

Numerical Analysis

Exam Appendix

Astral Projection

2026 年 1 月 14 日

目录

1	数学基础知识	5
1.1	补充内容	5
1.1.1	矩阵的可分性	5
1.2	重要证明	5
1.2.1	Legender 多项式的零平方误差最小性质	5
1.2.2	Chebyshev 多项式的零一致误差最小性质	6
1.3	例题与习题	7
2	函数插值与重构	9
2.1	重要证明	9
2.1.1	插值多项式的误差函数	9
2.1.2	分片线性插值和分片三次 Hermite 插值的收敛性定理	9
2.1.3	三角插值多项式形式、相多项式形式	10
2.1.4	三角插值的误差分析	10
2.2	函数逼近	10
2.3	补充内容	10
2.3.1	Schauder 基	10
2.4	重要证明	10
2.4.1	最佳平方逼近存在唯一性定理	10
2.4.2	广义傅里叶展开收敛性的证明	10
2.4.3	最佳一致逼近存在性定理	11
2.4.4	Chebyshev 交错点组定理	11
2.4.5	最佳一致逼近唯一性定理	11
2.5	重要例题与习题	11
3	数值微积分	13
3.1	补充内容	13
3.2	重要证明	13
3.2.1	闭型 Newton-Cotes 公式的导出与误差分析	13

3.2.2	开型 Newton-Cotes 公式的导出与误差分析	13
3.3	重要习题与例题	13
4	常微分方程数值解	15
4.1	补充内容	15
4.1.1	一致 Lipschitz 常数的求解	15
4.2	重要证明	15
4.2.1	y 的各阶导数	15
4.2.2	一步误差与局部截断误差的关系	16
4.3	重要习题与例题	16
4.3.1	求相容阶和主局部截断误差：泰勒级数展开法	16
4.3.2	显式 RK 的推导	16
4.3.3	课本习题	19
5	圣遗物，考前必看	33
6	圣遗物答案	37

Chapter 1

数学基础知识

1.1 补充内容

1.1.1 矩阵的可分性

1.2 重要证明

1.2.1 Legendre 多项式的零平方误差最小性质

定理 1.2.1. 在所有首项为 1 的 n 次多项式中, Legendre 多项式 $\tilde{P}_n(x)$ 在 $[-1, 1]$ 上与零的平方误差最小。

证明:

考虑一个首项为 1 的 n 次多项式 $f \in \mathbb{P}_n$, 必有

$$f = \tilde{P}_n(x) + \sum_{k=0}^{n-1} a_k \tilde{P}_k(x) \quad (1.1)$$

考虑误差函数

$$\phi(\mathbf{a}) = \|f(x) - 0\|_2^2 \quad (1.2)$$

$$= \int_{-1}^1 \tilde{P}_n^2(x) dx + 2 \sum_{k=0}^{n-1} a_k \int_{-1}^1 \tilde{P}_n(x) \tilde{P}_k(x) dx + \sum_{k=0}^{n-1} a_k^2 \int_{-1}^1 \tilde{P}_k^2(x) dx \quad (1.3)$$

由 Legendre 多项式的正交性,

$$\int_{-1}^1 \tilde{P}_i(x) \tilde{P}_j(x) dx = \frac{2}{2i+1} \delta_{ij} \quad (1.4)$$

于是

$$\phi(\mathbf{a}) = \int_{-1}^1 \tilde{P}_n^2(x) dx + \sum_{k=0}^{n-1} a_k^2 \int_{-1}^1 \tilde{P}_k^2(x) dx \quad (1.5)$$

$$(1.6)$$

当且仅当 $a_k = 0$ 时, $\phi(\mathbf{a})$ 取得最小值, 即 Legendre 多项式在所有首项为 1 的 n 次多项式中与零的平方误差最小。

1.2.2 Chebyshev 多项式的零一致误差最小性质

定理 1.2.2. 在所有首项为 1 的 n 次多项式中, Chebyshev 多项式 $T_n(x)$ 在 $[-1, 1]$ 上与零的一致误差最小。

证明:

方法 1: 将一致误差转化, 并考虑在 \mathbb{P}_{n-1} 上的最佳一致逼近多项式

$$f = \tilde{T}_n(x) + \sum_{k=0}^{n-1} a_k \tilde{T}_k(x) \quad (1.7)$$

考虑误差函数

$$\Delta(f, 0) = \|f(x) - 0\|_{\infty} \quad (1.8)$$

$$= \|\tilde{T}_n(x) + \sum_{k=0}^{n-1} a_k \tilde{T}_k(x)\|_{\infty} \quad (1.9)$$

$$= \|\tilde{T}_n(x) - \left(-\sum_{k=0}^{n-1} a_k \tilde{T}_k(x)\right)\|_{\infty} \quad (1.10)$$

$$= \Delta(\tilde{T}_n, -\sum_{k=0}^{n-1} a_k \tilde{T}_k(x)) \quad (1.11)$$

该误差函数取得最小值时, 即为

$$\min_{\mathbf{a}} \Delta(\tilde{T}_n, -\sum_{k=0}^{n-1} a_k \tilde{T}_k(x)) = \text{dist}(\tilde{T}_n, \text{span}\{\tilde{T}_0, \tilde{T}_1, \dots, \tilde{T}_{n-1}\}) \quad (1.12)$$

$$= \text{dist}(\tilde{T}_n, \mathbb{P}_{n-1}) \quad (1.13)$$

则只要证 $\text{dist}(\tilde{T}_n, \mathbb{P}_{n-1}) = \text{dist}(\tilde{T}_n, 0)$ 即可。

考虑到 \tilde{T}_n 在 $[-1, 1]$ 上恰有 $n+1$ 个极值点, 且这些极值点构成了一个 $n+1$ 个点的交错点组, 故 0 就是 \tilde{T}_n 在 \mathbb{P}_{n-1} 中的最佳一致逼近多项式, 因此

$$\text{dist}(\tilde{T}_n, \mathbb{P}_{n-1}) = \text{dist}(\tilde{T}_n, 0) \quad (1.14)$$

因此, 当 $\mathbf{a} = \mathbf{0}$ 时, 误差函数可以取得最小值, 即 Chebyshev 多项式在所有首项为 1 的 n 次多项式中与零的一致误差最小。

方法 2: 利用交错点组证明差多项式为 0 假设存在另一个首项为 1 的 n 次多项式 $f_n(x)$, 使得 $\|f_n(x) - 0\|_\infty < \|T_n(x) - 0\|_\infty$ 。

考虑

$$Q(x) = f_n(x) - \tilde{T}_n(x) \in \mathbb{P}_{n-1} \quad (1.15)$$

在 \tilde{T}_n 的 $n+1$ 个极值点 x_k 处, 设 \tilde{T}_n 取得极值 $\pm M$, 则由于 $\|f_n(x) - 0\|_\infty < \|T_n(x) - 0\|_\infty$, 必有

$$|f_n(x_k)| < M \quad (1.16)$$

因此

$$Q(x_k) = \begin{cases} M - p(x_k) > 0, & k \text{ 为偶数} \\ -M - p(x_k) < 0, & k \text{ 为奇数} \end{cases} \quad (1.17)$$

于是 Q 在区间内 $n+1$ 个点上符号交替, 故 Q 至少有 n 个零点。由于 $Q \in \mathbb{P}_{n-1}$, Q 只能为 0。于是 $f_n(x) = \tilde{T}_n(x)$, 与假设矛盾。

1.3 例题与习题

Chapter 2

函数插值与重构

2.1 重要证明

2.1.1 插值多项式的误差函数

定理 2.1.1 (插值多项式误差公式). 设 $f \in C^{n+1}[a, b]$, x_0, x_1, \dots, x_n 为区间 $[a, b]$ 上的 $n+1$ 个两两不同的节点, 则对任意 $x \in [a, b]$, 存在 $\xi \in (a, b)$, 使得

$$f(x) - p(x) = \frac{f^{(n+1)}(\xi)}{(n+1)!} \prod_{i=0}^n (x - x_i) \quad (2.1)$$

其中 $p(x)$ 为通过节点 $(x_i, f(x_i))$ 的插值多项式。

证明:

2.1.2 分片线性插值和分片三次 Hermite 插值的收敛性定理

命题: 定义

$$h = \max_{1 \leq i \leq n} (x_i - x_{i-1}) \quad (2.2)$$

则进行分片线性插值时,

- 若 $f \in C[a, b]$, 则 $\lim_{h \rightarrow 0} \|f - \phi\|_{\infty} \rightarrow 0$
- 若 $f \in C^1[a, b]$, 则 $\|f - \phi\|_{\infty} \leq \frac{h}{2} \|f'\|_{\infty}$
- 若 $f \in C^2[a, b]$, 则 $\|f - \phi\|_{\infty} \leq \frac{h^2}{8} \|f''\|_{\infty}$

进行分片三次 Hermite 插值时,

- 若 $f \in C^1[a, b]$, 则 $\|f - \phi\|_{\infty} \leq ch \|f'\|_{\infty}$
- 若 $f \in C^2[a, b]$, 则 $\|f - \phi\|_{\infty} \leq ch^2 \|f''\|_{\infty}$

- 若 $f \in C^3[a, b]$, 则 $\|f - \phi\|_\infty \leq ch^3 \|f'''\|_\infty$
- 若 $f \in C^4[a, b]$, 则 $\|f - \phi\|_\infty \leq \frac{1}{384} h^4 \|f^{(4)}\|_\infty$

证明:

Note: 分片线性插值只要做泰勒展开即可; 分片三次 Hermite 插值在 4 阶光滑性时可以通过余项公式给出, 低于 4 阶光滑性需要用到 Peano 核定理。

2.1.3 三角插值多项式形式、相多项式形式

2.1.4 三角插值的误差分析

2.2 函数逼近

2.3 补充内容

2.3.1 Schauder 基

2.4 重要证明

2.4.1 最佳平方逼近存在唯一性定理

定理 2.4.1. 设 $f \in C[a, b]$, Φ 为 $C[a, b]$ 的有限维子空间, 则存在唯一的 $\phi^* \in \Phi$, 使得

$$\|f - \phi^*\| = \min_{\phi \in \Phi} \|f - \phi\| \quad (2.3)$$

证明:

2.4.2 广义傅里叶展开收敛性的证明

1、广义傅里叶级数收敛到 $(C[a, b], \|\cdot\|_2)$ 的完备化空间 $(C[a, b], \|\cdot\|_2)$ 中的一个元素。若 $\|\cdot\|_2$ 为权系数 ρ 的内积诱导范数, 则 $(C[a, b], \|\cdot\|_2)$ 即为 $L^2_\rho(a, b)$ 。

2、设 $f \in C[a, b]$, $\{\phi_m\}_{m=0}^\infty$ 为 $C[a, b]$ 中的规范正交函数组, 则 f 在 $\{\phi_m\}$ 下的广义傅里叶展开

$$f \sim \sum_{m=0}^{\infty} a_m \phi_m(x), \quad a_m = (f, \phi_m) \quad (2.4)$$

在 $C[a, b]$ 中一致收敛于 f , 即

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \left\| f - \sum_{m=0}^n a_m \phi_m(x) \right\|_\infty = 0 \quad (2.5)$$

证明:

提示: 1 的证明用到 $\sum_{i=0}^\infty |a_i|^2 < \infty$, 2 的证明用到 Weierstrass 逼近定理。

2.4.3 最佳一致逼近存在性定理

定理 2.4.2 (最佳一致逼近存在性定理). 设 $f \in C[a, b]$, 则在 n 次多项式空间 P_n 中, 存在一个多项式 $p_n^* \in P_n$, 使得

$$\|f - p_n^*\|_\infty = \min_{p_n \in P_n} \|f - p_n\|_\infty \quad (2.6)$$

即 P_n 中关于 $f \in C[a, b]$ 的最小偏差是可以达到的。

证明:

提示: 利用偏差泛函的性质

2.4.4 Chebyshev 交错点组定理

定理 2.4.3 (Chebyshev 交错点组定理). 设 $f \in C[a, b]$, $p_n^* \in P_n$ 为 f 在 P_n 中的最佳一致逼近多项式, 则存在 $a \leq x_0 < x_1 < \dots < x_{n+1} \leq b$, 使得

$$f(x_i) - p_n^*(x_i) = (-1)^i \|f - p_n^*\|_\infty, \quad i = 0, 1, \dots, n+1 \quad (2.7)$$

即误差函数在 $n+2$ 个点上达到最大偏差且符号交替。

证明:

提示: 分别证明必要性和充分性, 且均用到反证法。

2.4.5 最佳一致逼近唯一性定理

定理 2.4.4 (最佳一致逼近唯一性定理). 设 $f \in C[a, b]$, 则 f 在 n 次多项式空间 P_n 中的最佳一致逼近多项式 p_n^* 是唯一的。

证明:

提示: 反证法。

2.5 重要例题与习题

求解最佳平方逼近

记 $\Phi = \text{span}(1, x^2)$, 求 $x \in [0, 1]$ 上在 Φ 中的最佳平方逼近。

Chapter 3

数值微积分

3.1 补充内容

3.2 重要证明

3.2.1 闭型 Newton-Cotes 公式的导出与误差分析

3.2.2 开型 Newton-Cotes 公式的导出与误差分析

3.3 重要习题与例题

Chapter 4

常微分方程数值解

4.1 补充内容

4.1.1 一致 Lipschitz 常数的求解

若 $f(t, y)$ 关于 y 连续可微，则 Lipschitz 常数即为区间内 f 对 y 的偏导数的最大值，即

$$L = \max_{(t,y) \in D} \left| \frac{\partial f}{\partial y} \right| \quad (4.1)$$

4.2 重要证明

4.2.1 y 的各阶导数

当 $y' = f(t, y)$ 时，求 y 的各阶导数。

符号规范：记 $\partial f / \partial x_i = f_i$ ，即 f_i 是 f 对第 i 个变量的偏导数。在当前情境中，有

$$f_1 = \frac{\partial f}{\partial t} \quad (4.2)$$

$$f_2 = \frac{\partial f}{\partial y} \quad (4.3)$$

求解：

题目条件为

$$\frac{dy}{dt} = f(t, y) \quad (4.4)$$

即将对 y 的求导转化为了对 f 的全微分。于是有算符关系

$$\frac{d}{dt} = \frac{\partial}{\partial t} + \frac{dy}{dt} \frac{\partial}{\partial y} = \frac{\partial}{\partial t} + f \frac{\partial}{\partial y} \quad (4.5)$$

因此

$$y' = f \quad (4.6)$$

$$y'' = \frac{df}{dt} = \frac{\partial f}{\partial t} + f \frac{\partial f}{\partial y} \quad (4.7)$$

$$= f_1 + f f_2 \quad (4.8)$$

$$y''' = \frac{dy''}{dt} = \frac{df_1}{dt} + f \frac{df_2}{dt} + f_2 \frac{df}{dt} \quad (4.9)$$

$$= \frac{\partial f_1}{\partial t} + f \frac{\partial f_1}{\partial y} + f \left(\frac{\partial f_2}{\partial t} + f \frac{\partial f_2}{\partial y} \right) + f_2 \left(\frac{\partial f}{\partial t} + f \frac{\partial f}{\partial y} \right) \quad (4.10)$$

$$= f_{11} + f f_{12} + f(f_{21} + f f_{22}) + f_2(f_1 + f f_2) \quad (4.11)$$

$$= f_{11} + 2f f_{12} + f^2 f_{22} + f_2(f_1 + f f_2) \quad (4.12)$$

4.2.2 一步误差与局部截断误差的关系

$$(1 - h_{n+1}L)|\tilde{R}_{n+1}| \leq |R_{n+1}| \leq (1 + h_{n+1}L)|\tilde{R}_{n+1}| \quad (4.13)$$

4.3 重要习题与例题

4.3.1 求相容阶和主局部截断误差：泰勒级数展开法

欧拉法

梯形方法

4.3.2 显式 RK 的推导

基本思路：

局部截断误差为

$$R = y(t+h) - y(t) - h\Phi(t, y, f) \quad (4.14)$$

$$= \sum_{k=0}^{\infty} \frac{1}{k!} y^{(k)}(t) h^k \quad (4.15)$$

$$- y(t) \quad (4.16)$$

$$- h \cdot \sum_{k=1}^{\infty} \phi_k h^k \quad (4.17)$$

要令 RK 具有 n 阶相容性，即要令

$$R = p_{n+1}(t)h^{n+1} + O(h^{n+2}) \quad (4.18)$$

需要消去 R 中低于 h^{n+1} 的各阶项, 即可得到一系列关于 a_{ij}, b_i, c_i 的方程。

计算方法即为:

- 在 t 点对 $t(t+h)$ 作泰勒展开
- 在 (t_n, y_n) 对 $\phi(t_n, y_n, f)$ 作多元泰勒展开
- 令各阶系数相等, 即

$$\phi_k = \frac{1}{(k+1)!} y^{(k+1)} \quad (4.19)$$

显式二阶推导

显式 RK 参数矩阵:

$$\begin{array}{c|cc} c_1 = 0 & 0 & 0 \\ c_2 & a_{21} & 0 \\ \hline & b_1 + & b_2 = 1 \end{array} \quad (4.20)$$

RK 斜率:

$$k_1 = f(t_n, y_n) \quad (4.21)$$

$$k_2 = f(t_n + c_2 h, y_n + a_{21} h k_1) = f(t_n + c_2 h, y_n + a_{21} h f(t_n, y_n)) \quad (4.22)$$

增量函数:

$$\phi = b_1 k_1 + b_2 k_2 \quad (4.23)$$

对 k_1, k_2 作泰勒展开:

$$k_1 = f(t_n, y_n) = f \quad (4.24)$$

$$k_2 = f + f_1 c_2 h + f_2 \cdot c_2 h f + O(h^2) \quad (4.25)$$

则 $\phi = b_1 k_1 + b_2 k_2$ 的展开可表示为

$$\text{常数项: } \phi_0 = (b_1 + b_2) f \quad (4.26)$$

$$\text{一次项系数: } \phi_1 = b_2 c_2 f_1 + b_2 c_2 f f_2 \quad (4.27)$$

对 y 进行泰勒展开:

$$y' = f(t, y) \quad (4.28)$$

$$y'' = \frac{\partial f}{\partial t} + \frac{\partial f}{\partial y} \frac{\partial y}{\partial t} = f_1 + f f_2 \quad (4.29)$$

因此需要满足关系

$$(b_1 + b_2) f = y' = f \quad (4.30)$$

$$b_2 c_2 f_1 + b_2 c_2 f f_2 = \frac{1}{2} y'' = \frac{1}{2} (f_1 + f f_2) \quad (4.31)$$

即

$$b_1 + b_2 = 1 \quad (4.32)$$

$$b_2 c_2 = \frac{1}{2} \quad (4.33)$$

显式三阶推导

RK 参数矩阵

$$\begin{array}{c|ccc} c_1 = 0 & 0 & 0 & 0 \\ c_2 & a_{21} & 0 & 0 \\ c_3 & a_{31} & a_{32} & 0 \\ \hline & b_1 + & b_2 + & b_3 = 1 \end{array} \quad (4.34)$$

RK 斜率:

$$k_1 = f(t_n, y_n) = f \quad (4.35)$$

$$k_2 = f(t_n + c_2 h, y_n + a_{21} h k_1) \quad (4.36)$$

$$= f + f_1 c_2 h + f_2 \cdot a_{21} h f \quad (4.37)$$

$$+ \frac{f_{11}(c_2 h)^2 + 2f_{12}(c_2 h)(a_{21} h k_1) + f_{22}(a_{21} h k_1)^2}{2} + O(h^3) \quad (4.38)$$

$$= f + c_2 f_1 h + a_{21} f f_2 h \quad (4.39)$$

$$+ \frac{c_2^2 f_{11} + 2a_{21} c_2 f f_{12} + a_{21}^2 f^2 f_{22}}{2} h^2 + O(h^3) \quad (4.40)$$

$$= f + c_2(f_1 + f f_2)h + \frac{c_2^2}{2}(f_{11} + 2f f_{12} + f^2 f_{22})h^2 + O(h^3) \quad (4.41)$$

$$k_3 = f(t_n + c_3 h, y_n + h(a_{31} k_1 + a_{32} k_2)) \quad (4.42)$$

$$= f + f_1 c_3 h + f_2 h(a_{31} k_1 + a_{32} k_2) \quad (4.43)$$

$$+ \frac{f_{11} c_3^2 h^2 + 2f_{12} \cdot c_3 h \cdot h(a_{31} k_1 + a_{32} k_2) + f_{22}(a_{31} k_1 + a_{32} k_2)^2 h^2}{2} + O(h^3) \quad (4.44)$$

$$(4.45)$$

此时，向 k_3 中代入 k_1 和 k_2 时，不一定要带入到 h^2 项，只要令所有的 h^2 项系数正确即可。于是有

$$k_3 = f + f_1 c_3 h + f_2 h[a_{31} f + a_{32}(f + c_2(f_1 + f f_2)h)] \quad (4.46)$$

$$+ \frac{h^2}{2}[c_3^2 f_{11} + 2c_3 f_{12}(a_{31} f + a_{32} f) + f_{22}(a_{31} f + a_{32} f)^2] + O(h^3) \quad (4.47)$$

$$= f + [c_3 f_1 + (a_{31} + a_{32})f f_2]h \quad (4.48)$$

$$+ \frac{1}{2}[2a_{32} c_2 f_2(f_1 + f f_2) + c_3^2 f_{11} + 2c_3(a_{31} + a_{32})f f_{12} + f^2 f_{22}(a_{31} + a_{32})^2]h^2 + O(h^3) \quad (4.49)$$

代入 $a_{31} + a_{32} = c_3$ 后, 有

$$k_3 = f + c_3(f_1 + ff_2)h \quad (4.50)$$

$$+ \frac{1}{2}[2a_{32}c_2f_2(f_1 + ff_2) + c_3^2f_{11} + 2c_3^2ff_{12} + f^2f_{22}c_3^2]h^2 + O(h^3) \quad (4.51)$$

$$= f + c_3(f_1 + ff_2)h + \frac{1}{2}[2a_{32}c_2f_2(f_1 + ff_2) + c_3^2(f_{11} + 2ff_{12} + f^2f_{22})]h^2 + O(h^3) \quad (4.52)$$

先考虑 y 的各阶导数, 有

$$y' = f(t, y) \quad (4.53)$$

$$y'' = f_1 + ff_2 \quad (4.54)$$

$$y''' = f_{11} + 2ff_{12} + f^2f_{22} + f_2(f_1 + ff_2) \quad (4.55)$$

代入增量函数 $\phi = b_1k_1 + b_2k_2 + b_3k_3$, 可得

$$\text{常数项: } \phi_0 = (b_1 + b_2 + b_3)f \quad (4.56)$$

$$\text{一次项系数: } \phi_1 = (b_2c_2 + b_3c_3)(f_1 + ff_2) \quad (4.57)$$

$$\text{二次项系数: } \phi_2 = \frac{1}{2}[2b_3a_{32}c_2f_2(f_1 + ff_2) + (b_2c_2^2 + b_3c_3^2)(f_{11} + 2ff_{12} + f^2f_{22})] \quad (4.58)$$

由

$$\phi_0 = y' = f \quad (4.59)$$

$$\phi_1 = \frac{1}{2}y'' = \frac{1}{2}(f_1 + ff_2) \quad (4.60)$$

$$\phi_2 = \frac{1}{6}y''' = \frac{1}{6}[f_{11} + 2ff_{12} + f^2f_{22} + f_2(f_1 + ff_2)] \quad (4.61)$$

可得方程组

$$b_1 + b_2 + b_3 = 1 \quad (4.62)$$

$$b_2c_2 + b_3c_3 = \frac{1}{2} \quad (4.63)$$

$$a_{32}b_3c_2 = \frac{1}{6} \quad (4.64)$$

$$b_2c_2^2 + b_3c_3^2 = \frac{1}{3} \quad (4.65)$$

4.3.3 课本习题

1、显式 Euler 方法求解初值问题并分析误差

用显式 Euler 方法来求解初值问题, 列出数值解与解析解的误差.

(1)

$$y' = 1 + \frac{y}{x}, \quad 1 \leq x \leq 2, \quad y(1) = 2, \quad \text{取 } h = 0.25 \quad (\text{相应解析解为 } y(x) = x \ln x + 2x).$$

(2)

$$y' = \cos x + \sin 3x, \quad 0 \leq x \leq 1, \quad y(0) = 1, \quad \text{取 } h = 0.25 \quad (\text{相应解析解为 } y(x) = \frac{1}{2} \sin 2x - \frac{1}{3} \cos 3x + \frac{4}{3}).$$

证明： 显式 Euler 方法的格式为：

$$y_{n+1} = y_n + h_{n+1}f(t_n, y_n) \quad (4.66)$$

(1)

$$x_0 = 1, \quad y_0 = y(1) = 2 \quad (4.67)$$

$$x_1 = 1.25, \quad y_1 = y_0 + hf(x_0, y_0) = 2 + 0.25 \times \left(1 + \frac{2}{1}\right) = 2 + 0.25 \times 3 = 2.75 \quad (4.68)$$

$$x_2 = 1.5, \quad y_2 = y_1 + hf(x_1, y_1) = 2.75 + 0.25 \times \left(1 + \frac{2.75}{1.25}\right) = 2.75 + 0.25 \times 3.2 = 3.55 \quad (4.69)$$

$$x_3 = 1.75, \quad y_3 = y_2 + hf(x_2, y_2) = 3.55 + 0.25 \times \left(1 + \frac{3.55}{1.5}\right) = 3.55 + 0.25 \times 3.3667 = 4.3917 \quad (4.70)$$

$$x_4 = 2.0, \quad y_4 = y_3 + hf(x_3, y_3) = 4.3917 + 0.25 \times \left(1 + \frac{4.3917}{1.75}\right) = 4.3917 + 0.25 \times 3.5084 = 5.2698 \quad (4.71)$$

(2)

$$x_0 = 0, \quad y_0 = y(0) = 1 \quad (4.72)$$

$$x_1 = 0.25, \quad y_1 = y_0 + hf(x_0, y_0) = 1 + 0.25 \times (\cos 0 + \sin 0) = 1 + 0.25 \times 1 = 1.25 \quad (4.73)$$

$$x_2 = 0.5, \quad y_2 = y_1 + hf(x_1, y_1) = 1.25 + 0.25 \times (\cos 0.25 + \sin 0.75) \quad (4.74)$$

$$= 1.25 + 0.25 \times (0.9689 + 0.6816) = 1.25 + 0.25 \times 1.6505 = 1.6626 \quad (4.75)$$

$$x_3 = 0.75, \quad y_3 = y_2 + hf(x_2, y_2) = 1.6626 + 0.25 \times (\cos 0.5 + \sin 1.5) \quad (4.76)$$

$$= 1.6626 + 0.25 \times (0.8776 + 0.9975) = 1.6626 + 0.25 \times 1.8751 = 2.1304 \quad (4.77)$$

$$x_4 = 1.0, \quad y_4 = y_3 + hf(x_3, y_3) = 2.1304 + 0.25 \times (\cos 0.75 + \sin 2.25) \quad (4.78)$$

$$= 2.1304 + 0.25 \times (0.7317 + 0.7781) = 2.1304 + 0.25 \times 1.5098 = 2.5079 \quad (4.79)$$

2、改进 Euler 方法求解初值问题并分析误差

用改进的 Euler 方法解第 1 题中的问题, 并列出数值解和相应解析解的误差.

证明：

3、梯形方法迭代格式的收敛性证明

用梯形方法解初值问题

$$\begin{cases} y' = e^x \sin(xy), & x \in [0, 1], \\ y(0) = 1. \end{cases}$$

若迭代初值为 $y_{s+1}^{(0)} = y_s + hf(x_s, y_s)$, 试证逐步长 h 使迭代格式

$$y_{s+1}^{(k+1)} = y_s + \frac{h}{2} \left[f(x_s, y_s) + f(x_{s+1}, y_{s+1}^{(k)}) \right], \quad s = 0, 1, \dots$$

是收敛的.

证明： 求解过程为：

1. 微分方程数值解问题：用显欧拉法给出一套迭代初值 $\{y_k^{(0)}\}$
2. 非线性方程数值解问题：在每个点上，用给出的迭代格式进行迭代，求解非线性方程的数值解

因此，要证明第二步非线性方程的迭代格式是收敛的，只要证明它满足压缩映像原理。

$$|y_{n+1}^{(s+1)} - y_{n+1}^{(s)}| = \left| \frac{h}{2} [f(x_{n+1}, y_{n+1}^{(s)}) - f(x_{n+1}, y_{n+1}^{(s-1)})] \right| \quad (4.80)$$

$$= \frac{h}{2} |f(x_{n+1}, y_{n+1}^{(s)}) - f(x_{n+1}, y_{n+1}^{(s-1)})| \quad (4.81)$$

该微分方程有唯一数值解，即满足 Lipschitz 条件。对应的 Lipschitz 常数 L 可以将 Δf 与 Δy 联系起来。

$$L = \max_{x \in [0,1], y \in \mathbb{R}} \left| \frac{\partial f}{\partial y} \right| = \max_{x \in [0,1], y \in \mathbb{R}} |xe^x \cos(xy)| \leq e \quad (4.82)$$

因此迭代过程有

$$|y_{n+1}^{(s+1)} - y_{n+1}^{(s)}| \leq \frac{h}{2} L |y_{n+1}^{(s)} - y_{n+1}^{(s-1)}| \quad (4.83)$$

$$\leq \frac{he}{2} |y_{n+1}^{(s)} - y_{n+1}^{(s-1)}| \quad (4.84)$$

压缩映像原理要求

$$\frac{h}{2} e < 1 \quad (4.85)$$

即

$$h < \frac{2}{e} \quad (4.86)$$

4、梯形方法求解特定初值问题的结论证明

用梯形方法解初值问题 $y' = -y$, $y(1) = 1$, 试证明:

- (1) 取 $y_0 = y(1) = 1$, 有 $y_n = \left(\frac{2-h}{2+h}\right)^n$.
- (2) 当 $h \rightarrow 0, x = nh$ 不变时, y_n 收敛于初值问题的准确解 e^{-x_n} .

证明： (1) 梯形方法迭代格式:

$$y_{n+1} = y_n + \frac{h}{2} [f(t_n, y_n) + f(t_{n+1}, y_{n+1})] \quad (4.87)$$

由于该问题是自治的，不需要求解非线性方程，

$$y_{n+1} = y_n + \frac{h}{2} [-y_n - y_{n+1}] \quad (4.88)$$

$$\Rightarrow y_{n+1} = \frac{2-h}{2+h} y_n \quad (4.89)$$

初值为 $y_0 = 1$ ，因此

$$y_n = \left(\frac{2-h}{2+h} \right)^n \quad (4.90)$$

(2) 代入 $n = x/h$ ，求极限即可。注意，要用到对数求极限。

5、单步法的局部截断误差与绝对稳定性分析

试求出单步法

$$\begin{cases} y_{n+1} = y_n + hf(x_{n+1}, y_n + hf(x_n, y_n)), \\ y_0 = y(x_0) \end{cases}$$

的局部截断误差主项及绝对稳定性区间。

证明： 增量函数

$$\phi(x_n, x_{n+1}; y_n, y_{n+1}; f) = f(x_{n+1}, y_n + hf(x_n, y_n)) \quad (4.91)$$

局部截断误差：

$$R_{n+1} = y(x+h) - y(x) - h\phi(x_n, x_{n+1}; y_n, y_{n+1}; f) \quad (4.92)$$

$$= y(x+h) - y(x) - hf(x_{n+1}, y_n + hf(x_n, y_n)) \quad (4.93)$$

$$= y(x+h) - y(x) - hf(x+h, y+hf) \quad (4.94)$$

求 y 的各阶导数：

$$y' = f \quad (4.95)$$

$$y'' = f_1 + ff_2 \quad (4.96)$$

求 ϕ 的各阶导数：

$$\phi = f(x+h, y+hf) = f + (f_1 + ff_2)h + O(h^2) \quad (4.97)$$

于是有

$$R_{n+1} = y(x) + fh + \frac{1}{2}(f_1 + ff_2)h^2 + O(h^3) - y(x) \quad (4.98)$$

$$- h(f + (f_1 + ff_2)h + O(h^2)) \quad (4.99)$$

$$= -\frac{1}{2}h^2(f_1 + ff_2) + O(h^3) \quad (4.100)$$

$$= -\frac{h^2}{2}y'' + O(h^3) \quad (4.101)$$

故单步法的局部截断误差主项为 $-\frac{h^2}{2}y''$ 。

绝对稳定性分析：将单步法格式代入试验方程

$$y' = f = \lambda y \quad (4.102)$$

得到

$$y_{n+1} = y_n + h \cdot \lambda(y_n + h \cdot \lambda y_n) \quad (4.103)$$

$$= [(h\lambda)^2 + (h\lambda) + 1]y_n \quad (4.104)$$

绝对稳定性要求

$$|E(h\lambda)| = |(h\lambda)^2 + (h\lambda) + 1| < 1 \quad (4.105)$$

解得绝对稳定区间为复平面上满足

$$|z^2 + z + 1| < 1 \quad (4.106)$$

的区域。

6、中点公式与 Heun 方法求解初值问题并分析误差

应用中点公式及 Heun 方法

$$y_{n+1} = y_n + \frac{1}{4}hf(x_n, y_n) + \frac{3}{4}hf\left(x_n + \frac{2}{3}h, y_n + \frac{2}{3}hf(x_n, y_n)\right)$$

计算初值问题

$$\begin{cases} y' = y - x^2 + 1, & x \in [0, 1], \\ y(0) = 0.5. \end{cases}$$

取 $h = 0.2$, 列出数值解及相应的误差 (问题的解析解为 $y(x) = (x+1)^2 - \frac{1}{2}e^x$).

证明： 他都不让带计算器了，我认为不会考这玩意

7、多种数值方法求解初值问题的结果对比

应用显式 Euler 方法、改进的 Euler 方法以及四阶经典 Runge-Kutta 方法计算初值问题

$$\begin{cases} y' = -2y + 2x^2 + 2x, & x \in [0, 0.5], \\ y(0) = 1. \end{cases}$$

这三种方法步长 h 依次取为 0.25, 0.05, 0.1, 列出相应计算结果、解析解 $y(x) = e^{-2x} + x^2$ 的结果及相应的误差。

证明： 呃呃

8、中点公式的局部截断误差分析

试求出中点公式

$$y_{n+1} = y_n + hf\left(x_n + \frac{h}{2}, y_n + \frac{1}{2}hf(x_n, y_n)\right)$$

的局部截断误差主项.

证明： 对 y 逐次求导：

算子：

$$\frac{d}{dx_1} = \frac{\partial}{\partial x_1} + f \frac{\partial}{\partial x_2} \quad (4.107)$$

$$y' = f \quad (4.108)$$

$$y'' = \frac{df}{dx} = f_1 + ff_2 \quad (4.109)$$

$$y''' = \frac{df}{dx} = \frac{\partial f_1}{\partial x_1} + f \frac{\partial f_1}{\partial x_2} + f \left(\frac{\partial f_2}{\partial x_1} + f \frac{\partial f_2}{\partial x_2} \right) + \left(\frac{\partial f}{\partial x_1} + f \frac{\partial f}{\partial x_2} \right) f_2 \quad (4.110)$$

$$= f_{11} + ff_{21} + f(f_{12} + ff_{22}) + f_2(f_1 + ff_2) \quad (4.111)$$

$$= f_{11} + f(2f_{12} + ff_{22}) + f_2(f_1 + ff_2) \quad (4.112)$$

$$R_{n+1} = y(x+h) - y(x) - h\phi(x_n, x_{n+1}; y_n, y_{n+1}; f) \quad (4.113)$$

$$= y(x+h) - y(x) - hf\left(x + \frac{h}{2}, y + \frac{1}{2}hf\right) \quad (4.114)$$

$$= y(x) + fh + \frac{1}{2}(f_1 + ff_2)h^2 + \frac{1}{6}[f_{11} + f(2f_{12} + ff_{22}) + f_2(f_1 + ff_2)]h^3 + O(h^4) \quad (4.115)$$

$$- y(x) \quad (4.116)$$

$$- h(f + f_1 \frac{h}{2} + f_2 \frac{h}{2}f + \frac{f_{11} \left(\frac{h}{2}\right)^2 + 2f_{12} \left(\frac{hf}{2}\right) \left(\frac{h}{2}\right) + f_{22} \left(\frac{hf}{2}\right)^2}{2} + O(h^3)) \quad (4.117)$$

$$= \frac{1}{6}[f_{11} + f(2f_{12} + ff_{22}) + f_2(f_1 + ff_2)]h^3 - \frac{1}{8}(f_{11} + 2ff_{12} + f^2f_{22})h^3 + O(h^4) \quad (4.118)$$

$$= \frac{1}{24}[f_{11} + f(2f_{12} + ff_{22}) + 4f_2(f_1 + ff_2)]h^3 + O(h^4) \quad (4.119)$$

故局部截断误差主项为

$$\frac{1}{24}[f_{11} + f(2f_{12} + ff_{22}) + 4f_2(f_1 + ff_2)]h^3 \quad (4.120)$$

9、特定初值问题下数值方法的近似值一致性证明

对于初值问题

$$\begin{cases} y' = -y + x + 1, & x \in [0, 1], \\ y(0) = 1, \end{cases}$$

试证明用中点方法、改进的 Euler 方法以及 Heun 方法 (见第 6 题) 求解, 对任意的步长 h 均有相同的近似值.

证明: 只要证明其一阶泰勒展开式相等。

• 中点方法:

$$y_{n+1} = y_n + hf(x_n + \frac{1}{2}h, y_n + \frac{1}{2}hf) \quad (4.121)$$

$$\approx y_n + h(f + \frac{1}{2}hf_1 + \frac{1}{2}hff_2) \quad (4.122)$$

$$= y_n + hf + \frac{1}{2}(f_1 + ff_2)h^2 \quad (4.123)$$

• Heun 方法:

$$y_{n+1} = y_n + \frac{1}{4}hf(x_n, y_n) + \frac{3}{4}hf\left(x_n + \frac{2}{3}h, y_n + \frac{2}{3}hf(x_n, y_n)\right) \quad (4.124)$$

$$\approx y_n + \frac{1}{4}hf + \frac{3}{4}h(f + \frac{2}{3}hf_1 + \frac{2}{3}hff_2) \quad (4.125)$$

$$= y_n + hf + \frac{1}{2}(f_1 + ff_2)h^2 \quad (4.126)$$

• 改进 Euler 方法:

$$y_{n+1} = y_n + \frac{h}{2}[f + f(t+h, y+hf)] \quad (4.127)$$

$$\approx y_n + \frac{h}{2}[f + f + hf_1 + hff_2] \quad (4.128)$$

$$= y_n + hf + \frac{1}{2}(f_1 + ff_2)h^2 \quad (4.129)$$

故三者具有相同的近似值。

10、隐式中点方法的绝对稳定性区间分析

试求出隐式中点方法

$$y_{n+1} = y_n + hf\left(x_n + \frac{1}{2}h, \frac{1}{2}(y_n + y_{n+1})\right)$$

的绝对稳定性区间 (推广 §3.5 的方法).

证明： 试验方程：

$$y' = f(y) = \lambda y \quad (4.130)$$

代入隐式中点方法有

$$y_{n+1} = y_n + h \cdot \frac{\lambda}{2}(y_n + y_{n+1}) \quad (4.131)$$

$$\Rightarrow y_{n+1} = \frac{2 + (h\lambda)}{2 - (h\lambda)} y_n \quad (4.132)$$

则绝对稳定性区间为

$$|E(h\lambda)| = \left| \frac{2 + (h\lambda)}{2 - (h\lambda)} \right| < 1 \quad (4.133)$$

$$\Rightarrow \Re(h\lambda) < 0 \quad (4.134)$$

即绝对稳定性区间为负半实轴。

11、二步显式 Adams 方法的局部截断误差推导

试推导二步显式 Adams 方法与二步隐式 Adams 方法的局部截断误差。

证明： 二步显式 Adams 方法：

$$y_{n+1} = y_n + h \left(\frac{3}{2}f(t_n, y_n) - \frac{1}{2}f(t_{n-1}, y_{n-1}) \right) \quad (4.135)$$

$$\Leftrightarrow y_{n+1} - y_n = h \left(\frac{3}{2}f(t_n, y_n) - \frac{1}{2}f(t_{n-1}, y_{n-1}) \right) \quad (4.136)$$

局部截断误差：

$$R_{n+1} = y(t_{n+1}) - y(t_n) - h \left(\frac{3}{2}f(t_n, y_n) - \frac{1}{2}f(t_{n-1}, y_{n-1}) \right) \quad (4.137)$$

$$= y(t+h) - y(t) - h \left(\frac{3}{2}f - \frac{1}{2}y'(t-h) \right) \quad (4.138)$$

$$= y(t) + y'h + \frac{1}{2}y''h^2 + \frac{1}{6}y'''h^3 + O(h^4) \quad (4.139)$$

$$- y(t) \quad (4.140)$$

$$- h \left[\frac{3}{2}y' - \frac{1}{2}(y' - y''h + \frac{1}{2}y'''h^2) + O(h^3) \right] \quad (4.141)$$

$$= \frac{1}{6}y'''h^3 + \frac{1}{4}y'''h^3 + O(h^4) \quad (4.142)$$

$$= -\frac{5}{12}y'''h^3 + O(h^4) \quad (4.143)$$

二步隐式 Adams 方法：

$$y_{n+1} = y_n + \frac{1}{12}h(5f(t_{n+1}, y_{n+1}) + 8f(t_n, y_n) - f(t_{n-1}, y_{n-1})) \quad (4.144)$$

$$\Leftrightarrow y_n - y_{n-1} = \frac{1}{12}h(5f(t_{n+1}, y_{n+1}) + 8f(t_n, y_n) - f(t_{n-1}, y_{n-1})) \quad (4.145)$$

局部截断误差：

$$R_{n+1} = y(t_{n+1}) - y(t_n) - \frac{1}{12}h(5f(t_{n+1}, y_{n+1}) + 8f(t_n, y_n) - f(t_{n-1}, y_{n-1})) \quad (4.146)$$

$$= y(t+h) - y(t) - \frac{1}{12}h(5y'(t+h) + 8y'(t) - y'(t-h)) \quad (4.147)$$

$$= y(t) + y'h + \frac{1}{2}y''h^2 + \frac{1}{6}y'''h^3 + \frac{1}{24}y''''h^4 + O(h^5) \quad (4.148)$$

$$- y(t) \quad (4.149)$$

$$- \frac{1}{12}h[5(y' + y''h + \frac{1}{2}y'''h^2 + \frac{1}{6}y''''h^3 + O(h^4)) + 8y' - (y' - y''h + \frac{1}{2}y'''h^2 - \frac{1}{6}y''''h^3 + O(h^4))] \quad (4.150)$$

$$= -\frac{1}{24}y''''h^4 + O(h^5) \quad (4.151)$$

12、Hamming 公式的局部截断误差分析

试推导 Hamming 公式

$$y_{n+3} = \frac{1}{8}(9y_{n+2} - y_n) + \frac{3}{8}h[f(x_{n+3}, y_{n+3}) + 2f(x_{n+2}, y_{n+2}) - f(x_{n+1}, y_{n+1})]$$

的局部截断误差主项.

证明： 活不了了

13、数值积分法推导二步数值方法

试用数值积分方法直接推导二步方法

$$y_{n+2} - y_{n+1} = \frac{h}{12} [5f(x_{n+2}, y_{n+2}) + 8f(x_{n+1}, y_{n+1}) - f(x_n, y_n)].$$

证明： 记 $x_n = -h, x_{n+1} = 0, x_{n+2} = h$ ，则可以构造 Lagrange 插值多项式：

$$L_0 = \frac{x^2 - hx}{2h^2} \quad (4.152)$$

$$L_1 = \frac{h^2 - x^2}{h^2} \quad (4.153)$$

$$L_2 = \frac{x^2 + hx}{2h^2} \quad (4.154)$$

三者在 $[0, h]$ 上的积分是

$$\int_0^h L_0 dx = -\frac{1}{12}h \quad (4.155)$$

$$\int_0^h L_1 dx = \frac{2}{3}h = \frac{8}{12}h \quad (4.156)$$

$$\int_0^h L_2 dx = \frac{5}{12}h \quad (4.157)$$

于是有

$$y_{n+1} - y_n = \int_{x_n}^{x_{n+1}} f(x, y(x)) dx = \sum_{i=0}^2 f(x_{n+i}, y_{n+i}) \int_0^h L_i dx \quad (4.158)$$

$$= -\frac{h}{12}f_n + \frac{8}{12}f_{n+1} + \frac{5}{12}f_{n+2} \quad (4.159)$$

$$= \frac{h}{12}[5f(x_{n+2}, y_{n+2}) + 8f(x_{n+1}, y_{n+1}) - f(x_n, y_n)] \quad (4.160)$$

14、Adams 方法求解初值问题并与解析解对比

用四阶的显式 Adams 方法和隐式 Adams 方法解初值问题

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

取 $h = 0.2$, 将结果与解析解作比较 (解析解 $y(x) = (x + 1) + \frac{1}{2}e^{-x}$).

证明： 鸣咕

15、线性二步法的阶数证明

证明线性二步法

$$y_{n+2} + (b-1)y_{n+1} - by_n = \frac{1}{4}h[(b+3)f(x_{n+2}, y_{n+2}) + (3b+1)f(x_n, y_n)]$$

当 $b \neq -1$ 时是二阶的, 当 $b = -1$ 时是三阶的.

证明:

16、线性多步法的阶数参数确定

试确定 α 使线性多步法

$$y_{n+3} + \alpha(y_{n+2} - y_{n+1}) - y_n = \frac{1}{2}(3 + \alpha)h[f(x_{n+2}, y_{n+2}) + f(x_{n+1}, y_{n+1})]$$

是四阶的.

证明： 以 t_{n+1} 为展开点，

$$R_{n+1} = y(t+h) + (b-1)y(t) - by(t-h) - \frac{1}{4}h[(b+3)y'(t+h) + (3b+1)y'(t-h)] \quad (4.161)$$

$$= y + y'h + \frac{1}{2}y''h^2 + \frac{1}{6}y'''h^3 + \frac{1}{24}y''''h^4 + O(h^5) \quad (4.162)$$

$$+ (b-1)y \quad (4.163)$$

$$- b(y - y'h + \frac{1}{2}y''h^2 - \frac{1}{6}y'''h^3 + \frac{1}{24}y''''h^4 + O(h^5)) \quad (4.164)$$

$$- \frac{h}{4}[(b+3)(y' + y''h + \frac{1}{2}y'''h^2 + \frac{1}{6}y''''h^3 + O(h^4)) \quad (4.165)$$

$$+ (3b+1)(y' - y''h + \frac{1}{2}y'''h^2 - \frac{1}{6}y''''h^3 + O(h^4))] \quad (4.166)$$

$$= (1+b-1-b)y + y'h(1+b - \frac{b+3}{4} - \frac{3b+1}{4}) + y''h^2(\frac{1}{2} - \frac{1}{2}b - \frac{b+3}{4} + \frac{3b+1}{4}) \quad (4.167)$$

$$+ y'''h^3(\frac{1}{6} + \frac{b}{6} - \frac{b+3}{8} - \frac{3b+1}{8}) + y''''h^4(\frac{1}{24} - \frac{b}{24} - \frac{b+3}{24} - \frac{3b+1}{24}) + O(h^5) \quad (4.168)$$

可见 h^0, h^1, h^2 项恒为 0，要求 h^3 项为 0，有

$$\frac{1}{6} + \frac{b}{6} - \frac{b+3}{8} - \frac{3b+1}{8} = 0 \quad (4.169)$$

解得 $b = -1$ ，此时 h^4 项也为 0，因此该线性多步法在 $b = -1$ 时是四阶的。

17、线性多步法的收敛性分析

讨论线性多步法

$$y_{n+3} + \frac{1}{4}y_{n+2} - \frac{1}{2}y_{n+1} - \frac{3}{4}y_n = \frac{1}{8}h[19f(x_{n+2}, y_{n+2}) + 5f(x_n, y_n)]$$

的收敛性。

证明： 要让多步法收敛，只要求其满足相容性。

收敛性要求多步法满足强稳定性和相容性。

强稳定性：只要证特征方程的根全部在单位圆内，且模为 1 的根是单根。

特征方程：

$$\rho(x) = x^3 + \frac{1}{4}x^2 - \frac{1}{2}x - \frac{3}{4} \quad (4.170)$$

$$\sigma(x) = \frac{19}{8}x^2 + \frac{5}{8} \quad (4.171)$$

解得特征方程的根为

$$x_1 = 1 \quad (4.172)$$

$$x_2 = \frac{-5 - i\sqrt{23}}{8} \quad (4.173)$$

$$x_3 = \frac{-5 + i\sqrt{23}}{8} \quad (4.174)$$

三个根的模分别为

$$|x - 1| = 1 \quad (4.175)$$

$$|x_2| = |x_3| = \frac{48}{64} < 1 \quad (4.176)$$

故多步法是具有强稳定性的。

相容性：

$$\rho'(x) = 3x^2 + \frac{1}{2}x - \frac{1}{2} \neq \sigma(x) \quad (4.177)$$

故多步法不具有相容性，多步法不收敛。

18、线性多步法的收敛性分析

讨论线性多步法

$$y_{n+2} + y_{n+1} - 2y_n = \frac{1}{4}h [f(x_{n+2}, y_{n+2}) + 8f(x_{n+1}, y_{n+1}) + 3f(x_n, y_n)]$$

的收敛性

证明：

$$\rho(x) = x^2 + x - 2 \quad (4.178)$$

$$\sigma(x) = \frac{1}{4}x^2 + 2x + \frac{3}{4} \quad (4.179)$$

强稳定性：特征多项式的根为

$$x_1 = 1 \quad (4.180)$$

$$x_2 = -2 \quad (4.181)$$

故不具有强稳定性。多步法不收敛。

19、线性多步法的相容性分析

讨论线性多步法

$$y_{n+2} - y_{n+1} = \frac{h}{2} [3f(x_{n+1}, y_{n+1}) - f(x_n, y_n)] \quad (4.182)$$

的相容性。

证明： 在 x_{n+1} 处展开：

$$R_{n+1} = y(x+h) - y - \frac{h}{2}[3y' - y'(x-h)] \quad (4.183)$$

$$= y + y'h + \frac{1}{2}y''h^2 + \frac{1}{6}y'''h^3 \quad (4.184)$$

$$- y \quad (4.185)$$

$$- \frac{h}{2}[3y' - (y' - y''h + \frac{1}{2}y'''h^2)] \quad (4.186)$$

$$= \frac{5}{12}h^3y''' + O(h^4) \quad (4.187)$$

故具有二阶相容性。

20、A-稳定性

试证明隐式 Euler 方法是 A-稳定的。

证明： 隐式 Euler 方法：

$$y_{n+1} = y_n + hf(x_{n+1}, y_{n+1}) \quad (4.188)$$

代入试验方程

$$y' = f = \lambda y \quad (4.189)$$

得到

$$y_{n+1} = y_n + h\lambda y_{n+1} \quad (4.190)$$

$$\Rightarrow y_{n+1} = \frac{1}{1 - h\lambda} y_n \quad (4.191)$$

故绝对稳定性要求

$$\left| \frac{1}{1 - \mu} \right| < 1 \quad (4.192)$$

令 $\mu = x + iy$ ，则有

$$(x-1)^2 + y^2 > 1 \quad (4.193)$$

只要实部 $x < 0$ ，则上式恒成立，因此隐式 Euler 方法是 A-稳定的。

Chapter 5

圣遗物，考前必看

圣遗物 1

1. (共 10 分) 对于线性代数方程组 $Ax = b$ ，残量定义为 $r = b - Ax$ 。回答下述问题：

- (a) 写出 Richardson 迭代格式，分析格式的收敛性。
- (b) 设 M 为可逆矩阵，写出以 M 为预处理矩阵的 Richardson 迭代格式。
- (c) 设 A 为对称正定矩阵，选择预处理矩阵为数乘矩阵，即 $M = \mu I$ (I 为单位矩阵， μ 为标量)。则当 (且仅当) μ 满足何种条件时，此预处理方法是收敛的？

证明：

2. (共 10 分) 给定系数矩阵为对称正定矩阵的线性代数方程组 $Ax = b$ 。请回答下述问题：

- (a) 定义函数

$$\varphi(x) = \frac{1}{2}(Ax, x) - (b, x),$$

其中内积 (x, y) 为标准的欧式内积。证明在全空间中存在唯一的临界点；该临界点为全局最小值点，且恰好是 $Ax = b$ 的根。

- (b) 设当前近似向量为 x 。写出从 x 出发，平行于方向 p 做一维极小搜索得到的新近似向量的表达式。
- (c) 证明新近似向量的残量与搜索方向 p 是正交的 (关于欧式内积)。

证明：

3. (共 10 分) 设 A 是一个实对称矩阵，则其特征值和特征向量都是实的。若特征向量满足 $\|x\|_2 = 1$ ，则称 x 为归一化特征向量。请回答下述问题：

- (a) 写出 Newton 法计算特征值及其对应的归一化特征向量的计算格式。
- (b) 证明当特征值是单特征值时，上述计算方法是局部二阶收敛的。

解:

4. (共 10 分) 设实矩阵序列 $\{X_k\}$ 满足

$$X_{k+1} = X_k + X_k(I - AX_k), \quad k = 0, 1, \dots$$

证明如下结论:

(a) 令 $E_k = I - AX_k$, 则 $E_{k+1} = E_k^2$ 。

(b) $\{X_k\}$ 至少局部二阶收敛到 A^{-1} 。

证明:

5. (共 10 分) 考虑常微分方程组 $y' = f(t, y)$ 的初值问题。请回答下述问题:

(a) 写出一般步长情况下的显式 Euler 方法、隐式 Euler 方法以及梯形方法的计算格式。

(b) 分析梯形方法的相容性, 写出该方法的主局部截断误差。

证明:

6. (共 10 分) 考虑常微分方程组 $y' = f(t, y)$ 的初值问题。用如下的等步长 Runge-Kutta 方法

$$y_{n+1} = y_n + hK,$$

其中 K 满足

$$K = f(t_n + h/2, y_n + hK/2).$$

请回答下述问题:

(a) 证明该方法恰好是二阶收敛的 (需要说明其不是三阶方法)。

(b) 确定该方法的绝对稳定区域。

证明:

圣遗物 2

1. 证明：设得到 $Ax = b$ 的一个近似解 \bar{x} ，其残量为

$$r = b - A\bar{x} \quad (5.1)$$

设 x 和 \bar{x} 分别是准确解和近似解，证明：

$$\frac{1}{\text{cond}(A)} \frac{\|r\|}{\|b\|} \leq \frac{\|x - \bar{x}\|}{\|x\|} \leq \text{cond}(A) \frac{\|r\|}{\|b\|} \quad (5.2)$$

证明：

2. 矩阵 A 不可分且弱对角占优，证明：

- (a) A 对角元素不等于 0
- (b) 矩阵 A 非奇异
- (c) $Ax=b$ 的 Jacobi 迭代收敛

证明：

3. 有以下迭代格式：

$$x_{k+1} = \frac{x_k(3 + x_k^2)}{3x_k^2 + 1}$$

- (a) 求该迭代的不动点
- (b) 分析各不动点的局部收敛性和收敛阶
- (c) 求各不动点的收敛域

证明：

4. 经典再放送

(共 10 分) 设 A 是一个实对称矩阵，则其特征值和特征向量都是实的. 若特征向量 x 满足 $\|x\|_2 = 1$ ，则称 x 为归一化特征向量. 请回答下述问题：

- (a) 写出 Newton 法计算特征值及其对应的归一化特征向量的计算格式
- (b) 证明当特征值是单特征值时，上述计算方法是局部二阶收敛的

证明：

5. 微分方程： $y' = f(t, y)$ ，迭代式：

$$y_{n+1} = y_n + h(\theta f(t_n + y_n) + (1 - \theta)f(t_{n+1}, y_{n+1})), \quad \theta \in [0, 1]$$

- (a) 该迭代的相容阶
- (b) 绝对稳定区间

证明：

Chapter 6

圣遗物答案

圣遗物 1

1. (共 10 分) 对于线性代数方程组 $Ax = b$, 残量定义为 $r = b - Ax$ 。回答下述问题:

- (a) 写出 Richardson 迭代格式, 分析格式的收敛性。
- (b) 设 M 为可逆矩阵, 写出以 M 为预处理矩阵的 Richardson 迭代格式。
- (c) 设 A 为对称正定矩阵, 选择预处理矩阵为数乘矩阵, 即 $M = \mu I$ (I 为单位矩阵, μ 为标量)。则当 (且仅当) μ 满足何种条件时, 此预处理方法是收敛的?

证明:

2. (共 10 分) 给定系数矩阵为对称正定矩阵的线性代数方程组 $Ax = b$ 。请回答下述问题:

- (a) 定义函数

$$\varphi(x) = \frac{1}{2}(Ax, x) - (b, x),$$

其中内积 (x, y) 为标准的欧式内积。证明在全空间中存在唯一的临界点; 该临界点为全局最小值点, 且恰好是 $Ax = b$ 的根。

- (b) 设当前近似向量为 x 。写出从 x 出发, 平行于方向 p 做一维极小搜索得到的新近似向量的表达式。
- (c) 证明新近似向量的残量与搜索方向 p 是正交的 (关于欧式内积)。

证明:

3. (共 10 分) 设 A 是一个实对称矩阵, 则其特征值和特征向量都是实的。若特征向量满足 $\|x\|_2 = 1$, 则称 x 为归一化特征向量。请回答下述问题:

- (a) 写出 Newton 法计算特征值及其对应的归一化特征向量的计算格式。
- (b) 证明当特征值是单特征值时, 上述计算方法是局部二阶收敛的。

解:

设 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 是一个实对称矩阵。我们需要寻找特征对 (λ, x) , 使得 $Ax = \lambda x$ 且满足归一化条件 $\|x\|_2 = 1$ 。

(1) 使用 *Newton* 法计算特征值及其归一化特征向量的计算格式

为了使用 *Newton* 法, 定义非线性映射 $F: \mathbb{R}^{n+1} \rightarrow \mathbb{R}^{n+1}$ 如下:

$$F(z) = F(x, \lambda) = \begin{pmatrix} Ax - \lambda x \\ \frac{1}{2}(x^T x - 1) \end{pmatrix} = 0$$

其中 $z = [x^T, \lambda]^T$ 。其相应的 Jacobian 矩阵 $J(x, \lambda)$ 为:

$$J(x, \lambda) = \begin{pmatrix} A - \lambda I & -x \\ x^T & 0 \end{pmatrix}$$

给定初始近似值 x_0 和 λ_0 , 第 k 步迭代格式为:

(a) 解线性方程组得到增量 $\Delta z_k = [\Delta x_k^T, \Delta \lambda_k]^T$:

$$\begin{pmatrix} A - \lambda_k I & -x_k \\ x_k^T & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \Delta x_k \\ \Delta \lambda_k \end{pmatrix} = - \begin{pmatrix} Ax_k - \lambda_k x_k \\ \frac{1}{2}(x_k^T x_k - 1) \end{pmatrix}$$

(b) 更新解: $x_{k+1} = x_k + \Delta x_k$, $\lambda_{k+1} = \lambda_k + \Delta \lambda_k$ 。

(2) 证明当特征值是单特征值时, 上述计算方法是局部二阶收敛的

证明. 根据 *Newton* 法的性质, 若 $J(z^*)$ 在解点处非奇异, 则具有局部二阶收敛性。考虑齐次方程 $J(z^*)[u^T, v]^T = 0$:

$$(A - \lambda^* I)u - vx^* = 0 \tag{6.1}$$

$$(x^*)^T u = 0 \tag{6.2}$$

将式 (6.1) 左乘 $(x^*)^T$, 利用 A 的对称性及 $(A - \lambda^* I)x^* = 0$, 得:

$$(x^*)^T (A - \lambda^* I)u - v(x^*)^T x^* = 0 \implies 0 - v \cdot 1 = 0 \implies v = 0$$

将 $v = 0$ 代入式 (6.1) 得 $(A - \lambda^* I)u = 0$ 。由于 λ^* 是单特征值, 其特征空间维数为 1, 故 $u = \alpha x^*$ 。代入式 (6.2) 有:

$$(x^*)^T (\alpha x^*) = \alpha \|x^*\|_2^2 = \alpha = 0 \implies u = 0$$

由于齐次方程只有零解, Jacobian 矩阵 $J(z^*)$ 非奇异。因此, 该方法在单特征值附近是局部二阶收敛的。□

4. (共 10 分) 设实矩阵序列 $\{X_k\}$ 满足

$$X_{k+1} = X_k + X_k(I - AX_k), \quad k = 0, 1, \dots$$

证明如下结论：

(a) 令 $E_k = I - AX_k$ ，则 $E_{k+1} = E_k^2$ 。

(b) $\{X_k\}$ 至少局部二阶收敛到 A^{-1} 。

证明：

5. (共 10 分) 考虑常微分方程组 $y' = f(t, y)$ 的初值问题。请回答下述问题：

(a) 写出一般步长情况下的显式 Euler 方法、隐式 Euler 方法以及梯形方法的计算格式。

(b) 分析梯形方法的相容性，写出该方法的主局部截断误差。

证明：

6. (共 10 分) 考虑常微分方程组 $y' = f(t, y)$ 的初值问题。用如下的等步长 Runge-Kutta 方法

$$y_{n+1} = y_n + hK,$$

其中 K 满足

$$K = f(t_n + h/2, y_n + hK/2).$$

请回答下述问题：

(a) 证明该方法恰好是二阶收敛的 (需要说明其不是三阶方法)。

(b) 确定该方法的绝对稳定区域。

证明：

圣遗物 2

1. 证明：设得到 $Ax = b$ 的一个近似解 \bar{x} ，其残量为

$$r = b - A\bar{x} \quad (6.3)$$

设 x 和 \bar{x} 分别是准确解和近似解，证明：

$$\frac{1}{\text{cond}(A)} \frac{\|r\|}{\|b\|} \leq \frac{\|x - \bar{x}\|}{\|x\|} \leq \text{cond}(A) \frac{\|r\|}{\|b\|} \quad (6.4)$$

证明：

2. 矩阵 A 不可分且弱对角占优，证明：

- (a) A 对角元素不等于 0
- (b) 矩阵 A 非奇异
- (c) $Ax=b$ 的 Jacobi 迭代收敛

证明：

3. 有以下迭代格式：

$$x_{k+1} = \frac{x_k(3 + x_k^2)}{3x_k^2 + 1}$$

- (a) 求该迭代的不动点
- (b) 分析各不动点的局部收敛性和收敛阶
- (c) 求各不动点的收敛域

证明：

4. 经典再放送

(共 10 分) 设 A 是一个实对称矩阵，则其特征值和特征向量都是实的. 若特征向量 x 满足 $\|x\|_2 = 1$ ，则称 x 为归一化特征向量. 请回答下述问题：

- (a) 写出 Newton 法计算特征值及其对应的归一化特征向量的计算格式
- (b) 证明当特征值是单特征值时，上述计算方法是局部二阶收敛的

证明：

5. 微分方程： $y' = f(t, y)$ ，迭代式：

$$y_{n+1} = y_n + h(\theta f(t_n + y_n) + (1 - \theta)f(t_{n+1}, y_{n+1})), \quad \theta \in [0, 1]$$

- (a) 该迭代的相容阶
- (b) 绝对稳定区间

证明：