Moyenne arithmético-géométrique, intégrales elliptiques et calcul de π

0.	Introduction	1
1.	Moyenne arithmético-géométrique	. 1
	Intégrales elliptiques	
	Transformation de Landen	
4.	Évaluation des intégrales elliptiques	. 5
	Relation de Legendre	
	Formule de Brent-Salamin pour π	
	Code pour PARI/GP.	

0. Introduction

L'objectif de ce texte est d'expliquer le lien entre la moyenne arithmético-géométrique et les intégrales elliptiques, découvert par C.F. Gauss en 1799 alors qu'il avait $22~{\rm ans}^{(1)}$. On démontrera ensuite la relation de Legendre (1811), qui fournit une méthode de calcul de π extrêmement efficace. Elle aurait donc déjà pu être découverte au début du $19^{\rm e}$ siècle, mais il fallut en réalité attendre les travaux de Brent et Salamin en 1976 pour que cette méthode soit explicitement suggérée comme moyen de calcul de π .

1. Moyenne arithmético-géométrique

Étant donnés deux réels a, b > 0, on considère les suites $(a_n), (b_n)$ définies par la relation de récurrence $(a_0, b_0) = (a, b)$ et

$$\begin{cases} a_{n+1} = \frac{a_n + b_n}{2} \\ b_{n+1} = \sqrt{a_n b_n}. \end{cases}$$

Comme les termes d'indices $n \ge 1$ restent inchangés si on permute a et b, il n'est pas restrictif de supposer $a \ge b > 0$. Dans ce cas, nous affirmons que (a_n) est une suite

⁽¹⁾ voir aussi : A. Chambert-Loir, S. Fermigier et V. Maillot, Exercices d'analyse pour l'agrégation, Analyse 1 (Topologie, suites et séries, intégration), Paris : Masson, 230 p. (1995).

décroissante, que (b_n) est une suite croissante, et que les deux suites sont adjacentes. En effet

(1.1)
$$a_{n+1}^2 - b_{n+1}^2 = \left(\frac{a_n + b_n}{2}\right)^2 - a_n b_n = \left(\frac{a_n - b_n}{2}\right)^2 \geqslant 0,$$

on a donc $a_n \ge b_n$ pour tout $n \ge 1$. Ceci implique $a_{n+1} \le a_n$ et $b_{n+1} \ge b_n$ pour tout $n \ge 0$, par conséquent

$$(1.2) b = b_0 \leqslant \ldots \leqslant b_n \leqslant b_{n+1} \leqslant a_{n+1} \leqslant a_n \leqslant \ldots \leqslant a_0 = a.$$

Comme les suites sont monotones et bornées, leurs limites respectives $\alpha = \lim a_n$ et $\beta = \lim b_n$ existent, et la relation $a_{n+1} = \frac{1}{2}(a_n + b_n)$ entraı̂ne $\alpha = \frac{1}{2}(\alpha + \beta)$ d'où $\alpha = \beta$. Ceci implique bien que les suites sont adjacentes. On note

$$(1.3) M(a,b) = \lim a_n = \lim b_n$$

leur limite commune, appelée moyenne arithmético-géométrique de a et b, et on pose de plus

$$(1.4) c_n = \sqrt{a_n^2 - b_n^2}.$$

Il vient d'après (1.1) $c_{n+1} = \frac{1}{2}(a_n - b_n)$, donc c_n décroît vers 0 et

$$c_n^2 = (a_n - b_n)(a_n + b_n) = 4c_{n+1}a_{n+1} \implies c_{n+1} \leqslant \frac{c_n^2}{4M(a,b)}.$$

En posant M=M(a,b), ceci se récrit $c_{n+1}/4M \leqslant (c_n/4M)^2$, donc on voit par récurrence que $c_n/4M \leqslant (c_{n_0}/4M)^{2^{n-n_0}}$. Il s'agit d'une convergence de type quadratique : si n_0 est pris tel que $c_{n_0}/4M \leqslant 10^{-1}$, on va avoir

$$(1.5) a_n - b_n = 2c_{n+1} \leqslant 8M \, 10^{-2^{n+1-n_0}},$$

soit déjà environ $2^{10} > 1000$ décimales exactes pour $n = n_0 + 9$.

2. Intégrales elliptiques

Pour a, b > 0 on introduit les intégrales

$$(2.1) \quad I(a,b) = \int_0^{\pi/2} \frac{dt}{\sqrt{a^2 \cos^2 t + b^2 \sin^2 t}}, \quad J(a,b) = \int_0^{\pi/2} \sqrt{a^2 \cos^2 t + b^2 \sin^2 t} \, dt.$$

Il est facile de voir que le périmètre de l'ellipse de demi-axes a, b est égal à 4J(a, b), et pour cette raison, ces intégrales ont été appelées intégrales elliptiques. Il est évident que I(b, a) = I(a, b) et J(b, a) = J(a, b) en faisant le changement de variable $t \mapsto \frac{\pi}{2} - t$.

3. Transformation de Landen

À l'aide d'un changement de variable astucieux, appelé transformation de Landen, on va montrer que I(a,b) et J(a,b) satisfont les relations

$$(3.1) I(a_1, b_1) = I(a, b),$$

$$(3.2) 2 J(a_1, b_1) = J(a, b) + ab I(a, b),$$

où $a_1 = \frac{a+b}{2}$ et $b_1 = \sqrt{ab}$ comme au § 1. Le changement de variable consiste à poser

$$u = t + \operatorname{Arctan}\left(\frac{b}{a}\tan t\right).$$

Il réalise une bijection croissante de $[0, \pi/2[$ sur $[0, \pi[$, et peut se prolonger différentiablement à $[0, \pi/2]$ comme on va le voir. On a en effet

$$\frac{du}{dt} = 1 + \frac{\frac{b}{a}(1 + \tan^2 t)}{1 + (\frac{b}{a})^2 \tan^2 t} = 1 + \frac{ab(\cos^2 t + \sin^2 t)}{a^2 \cos^2 t + b^2 \sin^2 t} = \frac{(a+b)(a\cos^2 t + b\sin^2 t)}{a^2 \cos^2 t + b^2 \sin^2 t}.$$

D'autre part, si $\varphi \in [0, \pi/2[$, on a

$$\cos \varphi = \frac{1}{\sqrt{1 + \tan^2 \varphi}}$$
 et $\sin \varphi = \frac{\tan \varphi}{\sqrt{1 + \tan^2 \varphi}}$.

En posant $\varphi = \operatorname{Arctan}\left(\frac{b}{a}\tan t\right)$ et $u = t + \varphi$, ceci implique $\tan \varphi = \frac{b}{a}\tan t$ et

 $\cos u = \cos t \, \cos \varphi - \sin t \, \sin \varphi$

$$= \cos t \frac{1}{\sqrt{1 + (\frac{b}{a})^2 \tan^2 t}} - \sin t \frac{\frac{b}{a} \tan t}{\sqrt{1 + (\frac{b}{a})^2 \tan^2 t}} = \frac{a \cos^2 t - b \sin^2 t}{\sqrt{a^2 \cos^2 t + b^2 \sin^2 t}},$$

 $\sin u = \sin t \, \cos \varphi + \cos t \, \sin \varphi$

$$= \sin t \frac{1}{\sqrt{1 + (\frac{b}{a})^2 \tan^2 t}} + \cos t \frac{\frac{b}{a} \tan t}{\sqrt{1 + (\frac{b}{a})^2 \tan^2 t}} = \frac{(a+b) \sin t \cos t}{\sqrt{a^2 \cos^2 t + b^2 \sin^2 t}}.$$

On en déduit alors

$$\begin{aligned} a_1^2 \cos^2 u + b_1^2 \sin^2 u &= \left(\frac{a+b}{2}\right)^2 \left(\cos^2 u + \frac{4ab}{(a+b)^2} \sin^2 u\right) \\ &= \left(\frac{a+b}{2}\right)^2 \frac{(a\cos^2 t - b\sin^2 t)^2 + 4ab\sin^2 t\cos^2 t}{a^2\cos^2 t + b^2\sin^2 t} \\ &= \left(\frac{a+b}{2}\right)^2 \frac{(a\cos^2 t + b\sin^2 t)^2}{a^2\cos^2 t + b^2\sin^2 t}, \end{aligned}$$

soit, en posant $\Delta(t) = \sqrt{a^2 \cos^2 t + b^2 \sin^2 t}$

$$\Delta_1(u) = \sqrt{a_1^2 \cos^2 u + b_1^2 \sin^2 u} = \frac{a+b}{2} \frac{a \cos^2 t + b \sin^2 t}{\sqrt{a^2 \cos^2 t + b^2 \sin^2 t}}.$$

En combinant ceci avec le calcul de du/dt qui donne

$$du = \frac{(a+b)(a\cos^2 t + b\sin^2 t)}{a^2\cos^2 t + b^2\sin^2 t} dt,$$

il vient

(3.3)
$$\frac{1}{2} \frac{du}{\Delta_1(u)} = \frac{1}{2} \frac{du}{\sqrt{a_1^2 \cos^2 u + b_1^2 \sin^2 u}} = \frac{dt}{\sqrt{a^2 \cos^2 t + b^2 \sin^2 t}} = \frac{dt}{\Delta(t)}.$$

Après intégration, nous obtenons

$$\frac{1}{2} \int_0^{\pi} \frac{du}{\sqrt{a_1^2 \cos^2 u + b_1^2 \sin^2 u}} = \int_0^{\pi/2} \frac{dt}{\sqrt{a^2 \cos^2 t + b^2 \sin^2 t}},$$

d'où la relation (3.1) par symétrie des intégrales sur $[0, \pi/2]$ et $[\pi/2, \pi]$. Pour obtenir (3.2), nous observons que

$$\Delta_{1}(u) + \frac{a-b}{2}\cos u = \frac{1}{2} \frac{(a+b)(a\cos^{2}t + b\sin^{2}t) + (a-b)(a\cos^{2}t - b\sin^{2}t)}{\sqrt{a^{2}\cos^{2}t + b^{2}\sin^{2}t}}$$

$$(3.4) \qquad = \frac{a^{2}\cos^{2}t + b^{2}\sin^{2}t}{\sqrt{a^{2}\cos^{2} + b^{2}\sin^{2}t}} = \Delta(t),$$

$$\Delta_{1}(u) - \frac{a-b}{2}\cos u = \frac{1}{2} \frac{(a+b)(a\cos^{2}t + b\sin^{2}t) - (a-b)(a\cos^{2}t - b\sin^{2}t)}{\sqrt{a^{2}\cos^{2}t + b^{2}\sin^{2}t}}$$

$$= \frac{ab\cos^{2}t + ab\sin^{2}t}{\sqrt{a^{2}\cos^{2} + b^{2}\sin^{2}t}} = \frac{ab}{\Delta(t)}.$$

En faisant la somme, nous trouvons

(3.6)
$$2\Delta_1(u) = \Delta(t) + \frac{ab}{\Delta(t)}.$$

La relation (3.3) donne par ailleurs $du = 2\frac{\Delta_1(u)}{\Delta(t)}dt$, donc en multipliant (3.4) par du il s'ensuit

(3.7)
$$\Delta_1(u) du + \frac{a-b}{2} \cos u du = \Delta(t) du = 2\Delta_1(u) dt = \left(\Delta(t) + \frac{ab}{\Delta(t)}\right) dt.$$

Comme $\int_0^{\pi} \cos u \, du = 0$, nous obtenons après intégration pour $t \in [0, \pi/2]$ et $u \in [0, \pi]$:

$$2 J(a_1, b_1) = J(a, b) + ab I(a, b),$$

ce qu'il fallait démontrer.

4. Évaluation des intégrales elliptiques

On utilise la moyenne arithmético-géométrique $M = M(a, b) = \lim a_n = \lim b_n$. La relation (3.1) donne par récurrence $I(a, b) = I(a_n, b_n)$, et il est facile de voir qu'il y a convergence uniforme vers l'intégrale $I(M, M) = \frac{\pi/2}{M}$. On obtient donc déjà la formule célèbre due à C.F. Gauss

(4.1)
$$I(a,b) = \frac{\pi/2}{M(a,b)}.$$

La formule (3.2) implique par ailleurs

$$2(J(a_1, b_1) - a_1^2 I(a_1, b_1)) = J(a, b) + ab I(a, b) - 2\left(\frac{a+b}{2}\right)^2 I(a, b)$$
$$= J(a, b) - \frac{a^2 + b^2}{2} I(a, b)$$
$$= J(a, b) - a^2 I(a, b) + \frac{1}{2}c^2 I(a, b)$$

et en remplaçant (a, b) par (a_{n-1}, b_{n-1}) on en déduit de même

$$2(J(a_n,b_n) - a_n^2 I(a_n,b_n)) = J(a_{n-1},b_{n-1}) - a_{n-1}^2 I(a_{n-1},b_{n-1}) + \frac{1}{2}c_{n-1}^2 I(a,b).$$

En multipliant par 2^{n-1} , il vient aisément par récurrence

$$(4.2) 2^{n} (J(a_{n}, b_{n}) - a_{n}^{2} I(a_{n}, b_{n})) = J(a, b) - a^{2} I(a, b) + \frac{1}{2} \sum_{j=0}^{n-1} 2^{j} c_{j}^{2} I(a, b).$$

Nous affirmons que le membre de gauche tend vers 0 du fait de la convergence rapide. En effet on a les inégalités

$$\frac{\pi}{2}b \leqslant J(a,b) \leqslant \frac{\pi}{2}a, \qquad \frac{\pi}{2a} \leqslant I(a,b) \leqslant \frac{\pi}{2b},$$

donc

$$\frac{\pi}{2}\Big(b-\frac{a^2}{b}\Big)\leqslant J(a,b)-a^2I(a,b)\leqslant 0 \quad \Rightarrow \quad \left|J(a,b)-a^2I(a,b)\right|\leqslant \frac{\pi}{2b}(a^2-b^2)=\frac{\pi}{2b}c^2,$$
 et par conséquent

$$2^{n} |J(a_n, b_n) - a_n^2 I(a_n, b_n)| \le 2^{n} \frac{\pi}{2b_n} c_n^2 \le 2^{n} \frac{\pi}{2b} c_n^2,$$

ce qui tend vers zéro du fait de la convergence super-exponentielle de c_n . À la limite, la relation (4.2) implique la formule

(4.3)
$$J(a,b) = I(a,b) \left(a^2 - \sum_{n=0}^{+\infty} 2^{n-1} c_n^2 \right) = \frac{\pi}{2} \frac{a^2 - \sum_{n=0}^{+\infty} 2^{n-1} c_n^2}{M(a,b)}$$

qui permet d'évaluer efficacement J(a,b) (et donc le périmètre de l'ellipse = 4J(a,b)).

5. Relation de Legendre

Soit a,b,c des réels >0 tels que $a^2=b^2+c^2$ et $a_n,\,b_n,\,c_n$ comme au paragraphe 1. Nous avons

$$(5.1) I(a_1, b_1) = I(a, b)$$

et comme $a_1 = \frac{a+b}{2}$, $c_1 = \frac{a-b}{2}$, il vient

(5.2)
$$I(a_1, c_1) = I\left(\frac{a_1 + c_1}{2}, \sqrt{a_1 c_1}\right) = I(a/2, c/2) = 2I(a, c).$$

Par ailleurs

(5.3)
$$J(a_1, b_1) = \frac{1}{2} (J(a, b) + ab I(a, b)),$$

et donc

$$J(a,c) = 2J(a/2,c/2) = 2J\left(\frac{a_1+c_1}{2},\sqrt{a_1c_1}\right) = J(a_1,c_1) + a_1c_1I(a_1,c_1),$$

ce qui implique

(5.4)
$$J(a_1, c_1) = J(a, c) - \frac{c^2}{2}I(a, c).$$

La relation de Legendre consiste à évaluer l'expression

$$E(a,b) = I(a,b)J(a,c) + I(a,c)J(a,b) - a^{2}I(a,b)I(a,c).$$

Pour cela, on va chercher la transformée de E(a,b) par l'opération de moyenne arithmético-géométrique. D'après (5.1-5.4), on trouve

$$E(a_1, b_1) = I(a_1, b_1)J(a_1, c_1) + I(a_1, c_1)J(a_1, b_1) - a_1^2 I(a_1, b_1)I(a_1, c_1)$$

$$= I(a, b) \left(J(a, c) - \frac{c^2}{2}I(a, c)\right) + 2I(a, c)\frac{1}{2} \left(J(a, b) + abI(a, b)\right)$$

$$-2\left(\frac{a+b}{2}\right)^2 I(a, b)I(a, c)$$

$$= E(a, b).$$

On a par conséquent $E(a,b) = E(a_n,b_n)$ et il est naturel de chercher à évaluer la limite quand $n \to +\infty$. Nous avons d'une part

$$\lim I(a_n, b_n) = I(M, M) = \frac{\pi/2}{M}, \quad \lim J(a_n, c_n) = J(M, 0) = \int_0^{\pi/2} M \cos t \, dt = M.$$

D'autre part, comme $a \ge c$, on a aussi $I(a,c) \le \frac{\pi}{2c}$, et la majoration de $J(a,b) - a^2 I(a,b)$ par $(\pi/2b)c^2$ obtenue dans la section 4 entraı̂ne alors

$$|I(a,c)J(a,b) - a^2I(a,b)I(a,c)| = I(a,c)|J(a,b) - a^2I(a,b)| \le \frac{\pi^2}{4b}c.$$

On en déduit que $\lim_{n\to+\infty} I(a_n,c_n)J(a_n,b_n)-a_n^2I(a_n,b_n)I(a_n,c_n)=0$ et donc

$$E(a,b) = \lim E(a_n, b_n) = I(M, M)J(M, 0) = \frac{\pi}{2}.$$

Ceci donne la relation de Legendre reliant les intégrales elliptiques :

(5.5)
$$I(a,b)J(a,c) + I(a,c)J(a,b) - a^2I(a,b)I(a,c) = \frac{\pi}{2}.$$

6. Formule de Brent-Salamin pour π

On applique la formule de Legendre avec a = 1 et 0 < b < 1, $b' = c = \sqrt{1 - b^2}$. Si nous désignons par c'_n la suite associée au calcul de la moyenne arithmético-géométrique M(a, b'), on obtient grâce à (4.3)

$$\frac{\pi}{2} = I(1,b)J(1,b') + I(1,b')J(1,b) - I(1,b)I(1,b')$$
$$= I(1,b)I(1,b') \left(1 - \sum_{n=0}^{+\infty} 2^{n-1}c_n^2 - \sum_{n=0}^{+\infty} 2^{n-1}c_n'^2\right)$$

Comme $c_0 = c = b'$ et $c'_0 = \sqrt{1 - b'^2} = b$, on a $c_0^2 + c'_0^2 = 1$, donc $1 - 2^{-1}(c_0^2 + c'_0^2) = \frac{1}{2}$. En multipliant l'égalité précédente par 2 il vient

$$\pi = I(1,b)I(1,b')\left(1 - \sum_{n=1}^{+\infty} 2^n(c_n^2 + c_n'^2)\right) = \frac{\pi^2}{4M(1,b)M(1,b')}\left(1 - \sum_{n=1}^{+\infty} 2^n(c_n^2 + c_n'^2)\right)$$

Ceci fournit la formule proposée par Richard $\mathrm{Brent}^{(2)}$ et Eugene $\mathrm{Salamin}^{(3)}$

(6.1)
$$\pi = \frac{4M(1,b)M(1,b')}{1 - \sum_{n=1}^{+\infty} 2^n (c_n^2 + c_n'^2)}, \quad \forall b, b' > 0, \quad b^2 + b'^2 = 1.$$

⁽²⁾ R.P. Brent, Multiple-precision zero-finding methods and the complexity of elementary function evaluation, Traub, J.F., ed., Analytic Computational Complexity (1975), 151–176.

⁽³⁾ E. Salamin, Computation of π using arithmetic-geometric mean, Mathematics of computation, vol. 30, 135 (1976), 565–570.

Le choix le plus simple consiste à prendre $b = b' = 2^{-1/2}$, pour lequel on a

(6.2)
$$\pi = \frac{4M(1,2^{-1/2})^2}{1-\sum_{n=1}^{+\infty} 2^{n+1}c_n^2}.$$

On effectuera par exemple le calcul de a_n , b_n jusqu'à l'indice n, puis $a_{n+1} = \frac{1}{2}(a_n + b_n)$, et on prendra l'approximation

(6.3)
$$\pi_n = \frac{4 a_{n+1}^2}{1 - \sum_{j=1}^n 2^{j+1} c_j^2}.$$

Analysons rapidement l'erreur. Comme on a $b_{n+1} \leqslant M \leqslant a_{n+1}$, l'erreur au numérateur est majorée par $4(a_{n+1}^2 - b_{n+1}^2) = 4c_{n+1}^2$, tandis qu'au dénominateur elle est d'un ordre plus grand, soit $2^{n+2}c_{n+1}^2 + O(2^{n+3}c_{n+2}^2)$. Si δ désigne le dénominateur de (6.2), on a $\pi = 4M^2/\delta$ et $c_{n+1} \leqslant c_n^2/4M$ avec $b_1 = 2^{-1/4} \leqslant M \leqslant a_0 = 1$. Ceci donne pour l'erreur l'équivalent

$$|\pi_n - \pi| \sim \frac{4M^2}{\delta} \left(\frac{1 + c_{n+1}^2 / M^2}{1 - 2^{n+2} c_{n+1}^2 / \delta} - 1 \right) \sim \frac{4M^2}{\delta^2} 2^{n+2} c_{n+1}^2 = \frac{\pi^2}{4M^2} 2^{n+2} c_{n+1}^2$$
$$\sim \frac{\pi^2}{16M^4} 2^n c_n^4 \leqslant 1, 2 \ 2^n c_n^4.$$

Le calcul à l'aide d'un logiciel comme PARI/GP fournit

$$c_1/4M \leqslant c_1/4b_1 = 0,04289 < 10^{-1},$$

donc $c_n \leq 4M \, 10^{-2^{n-1}}$ d'après (1.5); par conséquent, on obtiendra déjà largement plus de deux milliards de décimales exactes pour n=30. Comme on dispose d'algorithmes très efficaces pour calculer les sommes, produits, quotients et racines de grands nombres (algorithme de Schönhage-Strassen⁽⁴⁾ reposant sur l'utilisation de la transformée de Fourier rapide ou FFT⁽⁵⁾), on sait également calculer π de manière ultra-rapide – le temps de calcul de N décimales croît presque linéairement en N, de l'ordre de $N(\log N)^2$, soit à peine plus que le temps N nécessaire pour seulement écrire le résultat . . .

L'algorithme de la moyenne arithmético-géométrique a d'autres avatars intéressants, par exemple la formule suivante due elle aussi à C.F. Gauss

$$e^{\pi} = 32 \prod_{n=1}^{+\infty} \left(\frac{a_{n+1}}{a_n}\right)^{2^{-n+1}}.$$

⁽⁴⁾ A. Schönhage and V. Strassen, Schnelle Multiplikation großer Zahlen, Computing 7 (1971), 281–292.

⁽⁵⁾ J.W. Cooley and J.W. Tukey, An algorithm for the machine calculation of complex Fourier series, Math. Comput. 19 (1965), 297–301.

7. Code pour PARI/GP

L'implémentation du code avec un logiciel comme PARI/GP est extrêmement simple. Voici un exemple de tel code "salamin.gp" pour un calcul avec environ 1000 décimales exactes, à exécuter par "gp salamin.gp" (moins de dix itérations suffisent).

```
default(colors, "9, 5, no, no, 4");
                                      /* initialisation des variables */
v=1000;
default(realprecision, v+20);
n=0;
a=1;b=1/sqrt(2);
a1=(a+b)/2;
                                           /* prochaine itération de a */
                                                       /* f stocke 2^{n+1} */
d=1;f=2;
decimales=1;
iterer()=
                              /* a,b,a1 valent a_n, b_n, a_{n+1} = (a_n + b_n)/2 */
local(s,c,c2,p,u);
                                                   /* c_{n+1} = (a_n - b_n)/2 */
c=a1-b;
n=n+1;
                                                /* b stocke b_n nouveau */
b=sqrt(a*b);
                                                /* a stocke a_n nouveau */
a=a1;
                                                        /* s vaut 2a_{n+1} */
s=a+b;
                                                        /* f vaut 2^{n+1} */
f=2*f;
c2=c*c;
                                                u=f*c2;
d=d-u;
                                                         /* s*s = 4a_{n+1}^2 */
p=s*s/d;
a1=s/2;
                                                    /* majorant 1.22^{n}c_{n}^{4} */
erreur=0.6*u*c2;
decimales=floor(-log(erreur)/log(10));
if(decimales>v+10,decimales=v);
print("n = ", n, ", decimales attendues = ", decimales);
print("pi = ", p);
print();
}
while(decimales<v,iterer());</pre>
```