

# Intégration sur un intervalle quelconque

## Contents

<b>1</b>	<b>Intégrabilité des fonctions positives sur un intervalle <math>I = [a, b[</math></b>	<b>3</b>
1.1	Définition . . . . .	3
1.2	Exemples . . . . .	3
1.3	Théorème de comparaison . . . . .	3
1.4	Les intégrales de Riemann . . . . .	3
1.5	Exercice : les intégrales de Bertrand . . . . .	4
1.6	Comparaison à $\frac{1}{x}$ . . . . .	4
<b>2</b>	<b>Intégrabilité des fonctions positives sur un intervalle quelconque</b>	<b>4</b>
2.1	Cas où $I = ]a, b]$ . . . . .	4
2.2	Cas où $I = ]a, b[$ . . . . .	4
2.3	Théorème de comparaison . . . . .	4
2.4	Stricte positivité . . . . .	5
2.5	Les intégrales de Riemann . . . . .	5
2.6	Exercice : la fonction $\Gamma$ . . . . .	5
2.7	Exercice : la fonction $\beta$ . . . . .	5
2.8	Exercice : les intégrales de Bertrand . . . . .	5
2.8.1	Exemples . . . . .	5
2.8.2	Cas général, au voisinage de $+\infty$ . . . . .	6
2.8.3	Cas général, au voisinage de $0$ . . . . .	6
<b>3</b>	<b>Intégrale généralisée</b>	<b>6</b>
3.1	Définition . . . . .	6
3.2	Définition . . . . .	6
3.3	Définition . . . . .	6
3.4	Dérivation . . . . .	6
3.5	Linéarité . . . . .	7
<b>4</b>	<b>Intégrabilité</b>	<b>7</b>
4.1	Définition . . . . .	7
4.2	Si $f$ est intégrable, alors $\int_a^b f$ converge . . . . .	7
4.3	Un exemple . . . . .	7
4.4	Espace des fonctions intégrables sur $I$ . . . . .	7
4.5	Inégalité triangulaire . . . . .	7
4.5.1	Si $f$ est à valeurs réelles . . . . .	8
4.5.2	Si $\int_I f$ est réel . . . . .	8
4.5.3	Cas général . . . . .	8
4.6	Intégrales semi-convergentes . . . . .	8
4.6.1	$f$ n'est pas intégrable . . . . .	8
4.6.2	L'intégrale converge . . . . .	8
4.6.3	Généralisation . . . . .	9
4.7	En résumé . . . . .	9

<b>5 Propriétés de l'intégrale généralisée</b>	<b>9</b>
5.1 Changement de variable sur un segment . . . . .	9
5.2 Changement de variable sur un intervalle . . . . .	9
5.3 Exercice : $\int_0^{+\infty} \frac{e^{-x}-e^{-2x}}{x} dx$ . . . . .	9
5.4 Intégration par parties . . . . .	10
5.5 Continuité uniforme et convergence de l'intégrale . . . . .	10
<b>6 Intégration des relations de comparaison, cas convergent</b>	<b>11</b>
6.1 Théorème . . . . .	11
6.2 Exemple . . . . .	11
<b>7 Intégration des relations de comparaison, cas divergent</b>	<b>12</b>
7.1 Théorème . . . . .	12
7.2 Exemple 1 . . . . .	12
7.3 Exemple 2 . . . . .	12

Les fonctions sont à valeurs dans  $K$ , corps des réels ou des complexes.

# 1 Intégrabilité des fonctions positives sur un intervalle $I = [a, b[$

## 1.1 Définition

Soit  $f$  continue par morceaux de  $I = [a, b[$  dans  $\mathbb{R}+$  ; on dit que l'intégrale  $\int_a^b f$  est convergente, ou que  $f$  est intégrable, si la fonction

$$F : x \rightarrow \int_a^x f$$

a une limite finie en  $b$ .

Si tel est le cas, on note  $\int_a^b f = \int_a^b f(t) dt$  cette limite.

## Remarque

L'intégrale  $\int_a^b f$  est convergente si et seulement si la fonction

$$F : x \rightarrow \int_a^x f$$

est majorée.

## 1.2 Exemples

$$\int_0^{+\infty} e^{-x} dx = ? \quad \int_1^{+\infty} \frac{dx}{x^2} = ? \quad \int_1^{+\infty} \frac{dx}{x} = ? \quad \int_0^1 \frac{dt}{\sqrt{1-t}} ? \quad \int_2^{+\infty} \frac{dx}{x \cdot \ln x} = ?$$

## Réponses

$$\int_0^{+\infty} e^{-x} dx = 1 ; \quad \int_1^{+\infty} \frac{dx}{x^2} = 1 ; \quad \int_0^1 \frac{dt}{\sqrt{1-t}} = 2.$$

## 1.3 Théorème de comparaison

Soit  $f$  et  $g$  deux fonctions continues par morceaux de  $I = [a, b[$  dans  $\mathbb{R}+$ .

- 1) Si  $0 \leq f \leq g$  et si  $g$  est intégrable, alors  $f$  est intégrable.
- 2) Si  $f$  est dominée par  $g$  au voisinage de  $b$ , et si  $g$  est intégrable, alors  $f$  est intégrable.
- 3) Si  $f \sim g$  au voisinage de  $b$ , l'intégrabilité de  $f$  équivaut à celle de  $g$ .

## Démonstration

Notons  $G : x \rightarrow \int_a^x g$ .

- 1)  $F$  est majorée par  $G$  qui est majorée sur  $I$ , donc  $F$  est majorée.
- 2) Le cas précédent se généralise aisément au cas où  $f \leq C.g$  où  $C$  est une constante. Si  $f$  est dominée par  $g$  au voisinage de  $b$ , cela signifie que  $0 \leq f \leq C.g$  sur un voisinage de  $b$ .
- 3) Si  $f \sim g$  au voisinage de  $b$ , chacune des deux est dominée par l'autre.

## 1.4 Les intégrales de Riemann

### Théorème

Soit  $\alpha \in \mathbb{R}$  ; soit  $I = [1, +\infty[$  ; soit  $f : x \rightarrow \frac{1}{x^\alpha}$  ;  $f$  est intégrable sur  $I$  si et seulement si  $\alpha > 1$  ; dans ce cas :

$$\int_1^{+\infty} \frac{dx}{x^\alpha} = \frac{1}{\alpha - 1}$$

## 1.5 Exercice : les intégrales de Bertrand

Etudier l'existence de :

$$\int_1^{+\infty} \frac{\ln x}{x} dx, \int_1^{+\infty} \frac{\sqrt{\ln x}}{x} dx, \int_1^{+\infty} \frac{\ln x}{x^2} dx$$
$$\int_1^{+\infty} \frac{(\ln x)^2}{x^{1,5}} dx, \int_2^{+\infty} \frac{dx}{x \cdot \ln x}, \int_2^{+\infty} \frac{dx}{x \cdot (\ln x)^2}, \int_2^{+\infty} \frac{dx}{\ln x}$$

## 1.6 Comparaison à $\frac{1}{x}$

Soit  $f$  continue positive sur  $I = [1, +\infty[$  ; on suppose que  $f(x) = o\left(\frac{1}{x}\right)$  ; peut-on conclure que  $\int_1^{+\infty} f$  converge ?

On suppose que  $\int_1^{+\infty} f$  converge ; peut-on conclure que  $f(x) = o\left(\frac{1}{x}\right)$  ?

### Réponse

Non pour les deux ; pour le premier :  $f(x) = \frac{1}{x \cdot \ln x}$  ; pour le deuxième : des chapeaux suffisamment pointus.

### Cas où $f$ est décroissante

On suppose que  $\int_1^{+\infty} f$  converge et que  $f$  est décroissante ; montrer que :

$$f(x) = o\left(\frac{1}{x}\right)$$

### Démonstration

Soit  $x \geq 2$  :

$$F(x) - F\left(\frac{x}{2}\right) = \int_{\frac{x}{2}}^x f \geq \frac{x}{2} f(x) \geq 0$$

## 2 Intégrabilité des fonctions positives sur un intervalle quelconque

### 2.1 Cas où $I = ]a, b]$

Soit  $f$  continue par morceaux de  $I = ]a, b]$  dans  $\mathbb{R}_+$  ; on dit que l'intégrale  $\int_a^b f$  est convergente, ou que  $f$  est intégrable, si la fonction

$$F : x \rightarrow \int_x^b f$$

a une limite finie en  $a$ .

Si tel est le cas, on note  $\int_a^b f = \int_a^b f(t) dt$  cette limite.

### 2.2 Cas où $I = ]a, b[$

Soit  $f$  continue par morceaux de  $I = ]a, b[$  dans  $\mathbb{R}_+$  ; soit  $c \in I$  ; on dit que l'intégrale  $\int_a^b f$  est convergente, ou que  $f$  est intégrable, si  $f$  est intégrable sur  $[c, b[$  et sur  $]a, c]$ .

### Remarque

On vérifie facilement que ça ne dépend pas de  $c$ .

### 2.3 Théorème de comparaison

Analogue au cas déjà vu.

## 2.4 Stricte positivité

### Théorème

Si  $f$  est continue et intégrable sur  $I$ , à valeurs positives, et d'intégrale nulle, alors  $f$  est identiquement nulle.

## 2.5 Les intégrales de Riemann

$x \rightarrow \frac{1}{x^\alpha}$  est intégrable sur  $]0, 1]$  si et seulement si  $\alpha < 1$ .  
Plus généralement :

$$x \rightarrow \frac{1}{(x-a)^\alpha}$$

est intégrable sur  $]a, a+1]$  si et seulement si  $\alpha < 1$ .

## 2.6 Exercice : la fonction $\Gamma$

Soit

$$\Gamma(x) = \int_0^{+\infty} e^{-t} \cdot t^{x-1} dt$$

Chercher le domaine de définition de  $\Gamma$ .

### Réponse

Soit  $x$  un réel.

- Tout d'abord, on constate que la fonction  $f : t \rightarrow e^{-t} \cdot t^{x-1}$  est continue sur  $I = ]0, +\infty[$  et de signe constant.

- Au voisinage de  $+\infty$  :  $t^2 \cdot f(t) = e^{-t} \cdot t^{x+1}$  tend vers 0 (croissances comparées), donc

$$f(t) = o\left(\frac{1}{t^2}\right)$$

D'après le théorème de comparaison des fonctions positives,  $f$  est intégrable au voisinage de  $+\infty$ .

- Au voisinage de 0 :

$$f(t) \sim t^{x-1}$$

Intégrable si et seulement si  $x > 0$  (intégrale de Riemann).

Conclusion :  $\Gamma$  est définie sur  $]0, +\infty[$ .

## 2.7 Exercice : la fonction $\beta$

Soit

$$\beta(x, y) = \int_0^1 t^{x-1} \cdot (1-t)^{y-1} dt$$

Chercher le domaine de définition de  $\beta$ .

### Réponse

Soit  $x, y$  des réels.

- Tout d'abord, on constate que la fonction  $f : t \rightarrow t^{x-1} \cdot (1-t)^{y-1}$  est continue sur  $I = ]0, 1[$ .

- Au voisinage de 0 :  $f(t) \sim t^{x-1}$ ; intégrable si et seulement si  $x > 0$  (intégrale de Riemann).

- Au voisinage de 1 : analogue.

Conclusion :  $\beta$  est définie sur  $]0, +\infty[^2$ .

## 2.8 Exercice : les intégrales de Bertrand

### 2.8.1 Exemples

Etudier l'existence de :

$$\int_0^1 \ln x dx, \int_0^1 \frac{\ln x}{x} dx, \int_0^1 \frac{\ln x}{x^2} dx, \int_0^1 \frac{(\ln x)^2}{\sqrt{x}} dx, \int_0^{\frac{1}{2}} \frac{dx}{x \cdot \ln x}, \int_0^{\frac{1}{2}} \frac{dx}{x \cdot (\ln x)^2}, \int_1^2 \frac{dx}{\ln x}.$$

### 2.8.2 Cas général, au voisinage de $+\infty$

$$f(t) = \frac{1}{t^\alpha \cdot \ln^\beta t}$$

- si  $\alpha > 1$ ,  $f$  est intégrable car  $|f(t)| = o\left(\frac{1}{t^\gamma}\right)$ , où  $\gamma = \frac{1+\alpha}{2}$ .
- si  $\alpha < 1$ ,  $f$  n'est pas intégrable car  $\frac{1}{t} = o(|f(t)|)$ .
- si  $\alpha = 1$ ,  $f$  est intégrable si  $\beta > 1$  (on sait calculer une primitive).

### 2.8.3 Cas général, au voisinage de 0

Ici,  $I = ]0, \frac{1}{2}]$ .

$$f(t) = \frac{1}{t^\alpha \cdot |\ln t|^\beta}$$

- si  $\alpha < 1$ ,  $f$  est intégrable car  $|f(t)| = o\left(\frac{1}{t^\gamma}\right)$ , où  $\gamma = \frac{1+\alpha}{2}$ .
- si  $\alpha > 1$ ,  $f$  n'est pas intégrable car  $\frac{1}{t} = o(|f(t)|)$ .
- si  $\alpha = 1$ ,  $f$  est intégrable si  $\beta > 1$  (on sait calculer une primitive).

## 3 Intégrale généralisée

### 3.1 Définition

Soit  $f$  continue par morceaux de  $I = [a, b[$  dans  $K$  ( $\mathbb{R}$  ou  $\mathbb{C}$ ) ; l'intégrale  $\int_a^b f$  est dite convergente si la fonction

$$x \rightarrow \int_a^x f$$

a une limite finie en  $b$ .

Si tel est le cas, on note  $\int_a^b f = \int_a^b f(t) dt$  cette limite.

### 3.2 Définition

Soit  $f$  continue par morceaux de  $I = ]a, b]$  dans  $K$  ; l'intégrale  $\int_a^b f$  est dite convergente si la fonction  $x \rightarrow \int_x^b f$  a une limite finie en  $a$ .

Si tel est le cas, on note  $\int_a^b f = \int_a^b f(t) dt$  cette limite.

### 3.3 Définition

Soit  $f$  continue par morceaux de  $I = ]a, b[$  dans  $K$  ; soit  $c \in I$  ; on dit que l'intégrale  $\int_a^b f$  converge si les deux intégrales  $\int_a^c f$  et  $\int_c^b f$  convergent.

Si tel est le cas, on note

$$\int_a^b f = \int_a^c f + \int_c^b f$$

### Remarque

On vérifie facilement que ça ne dépend pas de  $c$ .

### 3.4 Dérivation

On suppose que  $f$  est continue sur  $I = ]a, b[$  et que  $\int_I f$  converge ; dans ce cas

$$x \rightarrow \int_a^x f$$

a pour dérivée  $f$  ; de même,

$$x \rightarrow \int_x^b f$$

a pour dérivée  $-f$ .

### 3.5 Linéarité

Dans tous les cas, l'ensemble des fonctions  $f$  continues par morceaux de  $I$  dans  $K$ , telles que l'intégrale  $\int_a^b f$  converge, constitue un  $K$ -espace vectoriel.

L'application  $f \rightarrow \int_a^b f$  est linéaire sur cet espace.

## 4 Intégrabilité

### 4.1 Définition

Pour  $f$  continue par morceaux de  $I$  dans  $K$ , on dit que  $f$  est intégrable, ou que l'intégrale de  $f$  est absolument convergente, si l'intégrale  $\int_a^b |f|$  est convergente. Autrement dit :

Par définition,  $f$  est intégrable si  $|f|$  l'est.

### 4.2 Si $f$ est intégrable, alors $\int_a^b f$ converge

#### Parties positive et négative d'un réel

Pour  $x \in \mathbb{R}$ , on note  $x^+ = x$  si  $x \geq 0$  et  $x^+ = 0$  si  $x \leq 0$ .

De même, on note  $x^- = 0$  si  $x \geq 0$  et  $x^- = -x$  si  $x \leq 0$ .

Conséquences :

$$x = x^+ - x^-$$

$$|x| = x^+ + x^-$$

#### Théorème

Si  $f$  est intégrable, alors  $\int_a^b f$  converge.

#### Démonstration

On décompose  $f$  en  $f = u + iv$  ; puis  $u$  en  $u = u^+ - u^-$  ;  $v$  en  $v = v^+ - v^-$  ; toutes les fonctions  $u^+, u^-, v^+, v^-$  sont intégrables ; en effet :

$$0 \leq u^+ \leq |u| \leq |f|$$

$f$  est donc une combinaison linéaire de fonctions dont l'intégrale converge.

### 4.3 Un exemple

Soit  $a \in \mathbb{C}$ , et

$$f : t \rightarrow e^{-at}$$

A quelle condition  $f$  est-elle intégrable sur  $I = [0, +\infty[$  ?

#### Réponse

Si  $\operatorname{Re}(a) > 0$  :

$$\int_0^{+\infty} e^{-at} = \frac{1}{a}$$

### 4.4 Espace des fonctions intégrables sur $I$

L'ensemble des fonctions  $f$  continues par morceaux intégrables de  $I$  dans  $K$  constitue un  $K$ -espace vectoriel.

C'est un sous-espace vectoriel de l'ensemble des fonctions  $f$  continues par morceaux de  $I$  dans  $K$ , telles que l'intégrale  $\int_a^b f$  converge.

### 4.5 Inégalité triangulaire

Si  $f$  est intégrable sur  $I$ , alors  $|\int_I f| \leq \int_I |f|$ .

### Démonstration

#### 4.5.1 Si $f$ est à valeurs réelles

$$\forall t \in I, -|f(t)| \leq f(t) \leq |f(t)|$$

puis on intègre.

On suppose de plus  $f$  continue ; quand y a-t-il égalité ?

### Réponse

Il y a égalité si  $f$  est de signe constant.

#### 4.5.2 Si $\int_I f$ est réel

On note  $f = u + iv$  ;

$$\left| \int_I f \right| = \left| \int_I u \right| \leq \int_I |u| \leq \int_I |f|$$

On suppose de plus  $f$  continue ; quand y a-t-il égalité ?

### Réponse

Il y a égalité si  $u$  est de signe constant et  $v = 0$ .

#### 4.5.3 Cas général

On note  $\int_I f = r.e^{i\theta}$  ; on pose  $g(t) = e^{-i\theta} \cdot f(t)$  ; on applique le cas précédent à  $g$  :

$$r = \left| \int_I f \right| = \left| \int_I g \right| \leq \int_I |g| = \int_I |f|$$

On suppose de plus  $f$  continue ; quand y a-t-il égalité ?

### Réponse

Il y a égalité si  $f(t) = |f(t)| e^{i\theta}$  avec  $\theta$  réel fixé.

## 4.6 Intégrales semi-convergentes

Si  $f$  n'est pas intégrable, et que  $\int_a^b f$  converge, on dit que l'intégrale est semi-convergente.

### Exemple

$$I = [0, +\infty[ ; f(t) = \frac{\sin t}{t} ; f(0) = ?$$

#### 4.6.1 $f$ n'est pas intégrable

### Démonstration

$\forall n \geq 2, \int_{(n-1)\pi}^{n\pi} |f| \geq \frac{2}{n\pi}$  ; d'où :

$$\forall n \geq 2, \int_{\pi}^{n\pi} |f| \geq \frac{2}{\pi} \sum_{k=2}^n \frac{1}{k}$$

#### 4.6.2 L'intégrale converge

### Démonstration

$$\forall x > 1, \int_1^x \frac{\sin t}{t} dt = \left[ -\frac{\cos t}{t} \right]_1^x - \int_1^x \frac{\cos t}{t^2} dt$$

Or  $\left| \frac{\cos t}{t^2} \right|$  est dominé par  $\frac{1}{t^2}$ , donc intégrable au voisinage de  $+\infty$  ; le crochet et l'intégrale ont donc tous deux une limite finie.



### 4.6.3 Généralisation

La même méthode s'applique à :

$$\int_1^{+\infty} \frac{\cos t}{t} dt, \int_1^{+\infty} \frac{\cos t}{\sqrt{t}} dt, \int_2^{+\infty} \frac{\cos t}{\ln t} dt, \int_1^{+\infty} \frac{e^{it}}{t} dt, \dots$$

Autrement dit, une fonction cos ou sin multipliée par une fonction de classe  $C^1$  décroissante de limite nulle en  $+\infty$ .

### 4.7 En résumé

**Si  $f$  est de signe constant**

$f$  intégrable équivaut à l'intégrale de  $f$  converge.

**Dans le cas général**

$f$  intégrable entraîne que l'intégrale de  $f$  converge.

## 5 Propriétés de l'intégrale généralisée

### 5.1 Changement de variable sur un segment

**Théorème**

Soit  $\varphi$  une fonction de classe  $C^1$  sur  $I = [\alpha, \beta]$ , et  $f$  une fonction continue sur  $\varphi(I)$  ; alors

$$\int_{\varphi(\alpha)}^{\varphi(\beta)} f(t) dt = \int_{\alpha}^{\beta} f(\varphi(u)) \varphi'(u) du$$

**Remarque**

La monotonie de  $\varphi$  n'est pas nécessaire.

### 5.2 Changement de variable sur un intervalle

**Théorème**

Etant données une fonction  $f$  continue sur  $]a, b[$  et une fonction

$$\varphi : ]\alpha, \beta[ \rightarrow ]a, b[$$

bijective, strictement croissante et de classe  $C^1$ , les intégrales  $\int_a^b f(t) dt$  et  $\int_{\alpha}^{\beta} f(\varphi(u)) \varphi'(u) du$  sont de même nature et égales en cas de convergence :

$$\int_a^b f(t) dt = \int_{\alpha}^{\beta} f(\varphi(u)) \varphi'(u) du$$

**Démonstration**

On applique le théorème précédent, puis passage à la limite.

**Si  $\varphi$  est strictement décroissante**

$$\int_a^b f(t) dt = - \int_{\alpha}^{\beta} f(\varphi(u)) \varphi'(u) du$$

### 5.3 Exercice : $\int_0^{+\infty} \frac{e^{-x} - e^{-2x}}{x} dx$

$$I = \int_0^{+\infty} \frac{e^{-x} - e^{-2x}}{x} dx$$

Montrer l'existence de  $I$  ; ensuite calculer  $I$  à l'aide de

$$I(a) = \int_a^{+\infty} \frac{e^{-x} - e^{-2x}}{x} dx$$

## Réponse

Avec un changement de variable et la relation de Chasles :

$$\forall a > 0, I(a) = \int_a^{+\infty} \frac{e^{-x} - e^{-2x}}{x} dx = \int_a^{2a} \frac{e^{-u}}{u} du$$

Donc :

$$\forall a > 0, e^{-2a} \cdot \int_a^{2a} \frac{du}{u} = e^{-2a} \cdot \ln 2 \leq I(a) \leq \int_a^{2a} \frac{du}{u} = \ln 2$$

Conclusion :

$$I = \ln 2$$

Par la même méthode, si  $a > 0, b > 0$  :

$$\int_0^{+\infty} \frac{e^{-ax} - e^{-bx}}{x} dx = \ln \frac{b}{a}$$

## 5.4 Intégration par parties

### Théorème

On suppose  $f$  et  $g$  de classe  $C^1$  sur  $I = ]a, b[$  ; on suppose aussi que  $f.g$  possède des limites finies en  $a$  et en  $b$  ; alors

$$\int_a^b f.g' = [f.g]_a^b - \int_a^b f'.g$$

pourvu que l'une des deux intégrales converge.

### Remarque

Le résultat se généralise facilement au cas où  $f$  et  $g$  sont continues et  $C^1$  par morceaux.

### Attention

Le résultat ne se généralise pas au cas où  $f$  et  $g$  sont seulement  $C^1$  par morceaux.

Même si  $f = 1$  !

## 5.5 Continuité uniforme et convergence de l'intégrale

### Définition

On dit que  $f$  est uniformément continue sur  $A$  si :

$$\forall \varepsilon > 0, \exists \delta > 0, \forall x, y \in A, \|x - y\| \leq \delta \Rightarrow \|f(x) - f(y)\| \leq \varepsilon$$

### Exercice

On suppose que  $f$  est uniformément continue sur  $I = [a, +\infty[$  et que  $\int_a^{+\infty} f$  converge ; montrer que  $f$  tend vers 0 en  $+\infty$ .

### Démonstration

Fixons  $\varepsilon > 0$  ; soit  $\delta > 0$  associé par la continuité uniforme ; partons de :

$$\forall t \in [x, x + \delta], f(x) = f(x) - f(t) + f(t)$$

En intégrant :

$$\left| \int_x^{x+\delta} f(x) dt \right| \leq \left| \int_x^{x+\delta} (f(x) - f(t)) dt \right| + \left| \int_x^{x+\delta} f(t) dt \right|$$

$$\left| \int_x^{x+\delta} f(x) dt \right| \leq \int_x^{x+\delta} |f(x) - f(t)| dt + \left| \int_x^{x+\delta} f(t) dt \right|$$

$$\delta |f(x)| = \left| \int_x^{x+\delta} f(x) dt \right| \leq \varepsilon \cdot \delta + \left| \int_x^{x+\delta} f(t) dt \right|$$

puis :

$$|f(x)| \leq \varepsilon + \frac{1}{\delta} \left| \int_x^{x+\delta} f(t) dt \right| = \varepsilon + \frac{1}{\delta} |F(x+\delta) - F(x)|$$

**Conclusion ?**

$$\exists x_0 > a, \forall x > x_0, |f(x)| \leq 2\varepsilon$$

## 6 Intégration des relations de comparaison, cas convergent

### 6.1 Théorème

Soit  $f$  et  $g$  continues par morceaux de  $I = [a, b[$  dans  $K$ . On suppose de plus :

- $g$  réelle positive.
- Les deux fonctions intégrables sur  $I$ .

On note  $F(x) = \int_x^b f$  et  $G(x) = \int_x^b g$ . Alors, au voisinage de  $b$  :

Si  $f = o(g)$ , alors  $F = o(G)$  ; de même si  $f \sim g$ , ou si  $f$  est dominée par  $g$ .

#### Démonstration

On suppose  $f = o(g)$  au voisinage de  $b$ .

Soit  $\varepsilon > 0$  ; soit  $x_0 \in I$  tel que :  $\forall x \geq x_0, |f(x)| \leq \varepsilon \cdot g(x)$  ; alors :

$$\forall x \geq x_0, |F(x)| \leq \varepsilon \cdot G(x)$$

#### Cas où $f \sim g$

Dans ce cas,  $f - g = o(g)$  ; le cas précédent montre que  $F - G = o(G)$  ; donc

$$F \sim G$$

### 6.2 Exemple

Soit  $f$  continue sur  $\mathbb{R}$  ; on suppose que  $\lim_{+\infty} f = a \in \mathbb{R}$  ; soit

$$F(x) = \int_x^{+\infty} \frac{f(t)}{t^2} dt$$

Montrer l'existence de  $F(x)$  pour  $x > 0$  ; que dire de  $F$  au voisinage de  $+\infty$  ?

#### Réponse

Si  $a = 0$  :  $F(x) = o\left(\frac{1}{x}\right)$  ; si  $a \neq 0$  :  $F(x) \sim \frac{a}{x}$ .

Réponse correcte dans les deux cas ?

#### Réponse

$$\lim_{x \rightarrow +\infty} x \cdot F(x) = a$$

## 7 Intégration des relations de comparaison, cas divergent

### 7.1 Théorème

Soit  $f$  et  $g$  continues par morceaux de  $I = [a, b[$  dans  $K$ . On suppose de plus :

- $g$  réelle positive.
- $g$  non intégrable.

On note  $F(x) = \int_a^x f$  et  $G(x) = \int_a^x g$ . Alors, au voisinage de  $b$  :

Si  $f = o(g)$ , alors  $F = o(G)$  ; de même si  $f \sim g$ , ou si  $f$  est dominée par  $g$ .

#### Démonstration

Soit  $\varepsilon > 0$  ; soit  $x_0 \in I$  tel que :  $\forall x \geq x_0, |f(x)| \leq \frac{\varepsilon}{2} \cdot g(x)$  ; soit  $x \geq x_0$  ;

$$|F(x)| = \left| \int_a^x f \right| \leq |F(x_0)| + \left| \int_{x_0}^x f \right| \leq |F(x_0)| + \int_{x_0}^x |f| \leq |F(x_0)| + \frac{\varepsilon}{2} \int_{x_0}^x g$$

Donc

$$|F(x)| \leq |F(x_0)| + \frac{\varepsilon}{2} (G(x) - G(x_0)) = C + \frac{\varepsilon}{2} G(x)$$

D'où

$$\forall x \geq x_0, \frac{|F(x)|}{G(x)} \leq \frac{C}{G(x)} + \frac{\varepsilon}{2}$$

Pour conclure... ?

#### Réponse

Puisque  $G$  tend vers  $+\infty$  :

$$\exists x_1 > x_0, \forall x \geq x_1, \frac{|F(x)|}{G(x)} \leq \varepsilon$$

### 7.2 Exemple 1

Soit  $f$  fonction de classe  $C^1$  de  $\mathbb{R}$  dans  $\mathbb{R}$  ; on suppose que  $\lim_{+\infty} f' + f = 0$  ; montrer que  $\lim_{+\infty} f = 0$ .

#### Démonstration

On utilise  $g(x) = e^x \cdot f(x)$ .

Au voisinage de  $+\infty$ ,  $g$  vérifie  $g'(x) = o(e^x)$  ;  $\exp$  est positive non intégrable sur  $[0, +\infty[$  ; donc

$$g(x) - g(0) = o(e^x - 1)$$

D'où

$$e^x \cdot f(x) = o(e^x)$$

D'où le résultat.

### 7.3 Exemple 2

Trouver un équivalent quand  $x$  tend vers  $+\infty$  de

$$F(x) = \int_1^x \frac{e^t}{t} dt$$

**Réponse**

$$\forall x > 0, F(x) = \frac{e^x}{x} - e + \int_1^x \frac{e^t}{t^2} dt$$

Avec le théorème :  $\int_1^x \frac{e^t}{t^2} dt = o(F(x))$ .

Conclusion :

$$F(x) \sim \frac{e^x}{x}$$