1. Limites de suites d'intégrales

A. Exercices vu en cours

1 **Wallis** Démontrer que la suite de terme général $\int_0^{\pi/2} \sin^n t \,\mathrm{d}t$ converge, donner sa limite en appliquant un théorème puis en effectuant un découpage.

Solution de 1 : Wallis

Définissons

$$f_n : \left| \begin{array}{ccc}]0,\pi/2[& \longrightarrow & \mathbb{R} \\ t & \longmapsto & \sin^n t \end{array} \right.$$

La suite (f_n) converge simplement vers $\tilde{0}$. L'hypothèse de domination est facile à réaliser :

$$\forall n \geqslant 0 \quad \forall t \in]0,\pi/2[\qquad |\sin^n t| \leqslant 1$$

Or la fonction $t \longmapsto 1$ est indépendante de n, et intégrable sur $]0,\pi/2[$.
Les fonctions f_n et la fonction $\tilde{0}$ sont continues par morceaux, on peut alors appliquer le théorème de convergence dominée :

$$\int_0^{\pi/2} f_n \xrightarrow[n\to+\infty]{} \int_0^{\pi/2} 0 = 0$$

---

2 **Utilité de l'hypothèse de domination**

Définissons, sur $[0,1]$, f_n continue affine par morceaux nulle en 0 et sur $\left[\dfrac{1}{n+1},1\right]$, et prenant en $\dfrac{1}{n+1}$ la valeur $n+1$.

Étudier la convergence simple de (f_n) et la convergence de $\left(\displaystyle\int_{[0,1]} f_n\right)_{n\in\mathbb{N}}$.

3 **CCINP 25**

1. Démontrer que, pour tout entier naturel n, la fonction $t \longmapsto \dfrac{1}{1+t^2+t^n e^{-t}}$ est intégrable sur $[0,+\infty[$.
2. Pour tout $n \in \mathbb{N}$, pose $u_n = \displaystyle\int_0^{+\infty} \frac{\mathrm{d}t}{1+t^2+t^n e^{-t}}$. Calculer la limite de (u_n).

Solution de 3 : CCINP 25

1. $f : t \longmapsto \dfrac{1}{1+t^2+t^n e^{-t}}$ est continue et positive sur $[0,+\infty[$.
   De plus, pour tout $t \in \mathbb{R}^+$, $0 \leqslant \dfrac{1}{1+t^2+t^n e^{-t}} \leqslant \dfrac{1}{1+t^2}$ avec
   $$\int_0^{+\infty} \frac{\mathrm{d}t}{1+t^2} = \Big[\operatorname{Arctan} t\Big]_0^{+\infty} = \frac{\pi}{2} < +\infty$$
   donc $\displaystyle\int \frac{\mathrm{d}t}{1+t^2+t^n e^{-t}}$ converge et ainsi, par positivité, f est intégrable sur $[0,+\infty[$.
   Autre rédaction possible : dans $[0,+\infty]$,
   $$0 \leqslant \int \frac{\mathrm{d}t}{1+t^2+t^n e^{-t}} \leqslant \int_0^{+\infty} \frac{\mathrm{d}t}{1+t^2} = \frac{\pi}{2} < +\infty$$
   d'où la convergence de l'intégrale puis l'intégrabilité par positivité.
2. **H1** La suite de fonctions (f_n) converge simplement sur $[0,+\infty[$ vers la fonction f définie par
   $$f(t) = \begin{cases} \dfrac{1}{1+t^2} & \text{si } t \in [0,1[\\ \dfrac{1}{2+\mathrm{e}^{-1}} & \text{si } t = 1 \\ 0 & \text{si } t \in]1,+\infty[\end{cases}$$

H2 Les fonctions f_n et f sont continues par morceaux sur $[0,+\infty[$.

H3 $\forall t \in [0,+\infty[, \left|f_n(t)\right| \leqslant \phi(t)$ avec ϕ positive, continue et intégrable sur $[0,+\infty[$.
Alors, d'après le théorème de convergence dominée,

$$u_n = \int_0^{+\infty} f_n(t)\,\mathrm{d}t \xrightarrow[n\to+\infty]{} \int_0^{+\infty} f(t)\,\mathrm{d}t = \int_0^1 \frac{\mathrm{d}t}{1+t^2} = \frac{\pi}{4}.$$

Donc $\boxed{u_n \xrightarrow[n\to+\infty]{} \frac{\pi}{4}.}$

---

4 **CCINP 26** Pour tout entier $n \geqslant 1$, on pose $I_n = \displaystyle\int_0^{+\infty} \frac{1}{(1+t^2)^n}\,\mathrm{d}t$.

1. Justifier que I_n est bien définie.
2. (a) Étudier la monotonie de la suite $(I_n)_{n\in\mathbb{N}^*}$.
   (b) Déterminer la limite de la suite $(I_n)_{n\in\mathbb{N}^*}$.
3. La série $\sum\limits_{n\geqslant 1}(-1)^n I_n$ est-elle convergente ?

Solution de 4 : CCINP 26

Posons pour tout $n \in \mathbb{N}^*$ et $t \in [0,+\infty[$, $f_n(t) = \dfrac{1}{(1+t^2)^n}$.

1. Soit $n \in \mathbb{N}^*$, f_n est continue sur $[0,+\infty[$. De plus, $f_n(t) \underset{+\infty}{\sim} \dfrac{1}{t^{2n}}$.

   Or $n \geqslant 1$, alors $t \longmapsto \dfrac{1}{t^{2n}}$ est intégrable sur $[1,+\infty[$ par critère de Riemann.

   Donc, par équivalence, $\boxed{f_n \text{ est intégrable}}$ sur $[1,+\infty[$ donc $\boxed{\text{sur } [0,+\infty[.}$

2. (a) $\forall t \in [0,+\infty[$, $f_{n+1}(t) = \dfrac{1}{(1+t^2)^{n+1}} \leqslant \dfrac{1}{(1+t^2)^n} = f_n(t)$ car $1+t^2 \geqslant 1$.
   En intégrant, on obtient

   $$\forall n \in \mathbb{N}^*,\ I_{n+1} \leqslant I_n.$$

   Donc $\boxed{(I_n)_{n\in\mathbb{N}^*} \text{ est décroissante.}}$

   (b) Remarque : $(I_n)_{n\in\mathbb{N}^*}$ est décroissante et positive ce qui nous assure la convergence de la suite $(I_n)_{n\in\mathbb{N}^*}$.
   Déterminons la limite de la suite $(I_n)_{n\in\mathbb{N}^*}$.

   H1 La suite de fonctions $(f_n)_{n\geqslant 1}$ converge simplement sur $[0,+\infty[$ vers la fonction f définie sur $[0,+\infty[$ par

   $$f(x) = \begin{cases} 0 & \text{si } x > 0 \\ 1 & \text{si } x = 0 \end{cases}$$

   H2 Les f_n et f sont continue par morceaux sur $[0,+\infty[$.

   H3 Domination

   $$\forall t \in [0,+\infty[,\ \forall n \in \mathbb{N}^*,\ \left|f_n(t)\right| \leqslant \frac{1}{1+t^2} = \phi(t)$$

   avec ϕ continue et positive sur $[0,+\infty[$ et

   $$\int_0^{+\infty} \left|\phi(t)\right|\,\mathrm{d}t = \int_0^{+\infty} \frac{\mathrm{d}t}{1+t^2} = \left[\operatorname{Arctan} t\right]_0^{+\infty} = \frac{\pi}{2} < +\infty,$$

   donc ϕ est intégrable sur $[0,+\infty[$.

   Par le théorème de convergence dominée on obtient

   $$I_n = \int_0^{+\infty} f_n(t)\,\mathrm{d}t \xrightarrow[n\to+\infty]{} \int_0^{+\infty} f(t)\,\mathrm{d}t = 0$$

   et $\boxed{\text{la suite } (I_n)_{n\in\mathbb{N}^*} \text{ a pour limite } 0.}$

3. D'après les questions précédentes, la suite $(I_n)_{n\in\mathbb{N}^*}$ est positive, décroissante et converge vers 0.
   Donc, par application du théorème spécial des séries alternées, on peut affirmer que

   $$\boxed{\text{la série } \sum_{n\geqslant 1}(-1)^n I_n \text{ converge.}}$$

---

5 CCINP 27

Pour tout $n \in \mathbb{N}^*$, on pose $f_n(x) = \dfrac{e^{-x}}{1+n^2x^2}$ et $u_n = \displaystyle\int_0^1 f_n(x)\,\mathrm{d}x$.

1. Étudier la convergence simple de la suite de fonctions (f_n) sur $[0,1]$.
2. Soit $a \in]0,1[$. La suite de fonctions (f_n) converge-t-elle uniformément sur $[a,1]$?
3. La suite de fonctions (f_n) converge-t-elle uniformément sur $[0,1]$?
4. Trouver la limite de la suite $(u_n)_{n\in\mathbb{N}^*}$.

Solution de 5 : CCINP 27

1. On a déjà $f_n(0) = 1 \xrightarrow[n\to+\infty]{} 0$.

   Soit $x \in]0,1]$. Pour n au voisinage de $+\infty$, $f_n(x) \underset{+\infty}{\sim} \dfrac{\mathrm{e}^{-x}}{x^2}\dfrac{1}{n^2}$, donc $f_n(x) \xrightarrow[n\to+\infty]{} 0$.
   On en déduit que la suite de fonctions (f_n) converge simplement sur $[0,1]$ vers la fonction f définie par

   $$\boxed{f(x) = \begin{cases} 0 & \text{si } x \in]0,1] \\ 1 & \text{si } x = 0 \end{cases}}$$

2. Soit $a \in]0;1[$.

   $$\forall\, n \in \mathbb{N}^*,\ \forall\, x \in [a,1],\ \left|f_n(x) - f(x)\right| = f_n(x) \leqslant \frac{\mathrm{e}^{-a}}{1+n^2a^2}$$

   Comme cette majoration est indépendante de x, $\left\|f_n - f\right\|_{\infty,[a,1]} \leqslant \dfrac{\mathrm{e}^{-a}}{1+n^2a^2}$.
   Or $\dfrac{\mathrm{e}^{-a}}{1+n^2a^2} \xrightarrow[n\to+\infty]{} 0$, donc $\left\|f_n - f\right\|_{\infty,[a,1]} \xrightarrow[n\to+\infty]{} 0$.
   On en déduit que $\boxed{(f_n) \text{ converge uniformément vers } f \text{ sur } [a,1].}$

3. Les fonctions f_n étant continues sur $[0,1]$ et la limite simple f ne l'étant pas, on peut assurer qu'il n'y a $\boxed{\text{pas convergence uniforme sur } [0,1].}$

4. **H1** (f_n) converge simplement vers f sur $[0,1]$.
   H2 Les fonctions f_n et f sont continues par morceaux sur $[0,1]$.
   H3 $\forall x \in [0,1], \left|f_n(x)\right| \leqslant \mathrm{e}^{-x} \leqslant 1 = \varphi(x)$ avec $\varphi : [0,1] \to \mathbb{R}^+$ continue, positive, intégrable sur $[0,1]$.
   D'après le théorème de convergence dominée, on peut donc affirmer que :

   $$\boxed{u_n = \int_0^1 f_n(x)\,\mathrm{d}x \xrightarrow[n\to+\infty]{} \int_0^1 f(x)\,\mathrm{d}x = 0.}$$

6 Calcul de limite d'une transformée de Laplace

Montrer que $\displaystyle\int_0^{+\infty} \frac{e^{-xt}}{1+t^2}\,\mathrm{d}t$ a une limite quand $x \to +\infty$; la calculer.

Solution de 6 : Calcul de limite d'une transformée de Laplace

Domination par $\dfrac{1}{1+t^2}$, limite nulle.

7 Théorèmes de la valeur initiale et de la valeur finale

Soit f une fonction continue sur $[0,+\infty[$, ayant une limite (finie) en $+\infty$. On sait alors qu'elle est bornée. On définit, si $x > 0$, $F(x) = \displaystyle\int_0^{+\infty} e^{-xt} f(t)\,\mathrm{d}t$. Montrer que $xF(x)$ a des limites en 0 et en $+\infty$, les calculer.

Solution de 7 : Théorèmes de la valeur initiale et de la valeur finale

Changement de variable $u = st$.

8 Utilisation pour le calcul d'une intégrale semi-convergente

Montrer que l'intégrale généralisée $I = \int_0^{+\infty} \frac{\sin t}{t}\,\mathrm{d}t$ converge.

On définit, si $x \geqslant 0$, $F(x) = \int_0^{+\infty} e^{-xt}\frac{\sin t}{t}\,\mathrm{d}t$.

Calculer la limite de F en $+\infty$.
Puis montrer que $F(x) \xrightarrow[x\to 0]{} F(0)$, autrement dit que F est continue en 0.

On pourra utiliser la fonction $g : x \to \int_0^x \frac{\sin t}{t}\,\mathrm{d}t$ et l'exercice précédent.

B. Autres exercices

9 On pose $I_n = \int_0^1 \frac{\mathrm{d}u}{1+u^n}$ pour $n \in \mathbb{N}$. Démontrer que la suite (I_n) converge vers une limite ℓ, et trouver un équivalent de $I_n - \ell$.

Solution de 9 :
Par théorème de convergence dominée, fonction dominatrice : $\tilde{1}$, on trouve une limite égale à 1. Ensuite, première technique : si on veut comparer une intégrale à un nombre, on écrit ce nombre sous forme d'intégrale. Ici

$$1 - I_n = \int_0^1 \frac{u^n}{1+u^n}\,\mathrm{d}u$$

Puis, technique habituelle pour ce genre d'exercice (qu'on rencontre à l'oral), on fait un changement de variable : $t = u^n$, ou plutôt $u = t^{1/n}$. Ce qui fait sortir un $1/n$. En facteur d'une intégrale à laquelle il est facile d'appliquer le théorème de convergence dominée (encore la fonction dominante $\tilde{1}$). On trouve l'équivalent

$$\frac{\ln 2}{n}$$

---

10 Soit f réelle continue sur $[0,1]$. Montrer que la suite de terme général $n\int_0^1 t^n f(t)\,\mathrm{d}t$ admet pour limite $f(1)$.

Solution de 10 :
Changement de variable $t^n = u$, ou plutôt $t = u^{1/n}$. Fonction dominatrice, par exemple : $\widetilde{N_\infty(f)}$.

---

11 Déterminer, si elle existe, la limite de la suite de terme général $\int_0^1 \frac{f(t)}{1+nt}\,\mathrm{d}t$ où f est une fonction continue sur le segment $[0,1]$.

Solution de 11 :
Limite nulle...Fonction dominatrice $|f|$ par exemple.

---

12 Soit f continue sur $[0,1]$.

1. Déterminer la limite ℓ quand n tend vers l'infini de $\int_0^1 \frac{f(t^n)}{1+t}\,\mathrm{d}t$
2. On suppose f dérivable en 0 telle que $\int_0^1 \frac{f(u)-f(0)}{u}\,\mathrm{d}u \neq 0$.

   Déterminer un équivalent de $\int_0^1 \frac{f(t^n)}{1+t}\,\mathrm{d}t \;-\ell$

Solution de 12 :
La limite est $\ln 2\; f(0)$ (théorème de convergence dominée, fonction dominatrice, par exemple $\widetilde{N_\infty(f)}$). Puis (remarquons que la limite s'écrit sous forme d'une intégrale, forme à laquelle il faut évidemment revenir)

$$\int_0^1 \frac{f(t^n)}{1+t}dt \;-\ell = \int_0^1 \frac{f(t^n)-f(0)}{1+t}\,\mathrm{d}t$$

Le changement de variable habituel dans ce genre d'exercice : $u = t^n$, ou plutôt $t = u^{1/n}$.

$$\int_0^1 \frac{f(t^n)}{1+t}\,\mathrm{d}t \;-\ell = \frac{1}{n}\int_0^1 \frac{f(u)-f(0)}{u}\,\frac{u^{1/n}}{1+u^{1/n}}\,\mathrm{d}u$$

La fonction $g\ :\ u \longmapsto \dfrac{f(u)-f(0)}{u}$ se prolonge à $[0,1]$ en restant continue. On en déduit, par théorème de convergence dominée (domination par exemple par $\widetilde{N_\infty(g)}$) qu'un équivalent est

$$\frac{1}{2n}\int_0^1 \frac{f(u)-f(0)}{u}\mathrm{d}u$$

sous réserve que cette intégrale soit non nulle.

13 Oral Mines-Centrale

Soit f continue sur $[0,1]$, à valeurs réelles. Etudier la convergence de la suite de terme général $\int_0^1 f\left(t^n\right)\mathrm{d}t$.

Solution de 13 : Oral Mines-Centrale

Théorème de congergence dominée, domination par exemple par $\widetilde{N_\infty(f)}$. La limite est $f(0)$.

14 Oral Mines

Étudier la limite de la suite de terme général $\int_0^{+\infty} \exp\left(-t^n\right)\mathrm{d}t$.

Solution de 14 : Oral Mines

Théorème de convergence dominée.

La convergence simple s'étudie en distinguant les cas $t<1$, $t=1$, $t>1$.

Domination par la fonction $\phi : t \mapsto \begin{cases} 1 & \text{si } 0<t<1 \\ \exp(-t) & \text{si } t \geqslant 1 \end{cases}$ (il faut avoir une fonction dominante intégrable...).

La limite est 1.

Autre possibilité : découper en $\int_0^{+\infty} \exp\left(-t^n\right)\mathrm{d}t = \int_0^1 \exp\left(-t^n\right)\mathrm{d}t + \int_1^{+\infty} \exp\left(-t^n\right)\mathrm{d}t$ et calculer les deux limites séparément.

15

Trouver un équivalent quand $n \to +\infty$ de $\int_0^1 \frac{t^n}{\sqrt{1+t^n}}\mathrm{d}t$.

Solution de 15 :

On pourrait espérer une limite, mais si le TCVD s'applique, cette limite va être nulle. On fait un changement de variable $t^n=u$, $t=u^{1/n}$. On obtient

$$I_n = \frac{1}{n}\int_0^1 \frac{u^{1/n}}{\sqrt{1+u}}\mathrm{d}u$$

La domination

$$\forall u\in[0;1] \qquad \left|\frac{u^{1/n}}{\sqrt{1+u}}\right| \leqslant \frac{1}{\sqrt{1+u}}$$

(ou $\leqslant 1$, tout simplement) permet d'appliquer le théorème de convergence dominée pour obtenir

$$\int_0^1 \frac{u^{1/n}}{\sqrt{1+u}}\mathrm{d}u \xrightarrow[n\to+\infty]{} \int_0^1 \frac{1}{\sqrt{1+u}}\mathrm{d}u$$

D'où l'équivalent :

$$\frac{2(\sqrt{2}-1)}{n}$$

16

Pour tout entier naturel non nul n, on définit $I_n = \int_0^n \left(1-\frac{x}{n}\right)^n \ln x\ \mathrm{d}x$.

Démontrer que la suite (I_n) converge vers une limite que l'on exprimera sous forme intégrale.

Solution de 16 :

On peut montrer l'existence de l'intégrale pour commencer.

Puis on considère $\phi_n\ :\ x \mapsto \left(1-\frac{x}{n}\right)^n \ln x\ \mathbf{1}_{]0,n[}(x)$. La suite (ϕ_n) converge simplement sur $]0,+\infty[$ vers $x\mapsto e^{-x}\ln x$. Et on montre, à l'aide de l'inégalité classique $\ln(1+u)\leqslant u$, que la suite (ϕ_n) est dominée par sa limite, limite qui est intégrable (on fait des études sur $]0,1]$ et sur $[1,+\infty[$, et on compare à l'exemple de Riemann dans chacun des cas).

17 **Oral CCINP** Soit $[\alpha,\beta]$ un segment réel ; soient (a_n) et (b_n) des suites telles que, pour tout n, $\alpha \leqslant a_n \leqslant b_n \leqslant \beta$ et (a_n) tend vers α, (b_n) tend vers β. Soit (f_n) une suite de fonctions réelles continues sur $[\alpha,\beta]$ convergeant uniformément vers une certaine fonction f.

1. Etudier la convergence de la suite de terme général $\displaystyle\int_{a_n}^{b_n} f_n(t)\,\mathrm{d}t$.
2. Soit $g : [1,e] \mapsto \mathbb{R}$ continue. Montrer que la suite de terme général $n\displaystyle\int_1^{1+1/n} g\left(t^n\right)\mathrm{d}t$ converge vers $\displaystyle\int_1^e \frac{g(s)}{s}\,\mathrm{d}s$.

Solution de 17 : Oral CCINP

Pour la première question, la limite est $\displaystyle\int_\alpha^\beta f(t)\,\mathrm{d}t$, on peut montrer que la différence tend vers 0 grâce à la majoration obtenue par découpage :

$$\left|\int_{a_n}^{b_n} f_n(t)\,dt - \int_\alpha^\beta f(t)\mathrm{d}t\right| \leqslant (b_n - a_n)\|f_n - f\|_\infty + \|f\|_\infty\left(\beta - b_n + a_n - \alpha\right)$$

On peut aussi utiliser le théorème de convergence dominée en introduisant la fonction indicatrice de $[\alpha_n, \beta_n]$ mais c'est plus sophistiqué.
Pour la deuxième question on fait le changement de variable $u = t^n$, $t = u^{1/n}$, on aboutit à

$$\int_1^{1+1/n} g(t^n)\mathrm{d}t = \frac{1}{n}\int_1^{\beta_n} \frac{u^{1/n} g(u)}{u}\mathrm{d}u$$

et on utilise la première question.

2. Interversions séries-intégrales

A. Exercices vus en cours

18 Montrer que $\displaystyle\int_0^{+\infty} \frac{t}{e^t - 1}\,\mathrm{d}t = \sum_{n=1}^{+\infty} \frac{1}{n^2}$.

19 On suppose que (a_n) est une suite de nombres complexes telle que $\sum |a_n|$ converge.

On définit, sur $\mathbb{R}$, $f : t \mapsto \displaystyle\sum_{p=1}^{+\infty} a_p \sin(pt)$.

Montrer que, pour tout $m \in \mathbb{N}_*$, $\displaystyle\frac{1}{\pi}\int_{-\pi}^{\pi} \sin(mt) f(t)\,\mathrm{d}t = a_m$.

20 Montrer que $\displaystyle\int_0^{+\infty} \frac{1}{1+e^t}\,\mathrm{d}t = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{(-1)^n}{n+1}$.

21 **ex CCINP 19**

1. Prouver que, pour tout entier naturel n, $f_n : t \longmapsto t^n \ln t$ est intégrable sur $]0,1]$ et calculer $I_n = \displaystyle\int_0^1 t^n \ln t\,\mathrm{d}t$.
2. Prouver que $f : t \longmapsto \mathrm{e}^t \ln t$ est intégrable sur $]0,1]$ et que $\displaystyle\int_0^1 \mathrm{e}^t \ln t\,\mathrm{d}t = -\sum_{n=1}^{+\infty} \frac{1}{n\,n!}$.

   Indication : utiliser le développement en série entière de la fonction exponentielle.

Solution de 21 : ex CCINP 19

1. On pose, pour tout entier naturel n, $f_n : t \in]0,1] \mapsto t^n \ln t$, continue sur $]0,1]$.

   On a $t^{\frac{1}{2}}|f_n(t)| \underset{t\to 0}{\longrightarrow} 0$ donc, au voisinage de 0, $|f_n(t)| = \mathrm{o}\left(\dfrac{1}{t^{\frac{1}{2}}}\right)$.

   Or, $t \mapsto \dfrac{1}{t^{\frac{1}{2}}}$ est intégrable sur $]0,1]$(fonction de Riemann intégrable). Donc f_n est intégrable sur $]0,1]$.
   De plus, pour $x \in]0,1]$, par intégration par parties

$$\int_x^1 t^n \ln t\,dt = \left[\frac{t^{n+1}\ln t}{n+1}\right]_x^1 - \int_x^1 \frac{t^n}{n+1}\,dt = -\frac{x^{n+1}\ln x}{n+1} - \frac{1}{(n+1)^2} + \frac{x^{n+1}}{(n+1)^2}.$$

   On en déduit, en faisant tendre x vers 0, que $\boxed{I_n = -\dfrac{1}{(n+1)^2}.}$

2. $\forall\, t \in \mathbb{R}$, $\mathrm{e}^t = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{t^n}{n!}$ donc, pour tout $t \in]0,1]$, $f(t) = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{t^n \ln t}{n!}$.

   On pose $\forall\, n \in \mathbb{N}$, $g_n : t \in]0,1] \mapsto \frac{t^n \ln t}{n!}$. Sous réserve de pouvoir intervertir, on obtiendra
$$\int_0^1 \mathrm{e}^t \ln t \,\mathrm{d}t = \int_0^1 \sum_{n=0}^{+\infty} g_n(t)\mathrm{d}t = \sum_{n=0}^{+\infty} \int_0^1 \frac{t^n \ln t}{n!}\mathrm{d}t = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{I_n}{n!} = -\sum_{n=0}^{+\infty} \frac{1}{n!(n+1)^2} = -\sum_{n=0}^{+\infty} \frac{1}{(n+1)!(n+1)}.$$

   C'est-à-dire $\boxed{\int_0^1 \mathrm{e}^t \ln t \,\mathrm{d}t = -\sum_{n=1}^{+\infty} \frac{1}{n\, n!}.}$ Justifions l'intégration terme à terme :

   H1 $\sum g_n$ converge simplement sur $]0,1]$ et a pour somme f qui est continue par morceaux sur $]0,1]$.

   H2 $\forall n \in \mathbb{N}$, g_n est intégrable sur $]0,1]$ d'après la question 1.

   H3 $N_1(g) = \int_0^1 |g_n(t)|\,\mathrm{d}t = \int_0^1 \frac{-t^n \ln t}{n!}\mathrm{d}t = \frac{-I_n}{n!} = \frac{1}{(n+1)^2 n!}$. On a donc
$$\forall\, n \in \mathbb{N},\ 0 \leqslant N_1(g_n) \leqslant \frac{1}{(n+1)^2}.$$

   De plus, $\sum \frac{1}{(n+1)^2} = \sum_{n\geqslant 1} \frac{1}{n^2}$ converge, donc, par critère de majoration des séries à termes positifs, $\sum \frac{1}{(n+1)^2 n!}$ converge.

   Le théorème d'intégration terme à terme pour les séries de fonctions s'applique et il donne en particulier $\boxed{\text{l'intégrabilité de } f.}$

---

22 **CCINP 49** Soit $\sum a_n$ une série absolument convergente à termes complexes. On pose $M = \sum_{n=0}^{+\infty} |a_n|$.

On pose : $\forall n \in \mathbb{N}$, $\forall t \in [0,+\infty[$, $f_n(t) = \frac{a_n t^n}{n!}\mathrm{e}^{-t}$.

1. (a) Justifier que la suite (a_n) est bornée.

   (b) Justifier que la série de fonctions $\sum f_n$ converge simplement sur $[0,+\infty[$.

   On admettra, pour la suite de l'exercice, que $f : t \mapsto \sum_{n=0}^{+\infty} f_n(t)$ est continue sur $[0,+\infty[$.

2. (a) Justifier que, pour tout $n \in \mathbb{N}$, la fonction $g_n : t \mapsto t^n \mathrm{e}^{-t}$ est intégrable sur $[0,+\infty[$ et calculer $\int_0^{+\infty} g_n(t)\mathrm{d}t$.

   En déduire la convergence et la valeur de $\int_0^{+\infty} |f_n(t)|\,\mathrm{d}t$.

   (b) Prouver que $\int_0^{+\infty} \left(\sum_{n=0}^{+\infty} \frac{a_n t^n}{n!}\mathrm{e}^{-t}\right)\mathrm{d}t = \sum_{n=0}^{+\infty} a_n$.

Solution de 22 : CCINP 49

1. Rappelons que, $\forall x \in \mathbb{R}$, $\sum \frac{x^n}{n!}$ converge vers e^x.

   (a) $\sum a_n$ converge absolument, donc converge simplement ; donc la suite (a_n) converge vers 0 et donc $\boxed{\text{elle est bornée.}}$

   Autre méthode : On remarque que $\forall n \in \mathbb{N}$ $|a_n| \leqslant M = \sum_{p=0}^{+\infty} |a_p|$.

   (b) Soit $t \in [0,+\infty[$. On a $\forall n \in \mathbb{N}$, $|f_n(t)| \leqslant M \frac{t^n}{n!}$. Or la série $\sum \frac{t^n}{n!}$ converge, donc $\sum f_n(t)$ converge absolument, donc converge.

   On a donc vérifié la $\boxed{\text{convergence simple de } \sum f_n \text{ sur } [0,+\infty[.}$

2. (a) Soit $n \in \mathbb{N}$. g_n est continue sur $[0,+\infty[$ et $t^2 g_n(t) \xrightarrow[t\to+\infty]{} 0$, donc, au voisinage de $+\infty$, $g_n(t) = \mathrm{o}\left(\frac{1}{t^2}\right)$.

   Or $t \mapsto \frac{1}{t^2}$ est intégrable sur $[1,+\infty[$, donc g_n est intégrable sur $[1,+\infty[$ donc sur $[0,+\infty[$.

   On pose alors $\forall n \in \mathbb{N}$, $I_n = \int_0^{+\infty} g_n(t)\mathrm{d}t$.

   En effectuant une intégration par parties, on prouve que $I_n = nI_{n-1}$. On en déduit par récurrence que $I_n = n! I_0 = n!$. Alors

   $\boxed{t \mapsto |f_n(t)| \text{ est intégrable sur } [0,+\infty[}$ car $|f_n(t)| = \frac{|a_n|}{n!} g_n(t)$ et on a $\boxed{\int_0^{+\infty} |f_n(t)|\mathrm{d}t = |a_n|.}$

(b) **H1** $\sum f_n$ converge simplement sur $[0,+\infty[$ et a pour somme $f=\sum_{n=0}^{+\infty} f_n$ d'après 1.(b) dont on a admis la continuité sur $[0,+\infty[$.

H2 $\forall n\in\mathbb{N}$, f_n est intégrable sur $[0,+\infty[$ d'après la question 2.(a)

H3 $N_1(f_n)=\int_0^{+\infty}\left|f_n(t)\right|\mathrm{d}t=|a_n|$ terme général de série convergente par hypothèse.

Alors, d'après le théorème d'intégration terme à terme pour les séries de fonctions, f est intégrable sur $[0,+\infty[$ et on a

$$\int_0^{+\infty}\left(\sum_{n=0}^{+\infty}\frac{a_n\,t^n}{n!}\,e^{-t}\right)\mathrm{d}t=\sum_{n=0}^{+\infty}\int_0^{+\infty}\frac{a_n\,t^n}{n!}\,e^{-t}\,\mathrm{d}t=\sum_{n=0}^{+\infty}\frac{a_n}{n!}\int_0^{+\infty}t^n\,e^{-t}\,\mathrm{d}t=\sum_{n=0}^{+\infty}\frac{a_n}{n!}\,n!=\sum_{n=0}^{+\infty}a_n.$$

B. Autres exercices

23 Montrer, en utilisant des séries géométriques, que

1. $\int_0^1\frac{\ln^2 t}{1+t^2}\,\mathrm{d}t=2\sum_{n=0}^{+\infty}\frac{(-1)^n}{(2n+1)^3}$.
2. $\int_0^{+\infty}\frac{\sin t}{\mathrm{e}^t-1}\,\mathrm{d}t=\sum_{n=0}^{+\infty}\frac{1}{n^2+1}$.
3. $\int_0^1\frac{\ln t}{t-1}\,\mathrm{d}t=\sum_{n=1}^{+\infty}\frac{1}{n^2}$.

Solution de 23 :

1. Théorème d'inversion N_1, pas de problème pour vérifier les hypothèse, le calcul de la norme N_1 se fait par double IPP, elle vaut $\frac{2}{(2n+1)^3}$ (comme on s'y attend).
2. On factorise par e^{-t}, puis théorème d'inversion N_1, pour la convergence de $N_1(f_n)$, utiliser l'inégalité classique $|\sin t|\leqslant|t|$ puis intégrer par partie. Intégrer après interversion avec $\sin t=\mathfrak{Im}\left(\mathrm{e}^{\mathrm{i}t}\right)$.
3. Inversion N_1, l'intégrale de la norme N_1 se calcule par partie, on trouve $\frac{1}{(n+1)^2}$. Le reste est facile.

24 **Oral Mines** Soit $I_n=\int_0^1\frac{t^n\ln t}{t^2-1}\,\mathrm{d}t$. Calculer la limite de I_n, puis un équivalent de I_n.

Solution de 24 : Oral Mines

Soit $f_n:t\in[0,1[\longmapsto\frac{t^n\ln t}{t^2-1}$.
Pour tout $n\in\mathbb{N}$, f_n est continue sur $]0,1[$, et(f_n) converge simplement vers la fonction nulle sur $]0,1[$ qui est continue.
De plus, si $n\in\mathbb{N}$ et $t\in[0,1[$, $\left|f_n(t)\right|\leqslant\phi(t)=\frac{\ln t}{t^2-1}$ avec $\phi:]0,1[\to\mathbb{R}^+$ continue, positive, intégrable sur $]0,1/2]$ car négligeable devant $t\mapsto\frac{1}{\sqrt{t}}$ au voisinage de 0 et intégrable sur $[1/2,1[$ car au voisinage de 1, $\phi(t)\sim\frac{t-1}{2(t-1)}=\frac{1}{2}$ donc prolongeable par continuité.
Par théorème de convergence dominée, I_n existe et $I_n\to 0$.
Puis, en fixant un n, $I_n=-\int_0^1 t^n\ln t\sum_{k=0}^{+\infty}t^{2k}\,\mathrm{d}t=\int_0^1\sum_{k=0}^{+\infty}t^{2k+n}(-\ln t)\,\mathrm{d}t$.
On pose $g_k:t\in]0,1[\mapsto t^{2k+n}(-\ln t)$ intégrable sur $]0,1[$ avec des arguments similaires à ϕ ci-dessus.
De plus, avec ce qui précède, $\sum g_k$ converge simplement vers $t\mapsto f_n(t)$ qui est continue sur $]0,1[$.

Enfin, $\int_0^1\left|g_k(t)\right|\mathrm{d}t=\int_0^1 g_k(t)\mathrm{d}t=-\int_0^1 t^{2k+n}\ln t\,\mathrm{d}t$ qui se calcule en intégrant par partie (prudemment) : on trouve $\frac{1}{(2k+n+1)^2}\underset{k\to+\infty}{\sim}\frac{1}{4k^2}$ terme général positif de série convergente (par rapport à k).
Le théorème d'inversion s'applique, tout converge et on peut écrire

$$I_n=\sum_{k=0}^{+\infty}\int_0^1 g_k(t)\mathrm{d}t=\sum_{k=0}^{+\infty}\frac{1}{(2k+n+1)^2}$$

On effectue alors une comparaison série intégrale, à n fixé, avec $t\mapsto\frac{n}{(2t+n+1)^2}$ décroissante sur $\mathbb{R}^+$. On obtient

$$J_n\leqslant I_n\leqslant J_n+\frac{1}{(n+1)^2}$$

où $J_n=\int_0^{+\infty}\frac{1}{(2t+n+1)^2}\,\mathrm{d}t=\left[\frac{-1/2}{2t+n+1}\right]_0^{+\infty}=\frac{1}{2(n+1)}$ d'où $I_n\sim\frac{1}{2n}$ ce qui redonne bien la limite nulle.

25

1. Pour $a>0$ et $b>0$, montrer que $\displaystyle\int_0^1 \frac{t^{a-1}}{1+t^b}\,\mathrm{d}t = \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{(-1)^n}{a+nb}$.
2. Calculer $\displaystyle\sum_{n=0}^{+\infty} \frac{(-1)^n}{3n+1}$.

Solution de 25 :

1. On fait apparaître une série géométrique, on trouve $f_n : t \mapsto (-1)^n t^{a+nb-1}$.
   Le théorème de convergence N_1 ne s'applique pas ici car $N_1(f_n) = \dfrac{1}{a+nb}$.
   Il faut donc y aller « à la main ». Comme on sait calculer les sommes partielles d'une série géométrique, on peut appliquer le TCVD à la suite des sommes partielles $S_n(t) = \displaystyle\sum_{k=0}^{n} f_k(t) \xrightarrow[n\to+\infty]{} \frac{t^{a-1}}{1+t^b}$ sur $]0,1[$.
   Les hypothèse se vérifient facilement et on peut dominer avec $|S_n(t)| \leqslant \dfrac{2t^{a-1}}{1+t^b}$.
   Le passage à la limite sous l'intégrale permet de conclure.
2. On décompose en éléments simples en factorisant $t^3+1 = (t+1)(t^2-t+1)$ et on intègre patiemment.
   On trouve $\dfrac{\ln 2}{3} + \dfrac{\pi}{2\sqrt{3}}$.