : $f \in \mathcal{I}([a,b]), f \geq 0 \Rightarrow \int_{[a,b]} f \geq 0$
- ▶ croissance : $f, g \in \mathcal{I}([a,b]), f \geq g \Rightarrow \int_{[a,b]} f \geq \int_{[a,b]} g$
- ▶ majoration en v.a. : $f \in \mathcal{C}_M([a,b]) \Rightarrow |f| \in \mathcal{C}_M(\mathbb{R})$ et $\left| \int_{[a,b]} f \right| \leq \int_{[a,b]} |f|$

Mais, on n'a pas nécessairement $|f| \in \mathcal{I}([a,b])$ si $f \in \mathcal{I}(\mathbb{R})$.
mais toujours, si f et $|f| \in \mathcal{I}([a,b])$, alors

$$\left| \int_{[a,b]} f \right| \leq \int_{[a,b]} |f|.$$

Démonstration

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Objectifs

- ⇒ Quelles sont les fonctions intégrables ?
- ⇒ Théorèmes fondamentaux

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Conclusion

Objectifs

⇒ Quelles sont les fonctions intégrables ?

- ▶ Et les fonctions en escalier sont intégrables

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Conclusion

Objectifs

⇒ Quelles sont les fonctions intégrables ?

- ▶ Et les fonctions en escalier sont intégrables
- ▶ Entre deux fonctions intégrables, f est intégrables.

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Conclusion

Objectifs

⇒ Quelles sont les fonctions intégrables ?

- ▶ Et les fonctions en escalier sont intégrables
- ▶ Entre deux fonctions intégrables, f est intégrables.
- ▶ Donc les fonctions continues par morceaux sont intégrables !

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Objectifs

⇒ Quelles sont les fonctions intégrables ?

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Objectifs

- ⇒ Quelles sont les fonctions intégrables ?
- ⇒ Théorèmes fondamentaux

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Conclusion

Objectifs

⇒ Quelles sont les fonctions intégrables ?

⇒ Théorèmes fondamentaux

- Version forte ou faible. L'intégration est la réciproque de la dérivation

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Conclusion

Objectifs

⇒ Quelles sont les fonctions intégrables ?

⇒ Théorèmes fondamentaux

- ▶ Version forte ou faible. L'intégration est la réciproque de la dérivation
- ▶ Lien avec une primitive : pour le calcul ou réciproquement, pour justifier l'existence de la primitive

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Conclusion

Objectifs

⇒ Quelles sont les fonctions intégrables ?

⇒ Théorèmes fondamentaux

- ▶ Version forte ou faible. L'intégration est la réciproque de la dérivation
- ▶ Lien avec une primitive : pour le calcul ou réciproquement, pour justifier l'existence de la primitive
- ▶ Savoir-faire : étudier $x \mapsto \int_{h_1(x)}^{h_2(x)} f(t)dt$.

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Conclusion

Objectifs

- ⇒ Quelles sont les fonctions intégrables ?
- ⇒ Théorèmes fondamentaux

Pour le prochain cours

- ▶ Lecture du cours : chapitre 36 : Intégration
5. L'intégrale comme « outil puissant » de l'analyse.
(fin)
- ▶ Exercice : n°675 & 695

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Conclusion

Objectifs

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Conclusion

Objectifs

⇒ Définition des intégrales

► Intégrale de Riemann :

$$\forall \epsilon > 0, \exists \delta \in \mathbb{R}_+^* \text{ telle que } \forall \sigma_p \in \mathfrak{S}_\delta, |S(f, \sigma_p) - S| < \epsilon$$

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Conclusion

Objectifs

⇒ Définition des intégrales

- ▶ Intégrale de Riemann :

$$\forall \epsilon > 0, \exists \delta \in \mathbb{R}_+^* \text{ telle que } \forall \sigma_p \in \mathfrak{S}_\delta, |S(f, \sigma_p) - S| < \epsilon$$

- ▶ Si une fonction est R -intégrable, la méthode des rectangles (pas constant) converge vers l'intégrale.
On maîtrise la vitesse de convergence si f de classe $\mathcal{C}^1$.

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Conclusion

Objectifs

⇒ Définition des intégrales

- Intégrale de Riemann :

$$\forall \epsilon > 0, \exists \delta \in \mathbb{R}_+^* \text{ telle que } \forall \sigma_p \in \mathfrak{S}_\delta, |S(f, \sigma_p) - S| < \epsilon$$

- Si une fonction est R -intégrable, la méthode des rectangles (pas constant) converge vers l'intégrale.

On maîtrise la vitesse de convergence si f de classe $\mathcal{C}^1$.

- Intégrale de Kurzweil-Henstock :

$$\forall \epsilon > 0, \exists \delta : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}_+^* \text{ telle que } \forall \sigma_p \in \mathfrak{S}_\delta, |S(f, \sigma_p) - S| < \epsilon$$

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Conclusion

Objectifs

⇒ Définition des intégrales

- ▶ Intégrale de Riemann :

$$\forall \epsilon > 0, \exists \delta \in \mathbb{R}_+^* \text{ telle que } \forall \sigma_p \in \mathfrak{S}_\delta, |S(f, \sigma_p) - S| < \epsilon$$

- ▶ Si une fonction est R -intégrable, la méthode des rectangles (pas constant) converge vers l'intégrale.
On maîtrise la vitesse de convergence si f de classe $\mathcal{C}^1$.

- ▶ Intégrale de Kurzweil-Henstock :

$$\forall \epsilon > 0, \exists \delta : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}_+^* \text{ telle que } \forall \sigma_p \in \mathfrak{S}_\delta, |S(f, \sigma_p) - S| < \epsilon$$

- ▶ A chaque fonction sa jauge d'intégration !

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Conclusion

Objectifs

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Conclusion

Objectifs

- ⇒ Définition des intégrales
- ⇒ Premières propriétés par passage à la limite
 - ▶ Passage à la limite sur les sommes de Riemann

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Objectifs

- ⇒ Définition des intégrales
- ⇒ Premières propriétés par passage à la limite
 - ▶ Passage à la limite sur les sommes de Riemann
 - ▶ Forme linéaire, positivité, croissance.

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Objectifs

- ⇒ Définition des intégrales
- ⇒ Premières propriétés par passage à la limite
 - ▶ Passage à la limite sur les sommes de Riemann
 - ▶ Forme linéaire, positivité, croissance.
 - ▶ Majoration (si $|f|$ intégrable)

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Objectifs

- ⇒ Définition des intégrales
- ⇒ Premières propriétés par passage à la limite
 - ▶ Passage à la limite sur les sommes de Riemann
 - ▶ Forme linéaire, positivité, croissance.
 - ▶ Majoration (si $|f|$ intégrable)

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

Objectifs

- ⇒ Définition des intégrales
- ⇒ Premières propriétés par passage à la limite
 - ▶ Passage à la limite sur les sommes de Riemann
 - ▶ Forme linéaire, positivité, croissance.
 - ▶ Majoration (si $|f|$ intégrable)

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

Objectifs

⇒ Définition des intégrales

⇒ Premières propriétés par passage à la limite

Pour le prochain cours

- ▶ Lecture du cours : chapitre 36 : Intégration

4. Espaces et sous-espaces de fonctions intégrables

- ▶ Exercice : n°770 & 789

1. Problèmes

2. « Construire » l'intégrale.

3. Construction de l'intégrale

3.1. Classes de fonctions à intégrer

3.2. Somme de Cauchy/Riemann associée à f sur D

3.3. Intégrales d'une fonction

4. Espaces et sous-espaces des fonctions intégrables

4.1. Notations

4.2. Passage à la limite des propriétés de somme de Cauchy