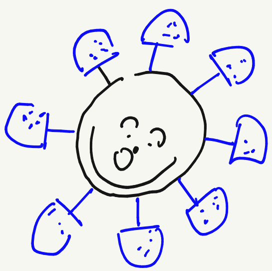
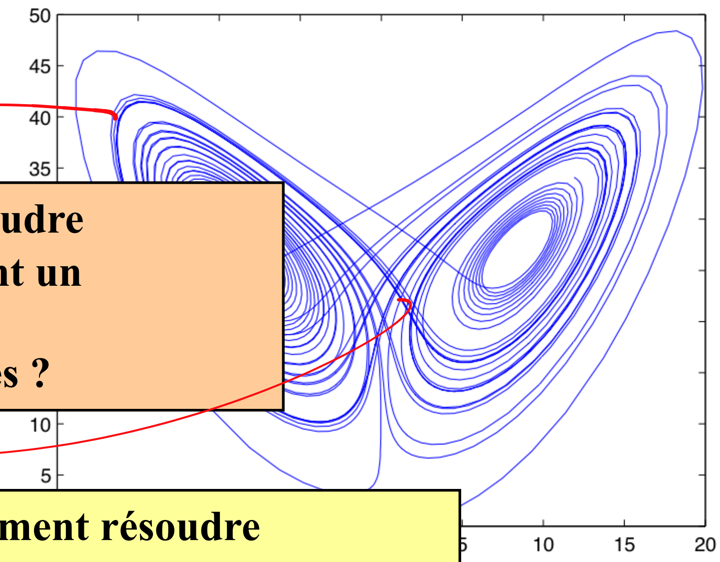
BIENVENUE SUR EPL1104 - COVID19



$$\begin{cases} u'(t) = \lambda\, u(t) \\ u(0) = \bar{u} \end{cases}$$

$$u(t) = \bar{u}\, \exp(\lambda t)$$

Plan du cours de méthodes numériques



Comment résoudre numériquement un problème aux valeurs initiales ?

Comment interpoler une fonction ?

Comment dériver numériquement une fonction ?

Comment résoudre numériquement un problème aux conditions frontières ?

Comment approximer une fonction ?

Comment intégrer numériquement une fonction ?

Et les équations non linéaires ?

Et les méthodes itératives ?

Comment résoudre numériquement une équation différentielle ordinaire ?

Comment résoudre numériquement une équation aux dérivées partielles ?

Comment résoudre numériquement une équation aux dérivées partielles ?

Trouver $u(x)$ tel que

$$\begin{cases} u'(x) & = & f(x, u(x)), & x \in [a, b] \\ u(a) & = & \bar{u} & \end{cases}$$

Applications :
très nombreuses dans tous les domaines

Problème de Cauchy

Questions théoriques

Existence, unicité et régularité d'une solution
Stabilité d'une équation différentielle

Méthodes numériques

Stabilité d'une méthode
Précision d'une méthode

Valeur exacte

$$u(X_i) \approx u^h(X_i) = U_i$$

Approximation numérique

Problème linéaire **ou** non linéaire **?**

Est-ce que f est une fonction linéaire de u ? <!>

Est-ce que f est une fonction linéaire de x ?

Problème homogène **ou** non homogène **?**

Dépendance explicite ou non de f par rapport à x ?

Solution particulière et solution du problème homogène

Problème scalaire **ou** vectoriel **?**

***u* scalaire ou *u* vecteur ?**

***x* scalaire : équation différentielle ordinaire (*x* = le temps très souvent)**

***x* vecteur : équation aux dérivées partielles (CM10-CM11-CM12)**

Ordre d'une équation différentielle ?

problème scalaire d'ordre *n* = système de *n* équations d'ordre un

$$u'(x) = \underbrace{\frac{\cosh(x^4)\, u(x)}{\exp(x^6)}}_{f(x,u)}$$

LINEAIRE
HOMOGENE

SCALAIRE
ORDRE 1

$$u'(x) = 2u^2(x) + 4$$

NON LINEAIRE
NON HOMO

SCALAIRE
ORDRE 1

$$u'(x) = \exp(u(x))$$

NON LINEAIRE
HOMOGENE

SCALAIRE
ORDRE 1

$$\boxed{u''(x) = u^2(x)}$$

NON LINEAIRE
HOMOGENE
SCALAIRE
ORDRE 2

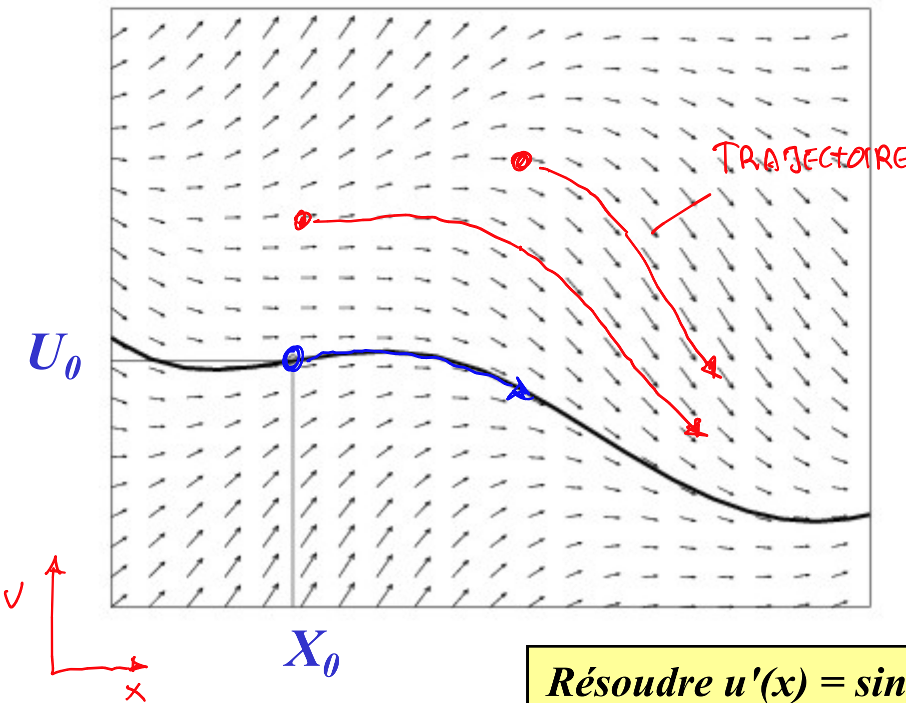
$$\boxed{\begin{cases} u'(x) = v(x) \\ v'(x) = u^2(x) \end{cases}}$$

VECTORIEL AVEC 2 COMP.
ORDRE 1

SO EEASY

PIECE OF CAKE !

Interprétation graphique



$$u'(x) = f(x, u(x))$$

CONNU

Résoudre u'(x) = sin(x)+ cos(u(x))
avec $u(X_0) = U_0$

est équivalent à

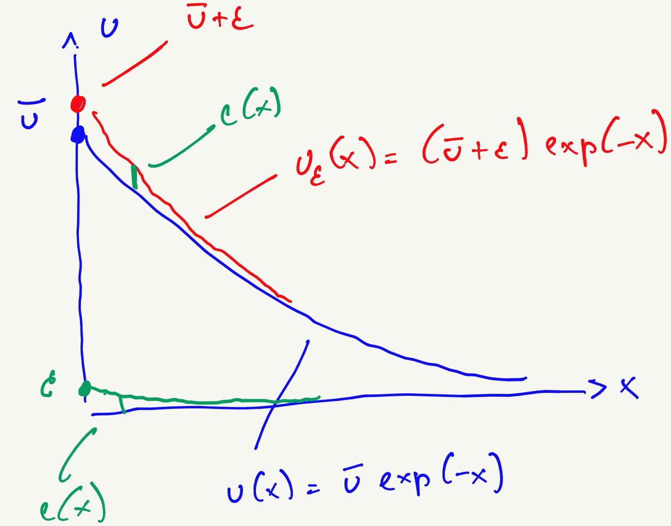
Construire une courbe
qui passe par (X_0,U_0)
qui a une pente en tout point x qui vaut sin(x) + cox(u(x))

1 EQUATION STABLE

PROBLEME STABLE

$$u'(x) = -u(x)$$
$$u(0) = \bar{u}$$

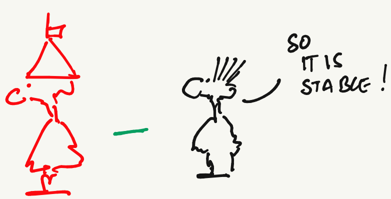
$$u(x) = \bar{u}\,\exp(-x)$$



PROBLEME PERTURBE

$$u_\varepsilon'(x) = -u_\varepsilon(x)$$
$$u_\varepsilon(0) = \bar{u} + \varepsilon$$

$$e(x) = u_\varepsilon(x) - u(x)$$



PROBLEME DE L'ERREUR

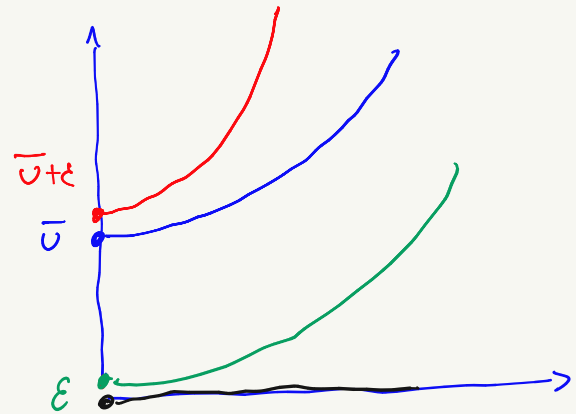
$$\underbrace{(u_\varepsilon - u)}_{e}{}' = -e(x)$$
$$e(0) = \varepsilon$$

$\boxed{2}$ EQUATION INSTABLE

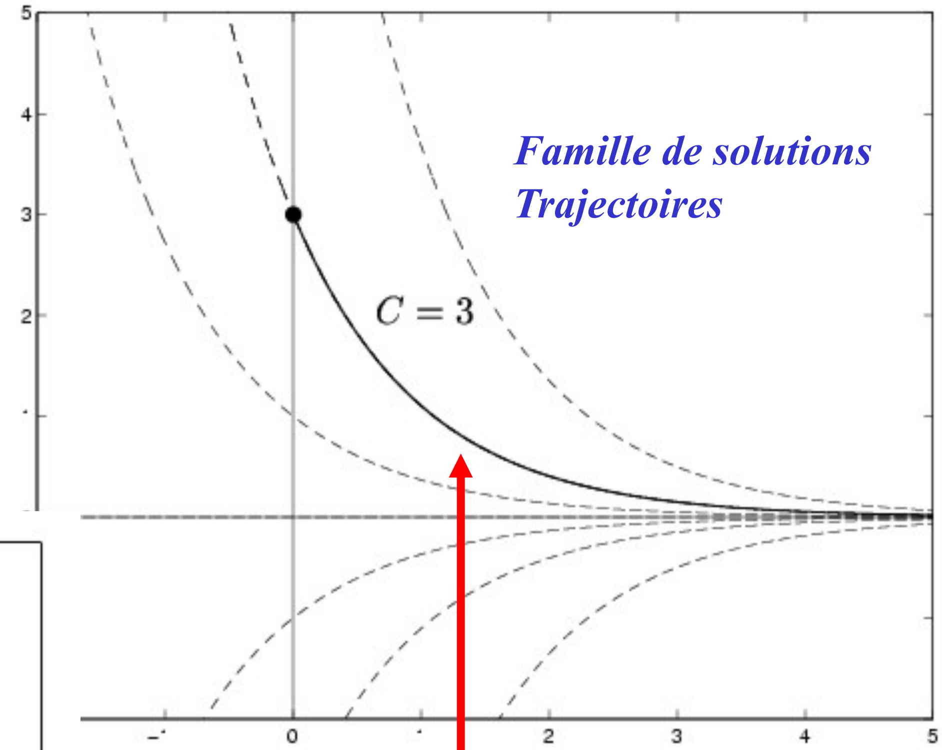
PROBLEME INSTABLE

$$\boxed{\begin{aligned} u'(x) &= u(x) \\ u(0) &= \bar{u} \end{aligned}}$$

$$u(x) = \bar{u}\,\exp(x)$$



u'(x) = -u(x) est une équation différentielle stable…



Trouver $u(x)$ tel que

$$\begin{cases} u'(x) = -u(x), & x \in [a, b] \\ u(a) = \bar{u} \end{cases}$$

Solution vérifiant la condition initiale

$$u(x) = \bar{u}\ e^{-(x-a)}$$

Lorsque les solutions se rejoignent lorsque x tend vers l'infini, on dit que le problème différentiel est stable ou bien posé

Sensibilité à une perturbation de la condition initiale

Problème non perturbé

Trouver $u(x)$ tel que

$$\left\{\begin{array}{lcll} u'(x) & = & -u(x), & x \in [a,b] \\ u(a) & = & \bar{u} & \end{array}\right.$$

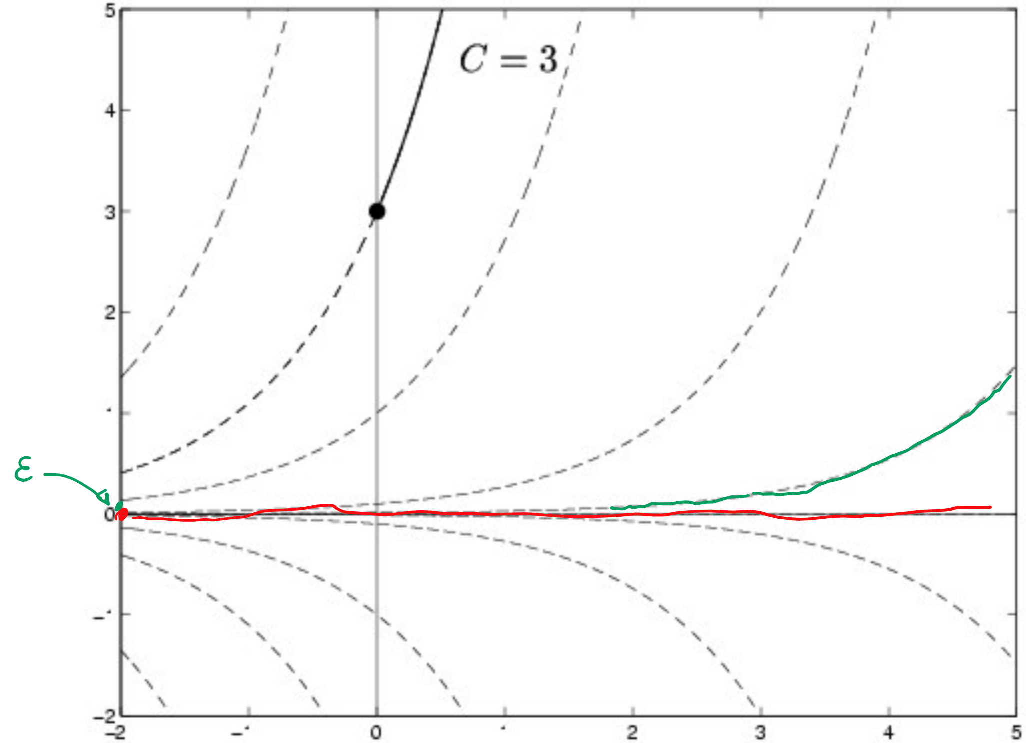
Trouver $u_\epsilon(x)$ tel que

$$\left\{\begin{array}{lcll} u'_\epsilon(x) & = & -u_\epsilon(x), & x \in [a,b] \\ u_\epsilon(a) & = & \bar{u}+\epsilon & \end{array}\right.$$

Problème perturbé

$$\underbrace{u_\epsilon(x) - u(x)}_{e_\epsilon(x)} = \epsilon\ e^{-(x-a)}$$

L'écart entre la solution du problème perturbé et la solution du problème non pertubé diminue progressivement de manière exponentielle...



$$u(x) = \bar{u}\ e^{(x-a)}$$

Si la solution analytique est déjà instable, il semble illusoire de croire que la solution discrète sera stable par rapport aux erreurs d'arrondi !

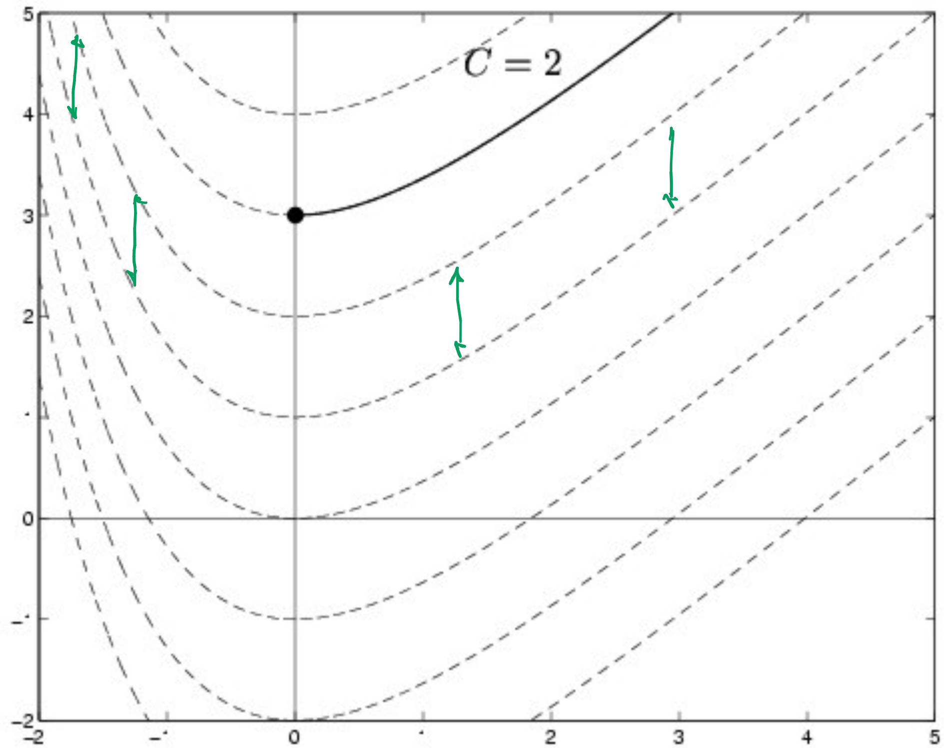
u'(x) = u(x)
est une équation différentielle instable.

$u'(x) = 1\text{-}e^{-x}$

n'est

ni stable,

ni instable.



$$u(x) = C + x + e^{-x}$$

L'écart dû à une perturbation reste constant

Au bénéfice du doute, on dit classiquement que le problème est encore stable

$\boxed{3}$ NI STABLE
NI INSTABLE

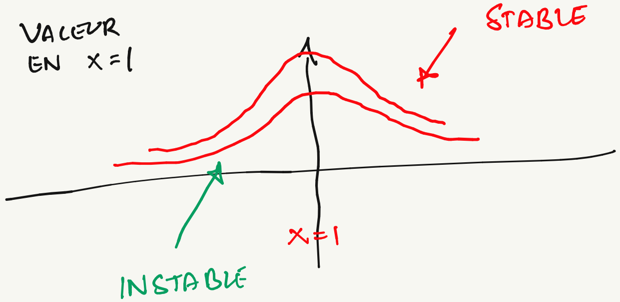
$$u'(x) = \underbrace{-10(x-1)}_{g'(x)}\, u(x)$$

$$u(x) = \exp(g(x))\, C$$
$$u'(x) = g'(x) \exp(g(x))\, C$$

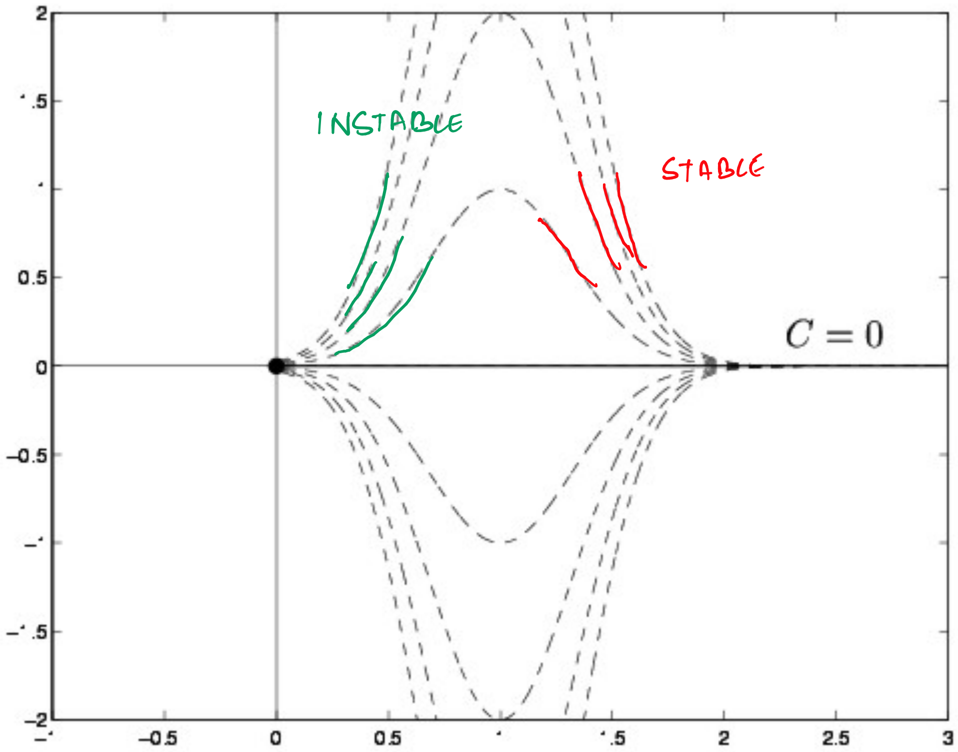
$$g(x) = -5(x-1)^2$$
$$g'(x) = -10(x-1)$$

$$u(x) = C \exp\left(-5(x-1)^2\right)$$

VALEUR EN $x=1$



u'(x) = -10(x-1)u(x) est un peu stable et un peu instable…



$$u(x) = Ce^{-5(x-1)^2}$$

$\boxed{4}$

EN GENERAL

$$e'(x) = f(x, u_\varepsilon) - f(x, u)$$

$$= \cancel{f(x, u)} + \underbrace{\left.\frac{\partial f}{\partial u}\right|_{(x,u)}}_{J(x,\, u(x))} \underbrace{(u_\varepsilon - u)}_{e(x)} - \cancel{f(x, u)}$$

JACOBIEN

> 0 ECART GRANDIT INSTABLE

≤ 0 ECART DIMINUE STABLE

Comment savoir dans le cas général ?

Idée

Presque toute l'information locale est contenue dans le *jacobien*.

Equation différentielle pour la différence entre solution du problème perturbé et solution du problème non-perturbé

$$e'_\epsilon(x) = f(x, u_\epsilon(x)) - f(x, u(x))$$

En effectuant un développement de Taylor de $f(x, v)$ pour la seconde variable v autour du point $(x, u(x))$,

$$\approx f(x, u(x)) + \left.\frac{\partial f}{\partial u}\right|_{(x,u)=(x,u(x))} \Big(u_\epsilon(x) - u(x) \Big) - f(x, u(x))$$

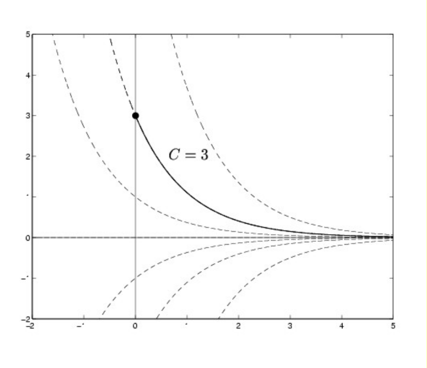
$$\approx \left.\frac{\partial f}{\partial u}\right|_{(x,u)=(x,u(x))} e_\epsilon(x)$$

$$J(x, u(x)) = \left.\frac{\partial f}{\partial u}\right|_{(x,u(x))}$$

jacobien

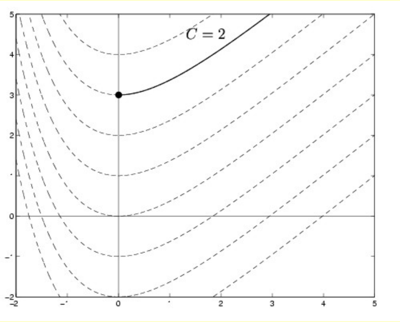
Bilan

u'(x) = -u(x)



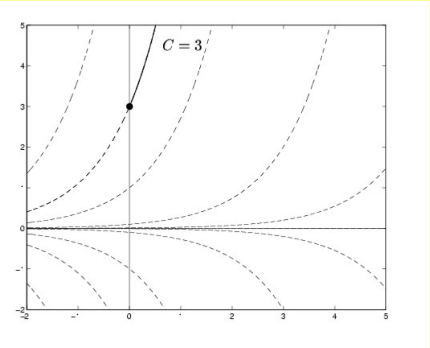
J = -1 ***stable***

u'(x) = f(x)



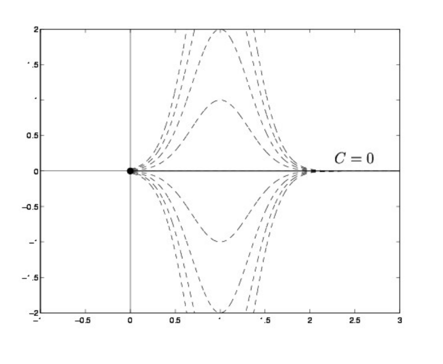
J = 0 ***écart constant***

u'(x) = u(x)



J = 1 ***instable***

u'(x) = -10(x-1)u(x)



J > 0 si x<1 ***instable***

J < 0 si x>1 ***stable***

4

STABLE
MAIS RAIDE !

$$\underbrace{u'(x) = -\alpha\,[u(x)}_{\text{EQUATION HOMO}} - \sin(x)] + \cos(x)$$

$$u(x) = u_{homo}(x) + \underbrace{u_p(x)}_{\text{UNE SOLUTION PARTICULIERE DU PROBLEME NON HOMOGENE}}$$

EQUATION HOMO

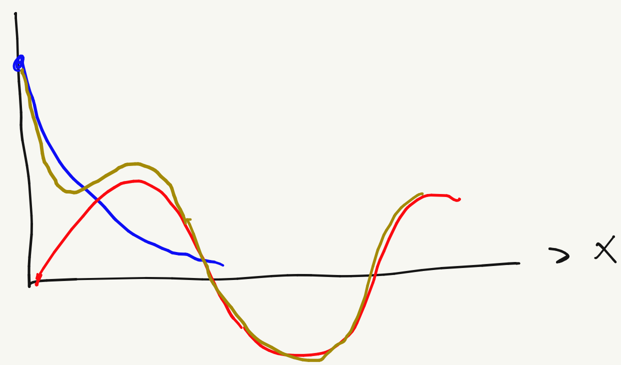
$$u'(x) = -\alpha\, u(x)$$

$$u_{homo}(x) = \exp(-\alpha x)\, C$$

$$\boxed{u(x) = \sin(x) + \exp(-\alpha x)}$$

RAIDE

α TRES GRAND !

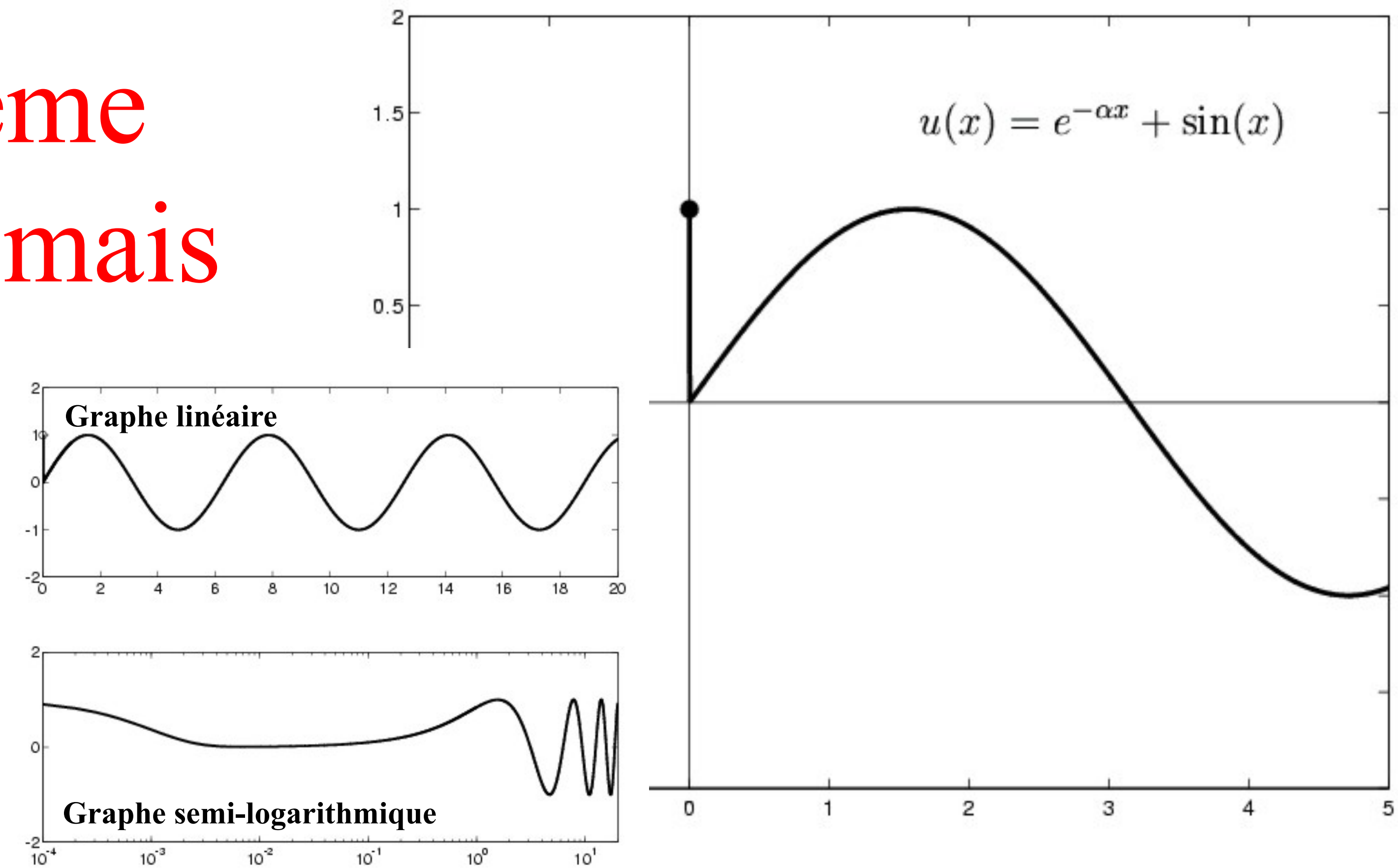


Trouver $u(x)$ tel que

$$\begin{cases} u'(x) &= -\alpha\Big(u(x) - \sin(x)\Big) + \cos(x), \qquad x \in [0,5] \\ u(0) &= 1 \end{cases}$$

Très difficile à résoudre pour beaucoup de méthodes numériques

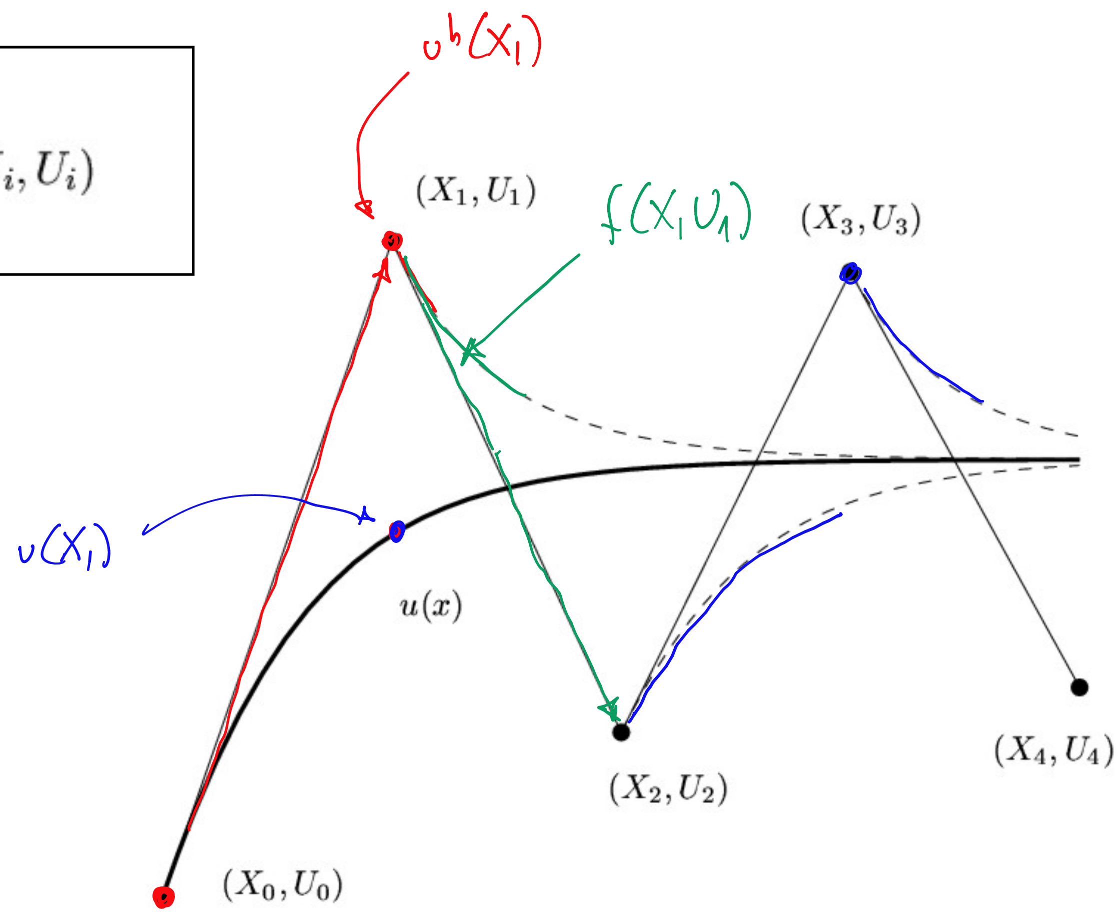
Problème stable mais raide



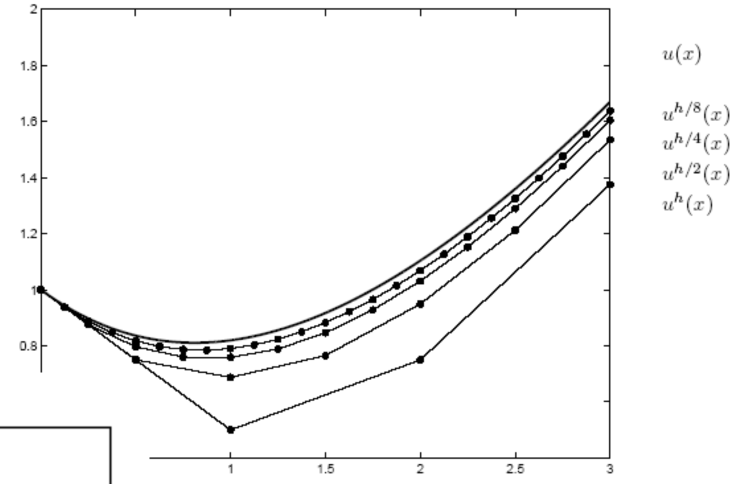
Méthode d'Euler explicite

$$\underbrace{u'(X_i)}_{\frac{U_{i+1} - U_i}{h}} = f(X_i, U_i)$$

$$\boxed{U_{i+1} = U_i + h\ f(X_i, U_i)}$$



Euler explicite…



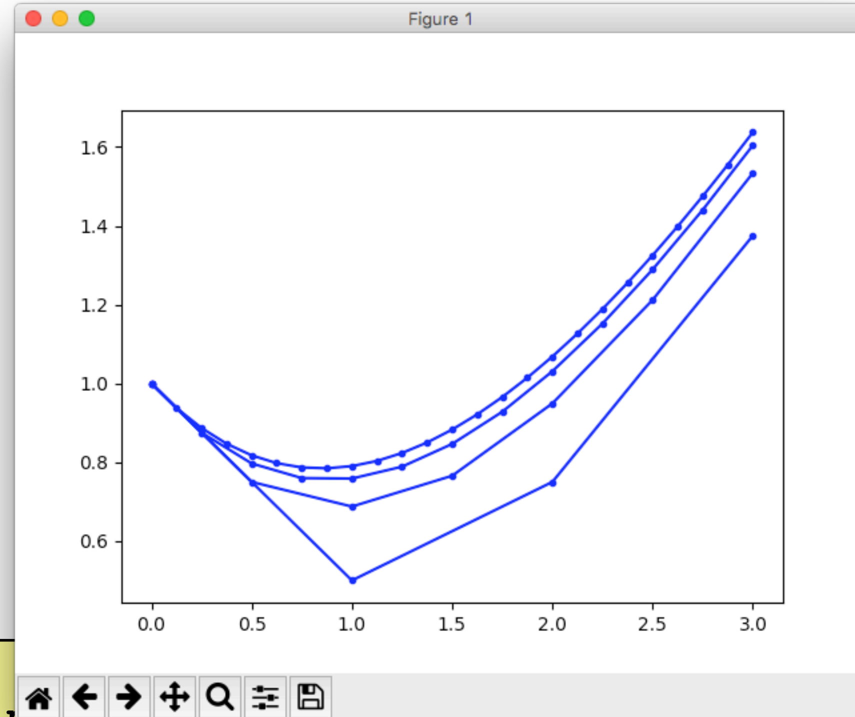
Méthode d'Euler explicite pour $u' = (x - u)/2$

X_i	$u^h(X_i)$	$u^{h/2}(X_i)$	$u^{h/4}(X_i)$	$u^{h/8}(X_i)$	$u(X_i)$
0.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
0.1250				0.9375	0.9432
0.2500			0.8750	0.8867	0.8975
0.3750				0.8469	0.8621
0.5000		0.7500	0.7969	0.8174	0.8364
0.7500			0.7598	0.7868	0.8119
1.0000	0.5000	0.6875	0.7585	0.7902	0.8196
2.0000	0.7500	0.9492	1.0308	1.0682	1.1036
3.0000	1.3750	1.5339	1.6043	1.6374	1.6694

… converge

Euler explicite

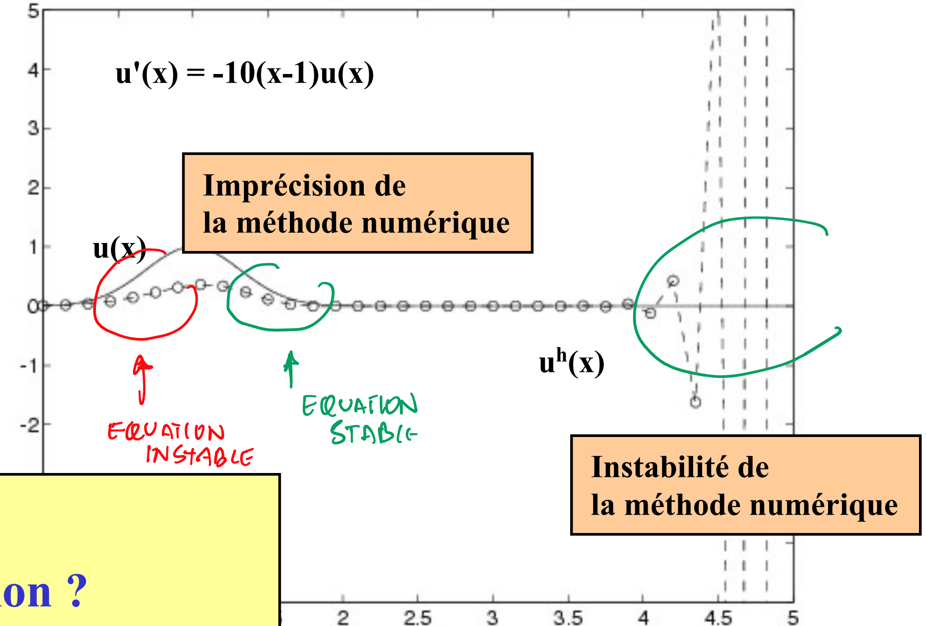
$u' = (x-u)/2$




```
from numpy import *
from matplotlib import pyplot as plt

Xstart = 0; Xend = 3; Ustart = 1;
for n in [3,6,12,24]:
  h = (Xend-Xstart)/n
  X = linspace(Xstart,Xend,n+1)
  U = zeros(n+1); U[0] = Ustart
  for i in range(n):
    U[i+1] =  U[i] + h*(X[i]-U[i])/2
  plt.plot(X,U,'.-b')
plt.show()
```

Et parfois, cela ne marche pas !

$$X_i = a + hi \quad i = 0, \ldots, m,$$



Définir m points

Comment choisir le pas de discrétisation ?

Pas constant ou adaptatif ?

Chercher une approximation U_k en X_k

Comment avoir une méthode stable ?

Comment avoir une méthode précise ?

$$u(X_i) \approx u^h(X_i) = U_i$$

$\boxed{5}$ **TAYLOR**

$$u(x_1) = u(x_0) + \overbrace{(x_1 - x_0)}^{h}\,\hat{f} + \frac{h^2}{2}\,\hat{f}' + \frac{h^3}{6}\,\hat{f}''$$

$$\hat{f} : x \longrightarrow f(x, u(x)) = \hat{f}(x)$$

$$f : (x, u) \longrightarrow f(x, u)$$

$= u'$:-)

$$\boxed{\hat{f}' = \frac{\partial f}{\partial x} + \frac{\partial f}{\partial u}\, f}$$

$$\hat{f}'' = \frac{\partial^2 f}{\partial x^2} + \frac{\partial^2 f}{\partial x \partial u}\, f + \frac{\partial^2 f}{\partial x \partial u}\, f + \frac{\partial^2 f}{\partial u^2}\, f^2 + \frac{\partial f}{\partial u}\left(\frac{\partial f}{\partial x} + \frac{\partial f}{\partial u}\, f\right)$$

$$\hat{f}'' = \frac{\partial^2 f}{\partial x^2} + 2\,\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial u}\, f + \frac{\partial^2 f}{\partial u^2}\, f^2 + \left(\frac{\partial f}{\partial u}\right)\left(\frac{\partial f}{\partial x}\right) + \left(\frac{\partial f}{\partial u}\right)^2 f$$

Méthodes explicites de Taylor :

Effectuons un développement de Taylor...

$$u(x) = u(X_0) + (x - X_0)\, u'(X_0) + \frac{(x-X_0)^2}{2!}\, u''(X_0) + \cdots$$

En vertu du problème à la valeur initiale,

$$= U_0 + (x - X_0)\, \widehat{f}(X_0) + \frac{(x-X_0)^2}{2!}\, \widehat{f}'(X_0) + \cdots$$

En tenant compte que $\widehat{f}' = \frac{\partial f}{\partial x} + \frac{\partial f}{\partial u} u'$ et que $u' = \widehat{f}$

$$= U_0 + (x - X_0)\, f(X_0, U_0)$$

$$\cancel{\frac{\partial^2 f}{\partial x^2}} + 2\cancel{\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial u}} f + \cancel{\frac{\partial^2 f}{\partial u^2}} f^2 + \cancel{\left(\frac{\partial f}{\partial u}\right)\left(\frac{\partial f}{\partial x}\right)} + \cancel{\left(\frac{\partial f}{\partial u}\right)^2} f$$

$$+ \frac{(x-X_0)^2}{2!}\left(\frac{\partial f}{\partial x} + \frac{\partial f}{\partial u} f\right)_{(X_0,U_0)}$$

$$+ \frac{(x-X_0)^3}{3!}\left(\cancel{\frac{\partial^2 f}{\partial x^2}} + 2\cancel{\frac{\partial^2 f}{\partial x \partial u}} f + \cancel{\frac{\partial^2 f}{\partial u^2}} f^2 + \cancel{\frac{\partial f}{\partial x}\frac{\partial f}{\partial u}} + \cancel{\left(\frac{\partial f}{\partial u}\right)^2} f\right)_{(X_0,U_0)}$$

$$+ \cdots$$

$$\widehat{f} : x \to f(x, u(x))$$

Attention, la fonction à une variable ressemble à la fonction à deux variables, mais ce n'est pas la même chose !!!

Méthodes de Taylor d'ordre n

$$U_{i+1} = U_i + h \underbrace{\left[f + \frac{h}{2!} \left. \frac{df}{dx} \right|_{u'=f} + \cdots + \frac{h^{n-1}}{n!} \left. \frac{d^{(n-1)} f}{dx^{n-1}} \right|_{u'=f} \right]_{(X_i, U_i)}}_{\Phi(X_i, U_i)}$$

$$\left. \frac{d}{dx} \right|_{u'=f} = \left(\frac{\partial}{\partial x} + f \frac{\partial}{\partial u} \right)$$

Euler explicite (Taylor n=1)

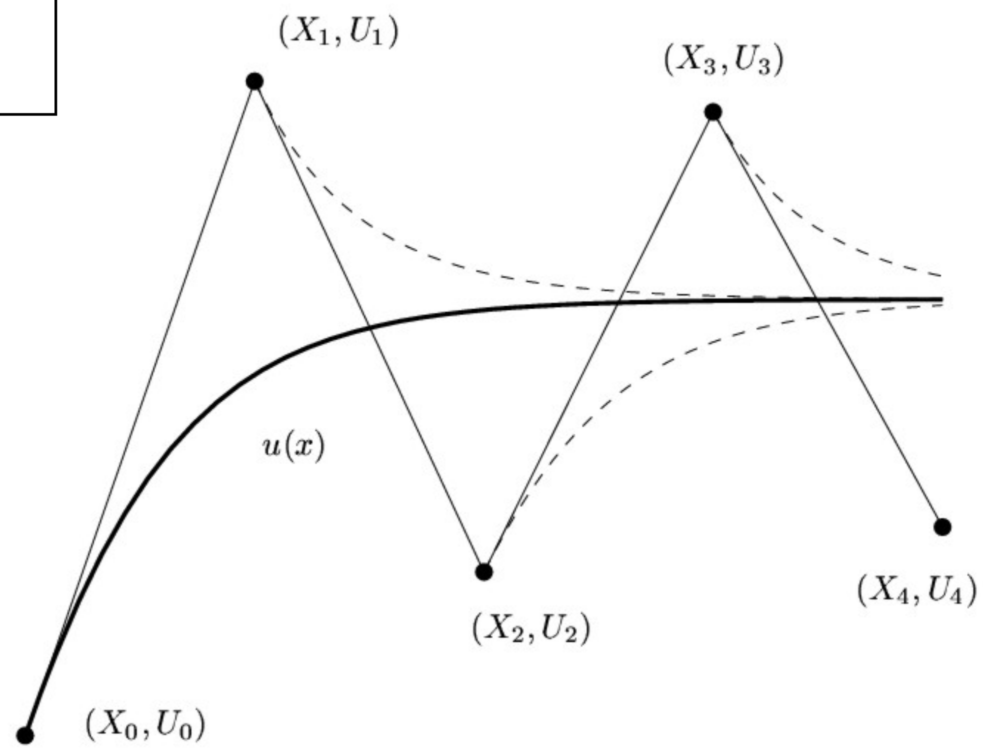
- **Ordre de précision linéaire**
- **Mise en œuvre facile**
- **Stabilité ?**

Taylor n quelconque

- **Ordre de précision arbitrairement élevé,**
- **Mise en œuvre fastidieuse si n élevé**
- **Stabilité ?**

Méthode de Taylor d'ordre 1
Euler explicite

$$U_{i+1} = U_i + h\ f(X_i, U_i)$$



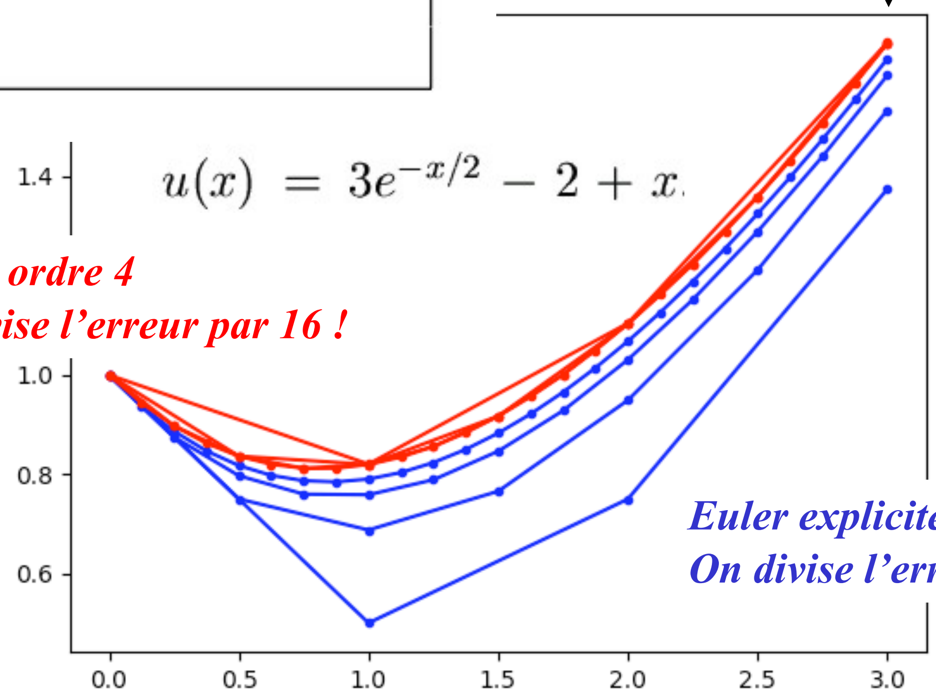
Exemple

Trouver $u(x)$ tel que

$$\begin{cases} u'(x) = (x - u(x))/2, & x \in [0,3] \\ u(0) = 1 \end{cases}$$

```
====== Explicit Euler method =====
==== Euler  (order=1) h=1.000 : eh(Xend) = 2.94e-01
==== Euler  (order=1) h=0.500 : eh(Xend) = 1.35e-01
==== Euler  (order=1) h=0.250 : eh(Xend) = 6.51e-02
==== Euler  (order=1) h=0.125 : eh(Xend) = 3.20e-02
============= Estimated order : 1.0678
====== Explicit Taylor order 4 method =====
==== Taylor (order=4) h=1.000 : eh(Xend) = 7.96e-04
==== Taylor (order=4) h=0.500 : eh(Xend) = 4.03e-05
==== Taylor (order=4) h=0.250 : eh(Xend) = 2.27e-06
==== Taylor (order=4) h=0.125 : eh(Xend) = 1.35e-07
============= Estimated order : 4.1767
```

$$u(x) = 3e^{-x/2} - 2 + x$$



Taylor ordre 4
On divise l'erreur par 16 !

Euler explicite
On divise l'erreur par 2 !

6

EXEMPLE

$$u' = \frac{x-u}{2}$$

$$\boxed{\hat{f}(x) = \frac{x-u(x)}{2}}$$

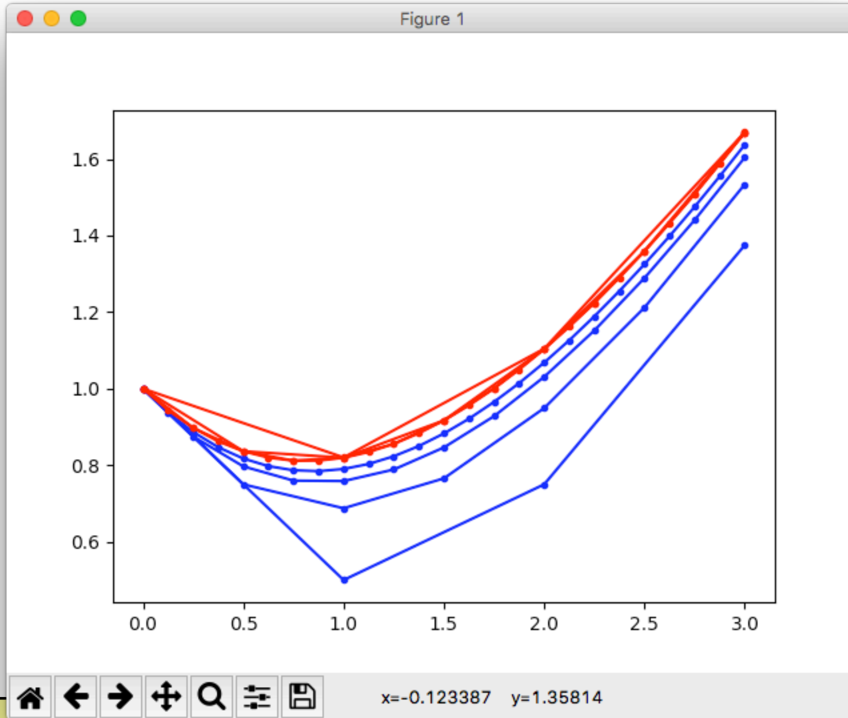
$$\begin{aligned}
U_{i+1} = U_i & + h\left[\frac{X_i - U_i}{2}\right] \\
& + \frac{h^2}{2}\left[\frac{1}{2} - \frac{X_i - U_i}{4}\right] \\
& + \frac{h^3}{6}\left[-\frac{1}{4} + \frac{X_i - U_i}{8}\right] \\
& + \frac{h^4}{24}\left[\frac{1}{8} - \frac{X_i - U_i}{16}\right] \\
& + \frac{h^5}{120}\left[-\frac{1}{16} + \frac{X_i - U_i}{32}\right]
\end{aligned}$$

$$\boxed{\begin{aligned}\hat{f}'(x) &= 1/2 - u'(x)/2 \\ &= 1/2 - \hat{f}(x)/2\end{aligned}}$$

$$\boxed{\hat{f}''(x) = -1/4 + \hat{f}(x)/4}$$

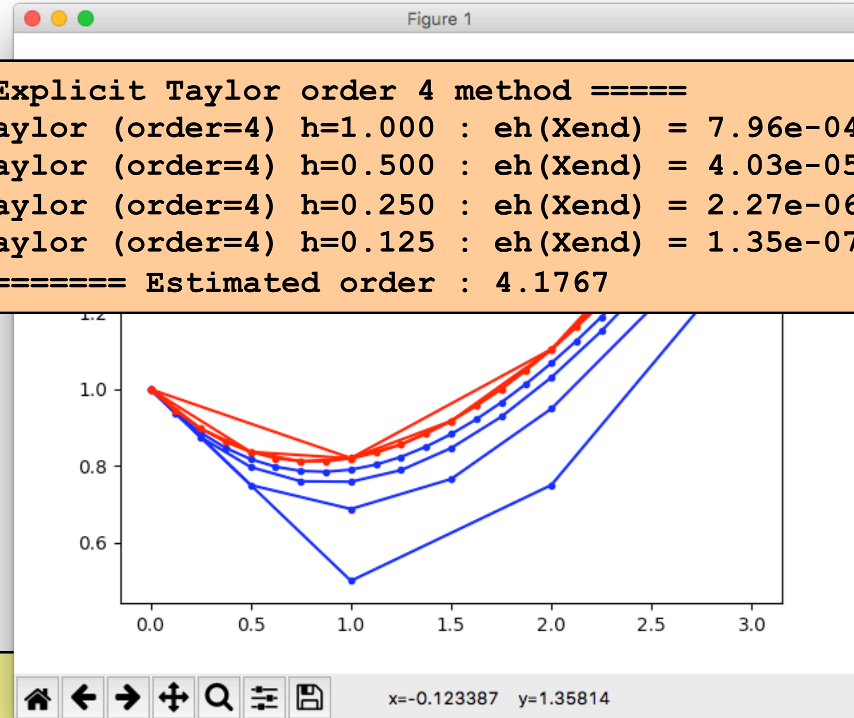
$$\boxed{\hat{f}'''(x) = 1/8 - \hat{f}(x)/8}$$

Taylor ordre 4 u'= (x-u)/2




```
u = lambda x : 3*exp(-x/2)-2+x

Xstart = 0; Xend = 3;
Ustart = 1;

for n in [3,6,12,24]:
  h = (Xend-Xstart)/n
  X = linspace(Xstart,Xend,n+1)
  U = zeros(n+1); U[0] = Ustart
  for i in range(n):
    U[i+1] =  U[i] + h*(X[i]-U[i])/2 + (h**2)*(2-X[i]+U[i])/8 \
         - (h**3)*(2-X[i]+U[i])/48 + (h**4)*(2-X[i]+U[i])/384
```

Calcul du taux de convergence




```
====== Explicit Taylor order 4 method =====
 ==== Taylor (order=4) h=1.000 : eh(Xend) = 7.96e-04
 ==== Taylor (order=4) h=0.500 : eh(Xend) = 4.03e-05
 ==== Taylor (order=4) h=0.250 : eh(Xend) = 2.27e-06
 ==== Taylor (order=4) h=0.125 : eh(Xend) = 1.35e-07
 ============= Estimated order : 4.1767
```

```
u = lambda x : 3*exp(-x/2)-2+x
error = zeros(4)
for j in range(4):
  n = 3*pow(2,j)
  h = (Xend-Xstart)/n
  X = linspace(Xstart,Xend,n+1)
  U = zeros(n+1); U[0] = 1
  for i in range(n):
    U[i+1] =  U[i] + h*(X[i]-U[i])/2 + (h**2)*(2-X[i]+U[i])/8 \
          - (h**3)*(2-X[i]+U[i])/48 + (h**4)*(2-X[i]+U[i])/384
  error[j] = abs(U[-1]-u(Xend))
  print(" ==== Taylor : h=%5.3f : eh(Xend) = %8.2e " % (h,error[j]))
order = mean(log(error[:-1]/error[1:])/log(2))
print(" ============= Estimated order : %.4f " % order)
```

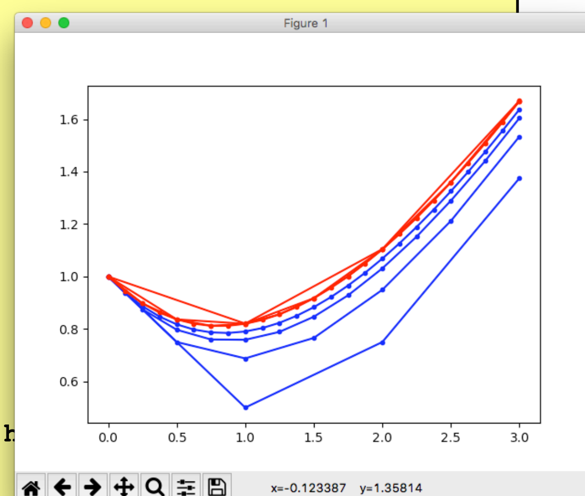
VERY IMPORTANT!

! !!

Ne jamais dupliquer du code !

```
from numpy import *
from matplotlib import pyplot as plt

class ExplMethods(object):
  def __init__(self,name,color,f):
    self.name = name
    self.f = f
    self.color = color

integrators = [ExplMethods("Explicit Euler order 1",".-b",
                  lambda u,x,h : h*(x-u)/2  ),
               ExplMethods("Explicit Taylor order 4",".-r",
                  lambda u,x,h : h*(x-u)/2+(2-x+u)*((h**2)/8-(h**3)/48+(h**4)/384) ) ]

u = lambda x : 3*exp(-x/2)-2+x
Xstart = 0; Xend = 3; Ustart = 1;

for integrator in integrators:
  print(" ====== %s method=====" % integrator.name)
  error = zeros(4)
  for j in range(4):
    n = 3*pow(2,j)
    h = (Xend-Xstart)/n
    X = linspace(Xstart,Xend,n+1)
    U = zeros(n+1); U[0] = Ustart
    for i in range(n):
      U[i+1] =  U[i] + integrator.f(U[i],X[i],h)
    plt.plot(X,U,integrator.color)
    error[j] = abs(U[-1]-u(Xend))
    print(" ==== %s : h=%5.3f : eh(Xend) = %8.2e " % (integrator.name,h

  order = mean(log(error[:-1]/error[1:])/log(2))
  print(" ============= Estimated order : %.4f " % order)
```

Introduire
une classe
d'intégrateurs explicites



Comment estimer l'erreur ?

Le roi s'en va par une porte…

Développement en série de Taylor

$$\boxed{u(X_{i+1})} = \boxed{u(X_i)} + \boxed{h\ f(X_i, u(X_i)) + \frac{h^2}{2}\ u''(\xi_{i+1})}$$

ξ_{i+1} est un point particulier de l'intervalle $[X_i, X_{i+1}]$

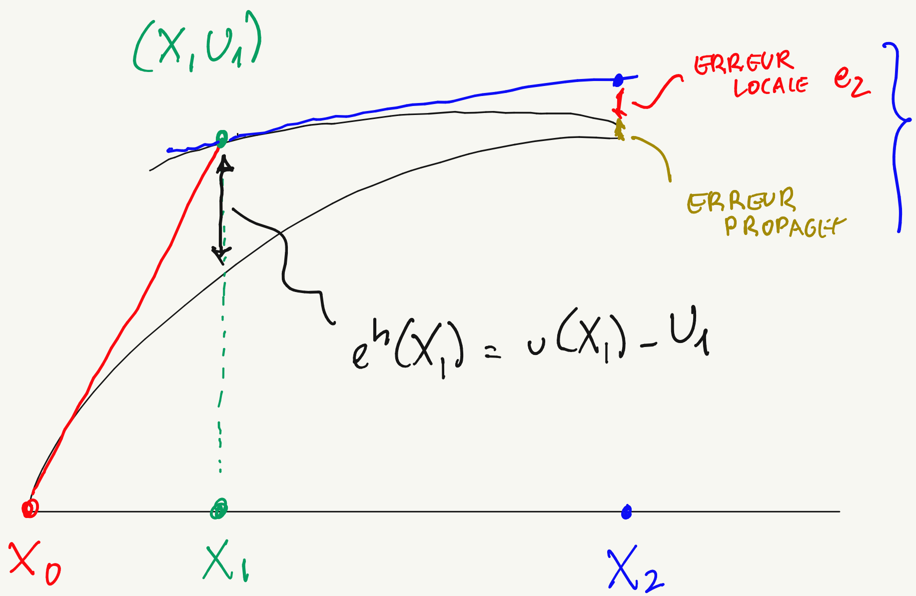
Et un triste substitut apparaît…

avec son cortège de courtisans…

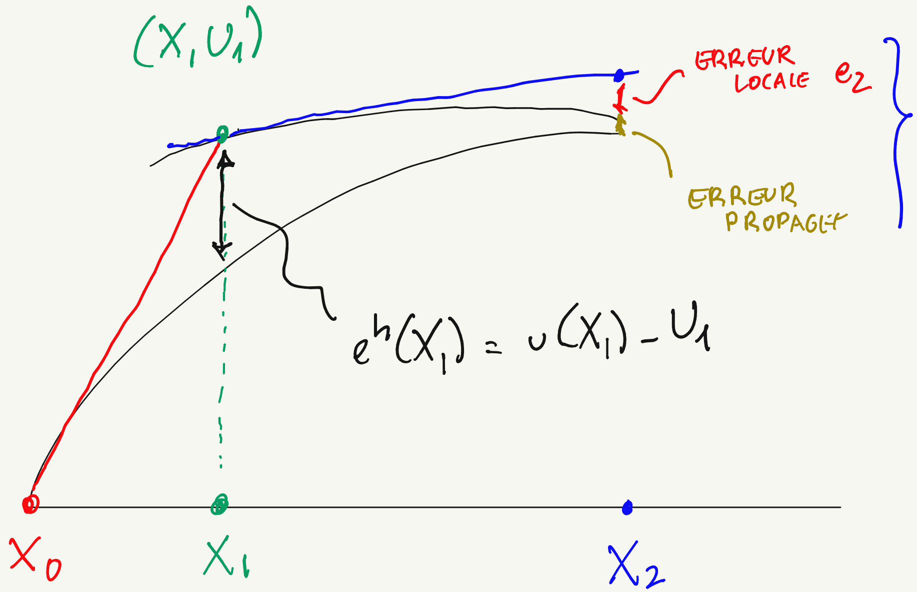
7

COMMENT ESTIMER L'ERREUR ?

$$\underbrace{u(X_2)}_{\text{Roi}} - \underbrace{U_2}_{\text{LE TRISTE SUBSTITUT}} = e^h(X_2)$$



$$e^h(X_2) = \underbrace{u(X_2)}_{= \boxed{u(X_1)} + h\, f(X_1, u(X_1)) + \frac{h^2}{2} u''(\xi)} - \underbrace{U_2}_{= \boxed{U_1} + h\, f(X_1, U_1)}$$



$$e^h(X_1) = u(X_1) - U_1$$

$$= \boxed{U_1} + h\, f(X_1, U_1)$$

$$e^h(X_2) = \underbrace{u(X_2)}_{} - U_2$$

$$\boxed{u(X_1)} + h\, f(X_1, u(X_1)) + \frac{h^2}{2} u''(\xi)$$

ERREUR PROPAGEE

$$e^h(X_2) = e^h(X_1) + \boxed{h \left[\underbrace{f(X_1, u(X_1)) - f(X_1, U_1)}_{e^h(X_1) \frac{\partial f}{\partial u}\Big|_{(X_1, \xi_1)}} \right]} + \boxed{\frac{h^2}{2} u(\xi)} = e_2$$

$$\underbrace{\partial u \quad (X_1, \xi_1)}_{\xi_1}$$

ERREUR PROPAGEE

$$e^h(X_2) \approx e^h(X_1) + \boxed{h\Big[\underbrace{f(X_1, u(X_1)) - f(X_1, U_1)}_{e^h(X_1)\,\underbrace{\frac{\partial f}{\partial u}\Big|_{(X_1,\xi_1)}}_{J_1}}\Big]} + \underbrace{\boxed{\frac{h^2}{2}\,u(\xi)}}_{= e_2}$$

$$= e^h(X_1)\underbrace{(1 + hJ_1)}_{\text{FACTEUR D'AMPLIFICATION DE L'ERREUR PROPAGEE}} + e_2$$

FACTEUR D'AMPLIFICATION DE L'ERREUR PROPAGEE

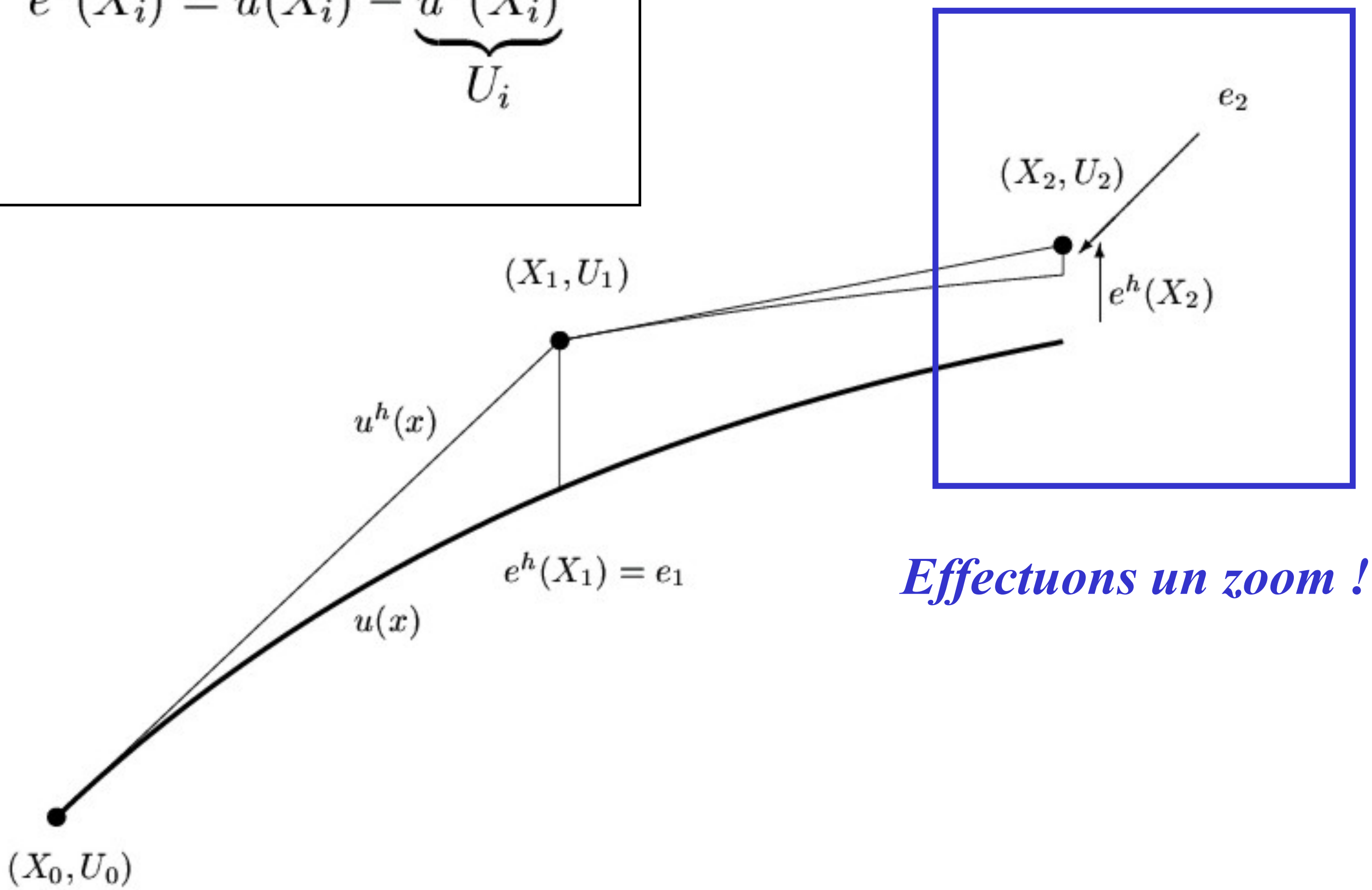
$$|1 + hJ_1| < 1$$

$$-2 < hJ_1 < 0$$

SI LE PROBLEME EST RAIDE ALORS h SERA RIDICULEMENT PETIT !

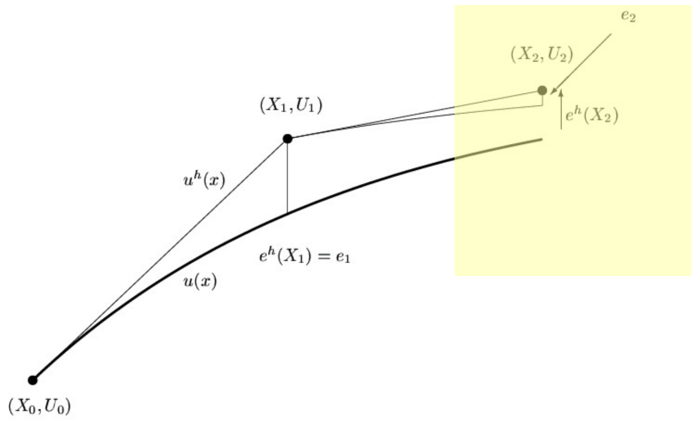
Définissons l'erreur

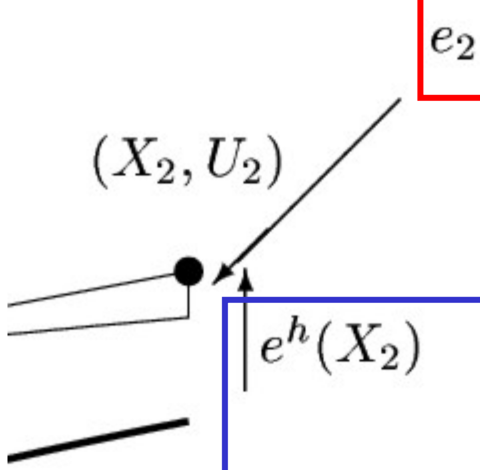
$$e^h(X_i) = u(X_i) - \underbrace{u^h(X_i)}_{U_i}$$



Effectuons un zoom !

Erreur locale et globale





Erreur locale commise lors du pas de X_1 à X_2

Erreur globale de discrétisation = erreur propagée + erreur locale

Taylor
dit bonjour…

$$u(X_{i+1}) = u(X_i) + h\ f(X_i, u(X_i)) + \frac{h^2}{2}\ u''(\xi_{i+1})$$

$$\underbrace{\boxed{u(X_{i+1})} - \boxed{U_{i+1}}}_{e^h(X_{i+1})} = \underbrace{\boxed{u(X_i)} - \boxed{U_i}}_{e^h(X_i)} + h \left(\boxed{f(X_i, u(X_i))} - \boxed{f(X_i, U_i)} \right) + \boxed{\frac{h^2}{2}\ u''(\xi_{i+1})}$$

$$U_{i+1} = U_i + h\ f(X_i, U_i)$$

… à Euler

$$\underbrace{u(X_{i+1}) - U_{i+1}}_{e^h(X_{i+1})} = \boxed{\underbrace{u(X_i) - U_i}_{e^h(X_i)} + h\ \Big(f(X_i, u(X_i)) - f(X_i, U_i) \Big)} + \boxed{\frac{h^2}{2}\ u''(\xi_{i+1})}$$

En vertu du théorème de la valeur moyenne,
il existe ζ_i dans l'intervalle entre U_i et $u(X_i)$
si f est continue et différentiable par rapport à u.

$$e^h(X_{i+1}) = \boxed{e^h(X_i) + h\ \underbrace{\Big(u(X_i) - U_i \Big)}_{e^h(X_i)} \left.\frac{\partial f}{\partial u}\right|_{(X_i,\zeta_i)}} + \boxed{\frac{h^2}{2}\ u''(\xi_{i+1})}$$

En définissant $J_i = \left.\frac{\partial f}{\partial u}\right|_{(X_i,\zeta_i)}$ et $e_{i+1} = \frac{h^2}{2}\ u''(\xi_{i+1})$,

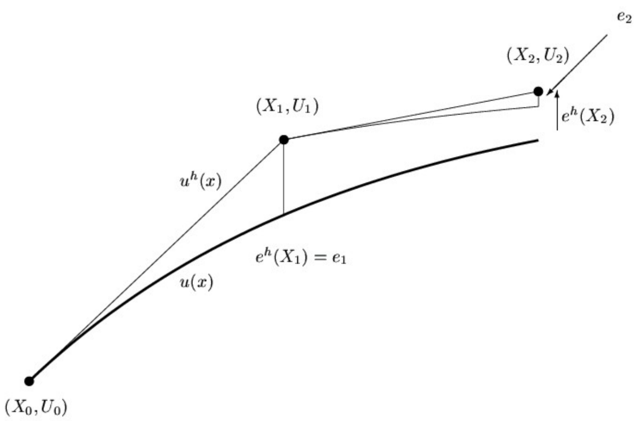
Erreur locale

$$e^h(X_{i+1}) = \boxed{e^h(X_i) \underbrace{\Big(1 + hJ_i \Big)}_{\text{AMPLIF}}} + \boxed{e_{i+1}}$$

Erreur propagée

$$a_i = (1 + hJ_i)$$

Facteur d'amplification ou d'amortissement (cas du dessin !) des erreurs précédentes

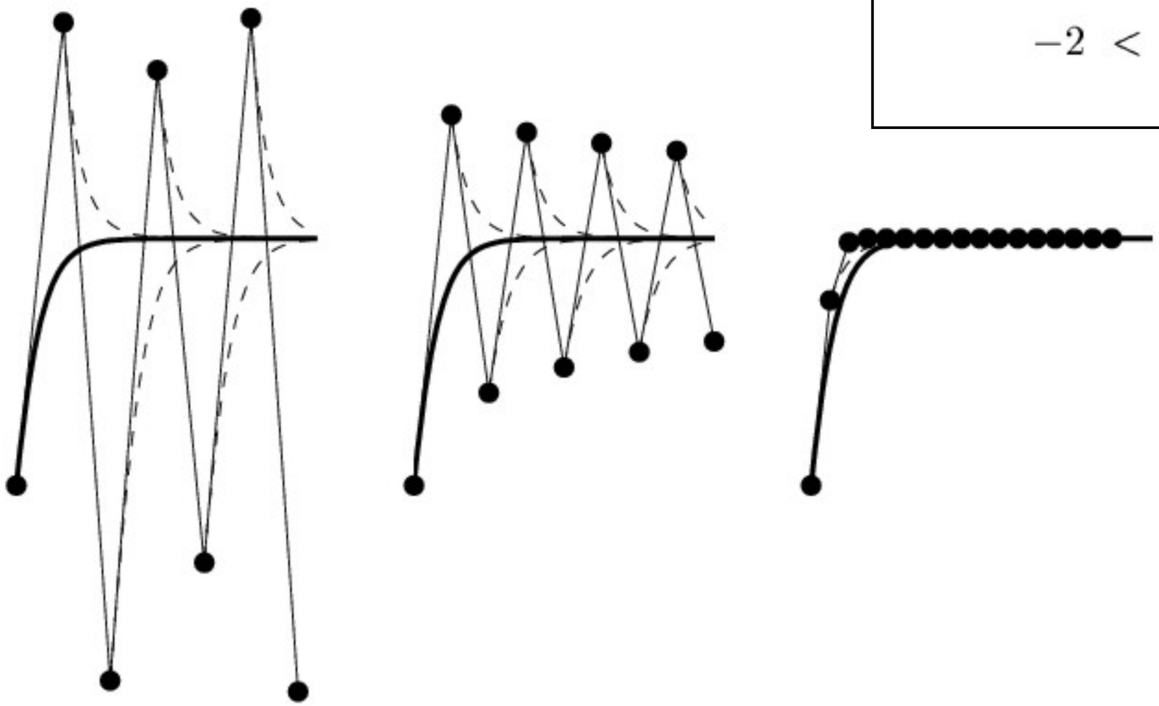


Propagation des erreurs…

$$
\begin{aligned}
e^h(X_1) &= e_1 \\
e^h(X_2) &= a_1\, e_1 + e_2 \\
e^h(X_3) &= a_2 a_1\, e_1 + a_2\, e_2 + e_3 \\
&\cdots \\
e^h(X_{i+1}) &= \underbrace{a_i a_{i-1} \ldots a_2 a_1\, e_1 + a_i \ldots a_2\, e_2 \ \ldots + a_i e_i}_{\text{erreur propagée}} + \boxed{e_{i+1}}
\end{aligned}
$$

Stabilité de la méthode d'Euler

$$
\begin{aligned}
|\overbrace{1+hJ_i}^{a_i}| &< 1 && \forall i, \\
&\downarrow \\
-2 < hJ_i &< 0 && \forall i,
\end{aligned}
$$

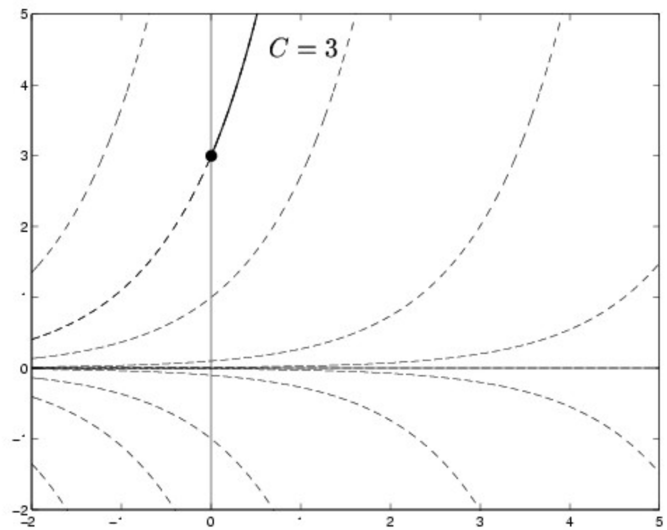


$h = 1.25$ (instable) $h = 1.00$ $h = 0.50$ (stable)

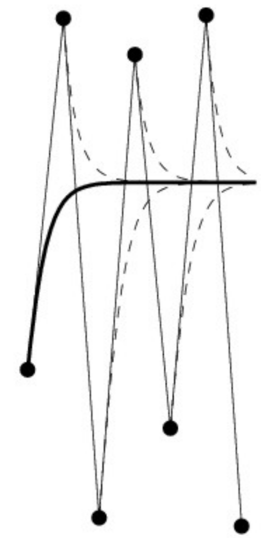
Stabilité…

Stabilité d'un système physique :
systèmes chaotiques, turbulence…

Stabilité d'un modèle mathématique :
sensibilité aux données



Stabilité d'une méthode numérique :
instabilité numérique de la méthode d'Euler explicite



Modélisation mathématique

Simulation numérique