

Pracownia z ANALIZY NUMERYCZNEJ

Lista nr 1

Początek zapisów: **12 października 2015 r.**

Termin realizacji: **15 listopada 2015 r.**

Punktacja (podana przy każdym zadaniu): **7–12 punktów**

Każde z zadań może być wybrane najwyżej przez trzy osoby (trzy zespoły dwuosobowe — w wypadku zadań P1.18, P1.24) spośród wszystkich zapisanych na pracownię.

P1.1. 10 punktów Ciąg $x_k := 2^k \sin \frac{\pi}{2^k}$ ($k = 1, 2, \dots$) jest zbieżny do π . Wykazać, że ciąg ten spełnia każdy z następujących trzech związków rekurencyjnych:

$$(1) \quad x_{k+1} = 2^k \sqrt{2 \left(1 - \sqrt{1 - (x_k/2^k)^2} \right)} \quad (k = 1, 2, \dots; x_1 = 2);$$

$$(2) \quad x_{k+1} = \frac{2x_k}{\sqrt{2 \left(1 + \sqrt{1 - (x_k/2^k)^2} \right)}} \quad (k = 1, 2, \dots; x_1 = 2);$$

$$(3) \quad x_{k+1} = x_k \sqrt{\frac{2x_k}{x_k + x_{k-1}}} \quad (k = 2, 3, \dots; x_1 = 2, x_2 = 2\sqrt{2}).$$

Stosując oddzielnie wzory (1)–(3) obliczać – z pojedynczą, a następnie z podwójną precyzją – kolejne wyrazy ciągu $\{x_k\}$ do chwili, gdy dwa kolejne wyrazy mają 5 identycznych początkowych cyfr. Powtórzyć obliczenia żądając stabilizacji 8 cyfr. Wyciągnąć wnioski.

P1.2. 10 punktów Następujący *algorytm sumowania z poprawkami* pozwala obliczyć z dużą dokładnością sumę $s = \sum_{i=1}^n x_i$, w standardowej arytmetyce *fl*:

```
s := x1;  c := 0;
for i from 2 to n do
  y := c + xi;
  t := s + y;
  c := (s - t) + y;
  s := t;
end
```

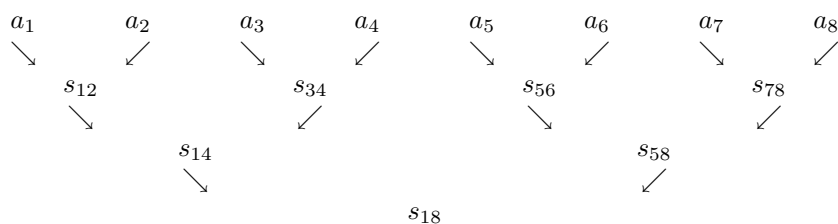
Dowodzi się, że $fl(s) = \sum_{i=1}^n (1 + \xi_i)x_i$, gdzie $|\xi_i| \leq 2 \cdot 2^{-t} + O(n2^{-2t})$.
Oblicz sumę

$$\sum_{k=1}^{10000} k^{-2}$$

stosując

- algorytm sumowania składników w naturalnej kolejności (i) z pojedynczą precyzją, następnie (ii) z podwójną precyzją, a także
 - algorytm sumowania z poprawkami, w arytmetyce z pojedynczą precyzją.
- Porównaj wyniki. Podaj wnioski.

P1.3. 10 punktów Stosując strategię *dziel i zwyciężaj* wartość sumy $\sum_{k=1}^8 a_k$ można wyznaczyć wykonując obliczenia zgodnie z następującym diagramem:



gdzie $s_{ij} := a_i + a_{i+1} + \dots + a_j$. Zaproponuj podobny sposób wyznaczania wartości wyrażenia $\sum_{k=1}^n a_k$, gdzie $n := 2^m$ dla pewnego $m \in \mathbb{N}$ i porównaj go pod względem jakości numerycznej z tradycyjną metodą sumowania. Przeprowadź eksperymenty wykonując obliczenia z pojedynczą i podwójną precyzją dla odpowiednio dobranych elementów a_1, a_2, \dots, a_n . Czy inne uporządkowanie elementów a_k coś zmienia? Co możemy zaobserwować dla dużych wartości n ? Jak to wytłumaczyć?

P1.4. 8 punktów Niech $x := 1 + \pi/10^6$. Oblicz x^n dla $n = k \times 10^5$, $k = 1, 2, \dots, 10$, stosując arytmetyki z pojedynczą i podwójną precyzją; oblicz błąd względny ρ_n wyniku obliczonego w arytmetyce z pojedynczą precyzją w odniesieniu do wyniku obliczonego w arytmetyce z podwójną precyzją. (Jaka powinna być, w przybliżeniu, wartość x^n dla $n = 10^6$?) Dla podanych wyżej wartości n wydrukuj: n , x^n , ρ_n , $\rho_n/(n \times \varepsilon)$, gdzie ε jest błędem reprezentacji maszynowej.

P1.5. 11 punktów Wartość skończonego ułamka łańcuchowego

$$C_n := b_0 + \frac{a_1}{b_1 + \frac{a_2}{b_2 + \dots + \frac{a_n}{b_n}}}$$

można obliczyć metodą „schodami w górę”, używając wzorów

$$\begin{aligned} U_n &= b_n, \\ U_k &= \frac{a_{k+1}}{U_{k+1}} + b_k \quad (k = n-1, n-2, \dots, 0), \\ C_n &= U_0. \end{aligned}$$

Metoda „schodami w dół” jest następująca: obliczamy pomocnicze wielkości P_k i Q_k wg wzorów

$$\begin{aligned} P_{-1} &= 1, & P_0 &= b_0, & P_k &= b_k P_{k-1} + a_k P_{k-2} & (k = 1, 2, \dots, n); \\ Q_{-1} &= 0, & Q_0 &= 1, & Q_k &= b_k Q_{k-1} + a_k Q_{k-2} & (k = 1, 2, \dots, n). \end{aligned}$$

Wówczas $C_n = P_n/Q_n$.

a) Porównaj te metody pod względem kosztu realizacji i własności numerycznych.

b) Wykonaj obliczenia dla następujących danych:

- $a_1 = 1$, $a_2 = 1$, $a_3 = 9$, $a_4 = 25$, $a_5 = 49, \dots$, $b_0 = 0$, $b_1 = 1$, $b_k = 2$ ($k \geq 2$); sprawdź, czy dla dostatecznie dużego n jest $C_n \approx \pi/4$;
- $b_0 = 2$, $a_k = b_k = k + 1$ ($k \geq 1$); sprawdź, czy dla dostatecznie dużego n jest $C_n \approx e$.

Literatura

- [1] P. Van der Cruyssen, *A continued fraction algorithm*, Numerische Mathematik 37 (1981), 149–156. DOI: 10.1007/BF01396192; Kopię artykułu można otrzymać od prowadzących pracownię.

P1.6. 7 punktów Obliczać — z pojedynczą, a następnie z podwójną precyzją — kolejne wyrazy ciągów

$$(a) \quad s_n := \sum_{k=0}^n (-1)^k k!^{-2}, \quad (b) \quad t_n := \sum_{k=0}^n k!^{-2}$$

do chwili, gdy dwa kolejne wyrazy są równe w wybranej arytmetyce maszynowej. Objasnić wyniki. (Wybierz odpowiedni sposób generowania składników sum!)

P1.7. 9 punktów Funkcja cosinus ma następujące rozwinięcie w szereg potęgowy, zbieżne dla każdej wartości x :

$$\cos x = \sum_{k=0}^{\infty} (-1)^k \frac{x^{2k}}{(2k)!}.$$

Przybliżoną wartość $\cos x$ można otrzymać jako wartość wielomianu

$$c_{2n}(x) = \sum_{k=0}^n (-1)^k \frac{x^{2k}}{(2k)!}.$$

- Wykonaj obliczenia w arytmetyce z pojedynczą precyzją dla $n = 0, 1, 2, \dots, 12$ oraz dla wybranych wartości x z przedziału $[0, 10]$.
- Sporządź wykresy wielomianów c_2, c_4, \dots, c_{24} w tym przedziale.
- Skomentuj wyniki.

P1.8. 10 punktów Stałą Eulera $\gamma = 0.577215664901532286\dots$ definiujemy jako granicę $\gamma := \lim_{n \rightarrow \infty} \gamma_n$, gdzie $\gamma_n := 1 + \frac{1}{2} + \frac{1}{3} + \dots + \frac{1}{n} - \ln n$. Zakładając, że dla dostatecznie dużych wartości n jest $\gamma_n - \gamma \approx cn^{-d}$, gdzie c i $d > 0$ są pewnymi stałymi, spróbuj przy pomocy komputera wyznaczyć doświadczalnie wartości tych stałych.

P1.9. 7 punktów Wiadomo, że $\pi = 4 \lim_{n \rightarrow \infty} s_n$, gdzie $s_n := \sum_{k=0}^n (-1)^k (2k+1)^{-1}$. Oblicz w arytmetyce z podwyższoną precyzją wartości s_n dla $n = 10^7$, sumując składniki w porządku: a) naturalnym, b) odwrotnym. Oblicz błędy $|4.0 \times fl(s_n) - \pi|$.

P1.10. 10 punktów Rozważmy iteracyjny algorytm Molera-Morrisona obliczania wartości $\sqrt{a^2 + b^2}$,

```

p := max(|a|, |b|);
q := min(|a|, |b|);
while (wartość q jest znacząca) do
    r := (q/p)^2;
    s := r/(4+r);
    p := p + 2 * s * p;
    q := s * q;
end
return p;
```

Przetestuj powyższy algorytm dla kilku wybranych par (a, b) , m.in. dla: $(3, 4)$, $(-5, 12)$ i $(7, -24)$. Jakie zalety ma podany algorytm w porównaniu z metodą bezpośrednią (wykorzystującą funkcję biblioteczną `sqr`)? Ile iteracji potrzeba, aby w praktyce uzyskać zadowalające rezultaty?

Wykorzystując powyższy algorytm, zaproponuj metodę obliczania normy euklidesowej dowolnego wektora $\mathbf{x} := \langle x_1, x_2, \dots, x_n \rangle$, tzn. $\|\mathbf{x}\| = \sqrt{\sum_{i=1}^n x_i^2}$.

P1.11. 11 punktów Niech $\{s_n\}$ będzie ciągiem zbieżnym do granicy s . Ciąg Δ^2 Aitkena

$$t_n = \frac{s_n s_{n+2} - s_{n+1}^2}{s_{n+2} - 2s_{n+1} + s_n} \quad (n = 0, 1, \dots)$$

jest w wielu wypadkach zbieżny do s szybciej niż $\{s_n\}$, tzn.

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{t_n - s}{s_n - s} = 0.$$

- Oblicz 20 początkowych wyrazów ciągów $\{s_n\}$ i $\{t_n\}$ oraz $\{e_n := s_n - s\}$ i $\{d_n := t_n - s\}$ w wypadku

- $s_n = \sum_{j=0}^n (-1)^j (2j+1)^{-1}$, $s = \pi/4 \approx 0.7853981634$;

- $s_n = \sum_{k=1}^n k^{-3/2}$, $s \approx 2.612375348685488$.

Czy mamy do czynienia z istotnym przyspieszeniem zbieżności? Powtórz doświadczenie dla innych danych.

- Zauważ, że zbieżność ciągu $\{t_n\}$ można przyspieszyć w analogiczny sposób, definiując ciąg $\{u_n\}$ wzorem

$$u_n = \frac{t_n t_{n+2} - t_{n+1}^2}{t_{n+2} - 2t_{n+1} + t_n} \quad (n = 0, 1, \dots).$$

Korzystając z tej obserwacji wykonaj kilka doświadczeń obliczeniowych, m.in. dla danych z punktu a).

- c) Uogólniając metodę, zaproponuj sposób **przyspieszenia ciągu** $\{u_n\}$. Sprawdź eksperymentalnie jego skuteczność.

P1.12. 10 punktów Ciąg $\{y_n\}$ jest określony wzorem $y_n := \int_0^1 t^n e^t dt$ ($n = 0, 1, \dots$).

- a) Sprawdź, że ciąg $\{y_n\}$ monotonicznie maleje do zera.
 b) Sprawdź, że zachodzi związek $y_{n+1} = e - (n+1)y_n$ ($n = 0, 1, \dots$) i wyznacz wartość początkową y_0 . Korzystając z tego wyniku oblicz w standardowej arytmetyce wyrazy y_0, y_1, \dots, y_N dla $N = 20$. Czy otrzymane wyniki są wiarygodne?
 c) Oto inny sposób realizacji tego samego zadania. Zauważ, że wobec nierówności $\frac{1}{n+1} \leq y_n \leq \frac{e}{n+1}$ (sprawdzić!) ciąg jest wolno zbieżny, więc y_N i y_{N-1} są prawie sobie równe; z równania $y_N = e - N y_{N-1}$ wynika wówczas, że w przybliżeniu jest $y_N = e/(N+1)$. Następnie za pomocą podanego wcześniej związku rekurencyjnego oblicz $y_{N-1}, y_{N-2}, \dots, y_0$. Czy wartość y_0 jest dokładna? A inne wyrazy ciągu? Podsumuj wyniki doświadczeń.

P1.13. 12 punktów Wiadomo, że suma szeregu

$$(4) \quad S_2 := \sum_{k=1}^{\infty} \frac{(-1)^{k+1}}{k^2 + 1}$$

wynosi 0.36398547250893341852488170816398... Spróbuj wyznaczyć wartość tej liczby z dokładnością 10 i 16 cyfr za pomocą sum częściowych szeregu (4). Następnie zauważ, że

$$\frac{\pi^2}{12} - S_2 = \sum_{k=1}^{\infty} \frac{(-1)^{k+1}}{k^2(k^2 + 1)}, \quad S_2 - \frac{\pi^2}{12} + \frac{7\pi^4}{720} = \sum_{k=1}^{\infty} \frac{(-1)^{k+1}}{k^4(k^2 + 1)}$$

i wykorzystaj te związki, aby przyspieszyć obliczenia. Postępując podobnie, zaproponuj efektywny sposób wyznaczania wartości szeregu

$$S_n := \sum_{k=1}^{\infty} \frac{(-1)^{k+1}}{k^n + 1} \quad (n = 2, 4, 6, \dots).$$

P1.14. 7 punktów Niech będzie $\Delta u_k = u_{k+1} - u_k$. Sprawdź, że

$$\sum_{k=1}^n \Delta u_k = u_{n+1} - u_1.$$

Oblicz wartość po lewej stronie powyższej równości z pojedynczą precyzją (**bez żadnych przekształceń wstępnych!**), a wartość po prawej stronie – z podwójną precyzją dla $u_k = \ln(1+k)$ oraz $n = 1000(1000)10000$. Wydrukuj tabelkę różnic między tymi wartościami. Oblicz $\sum_{k=1}^n u_k$ z pojedynczą i podwójną precyzją. Objasnij wyniki.

P1.15. 9 punktów Opracować i sprawdzić na przykładach procedury funkcyjne, obliczające z dokładnością bliską dokładności maszynowej wartości następujących funkcji matematycznych:

$$g_1(x) := x + e^x - e^{3x}, \quad g_2(x) := \log x - 1, \quad g_3(x) := \sqrt{x^2 + 1} - 1.$$

W każdym wypadku zbadać, czy istnieje groźba utraty cyfr znaczących wyniku i – w razie potrzeby – zaproponować sposób uniknięcia groźby.

P1.16. 9 punktów Napisz podprogram obliczający dwa pierwiastki x_1 i x_2 trójkątnu kwadratowego $f(x) = ax^2 + bx + c$ o rzeczywistych współczynnikach a , b i c , jak również wartości $f(x_1)$ i $f(x_2)$. Użyj wzorów redukujących błędy zaokrągleń. Sprawdź działanie podprogramu m.in. dla

$$(a, b, c) = (0, 1, 0), (0, 0, 1), (0, 0, 0), (1, 1, 0), (2, 10, 1), (1, -4, 3.99999), \\ (1, -8.01, 16.004), (2 \times 10^{17}, 10^{18}, 10^{17}), (10^{-17}, -10^{17}, 10^{17}).$$

P1.17. 12 punktów Zapoznaj się z artykułem

— T. J. Dekker, *A floating-point technique for extending the available precision*, Numerische Mathematik 18 (1971), 224–242, DOI: 10.1007/BF01397083¹.

¹ Kopię artykułu można otrzymać od prowadzących pracownię.

Opisz i zrealizuj zaproponowane tam metody wykonywania działań arytmetycznych oraz pierwiastkowania z dużą dokładnością. Zbadaj eksperymentalnie jak sprawdzają się one w praktyce. Następnie opracuj algorytm znajdowania pierwiastków równania kwadratowego z dużą precyzją. *Sztuczka* z wzorami Viète'a nie wystarczy, zadbaj też o odpowiednie obliczanie pierwiastka wyróżnika rozpatrywanego równania.

P1.18. Zadanie dla dwuosobowego zespołu. 11 punktów Wykorzystując jedynie podstawowe działania arytmetyczne (+, −, *, /), zaproponuj efektywny sposób wyznaczania wartości funkcji sinus w **dziedzinie liczb zespolonych** z dokładnością bliską dokładności maszynowej.

P1.19. 8 punktów Zrealizować następujący **variant metody Newtona z nadzorem**. Niech f będzie daną funkcją i niech będą dane takie dwa przybliżenia a i b jej pierwiastka, że $f(a)f(b) < 0$. Jeśli $|f(a)| < |f(b)|$, połóżmy $c := a$; w przeciwnym razie $c := b$. Jeśli jeden krok metody Newtona dla $x_0 := c$ daje wartość x_1 leżącą w przedziale $[a, b]$, przyjmujemy $c := x_1$, w przeciwnym razie kładziemy $c := a + (b - a)/2$ (*co to oznacza?*). Następnie przyjmujemy

$$[a, b] := \begin{cases} [a, c], & \text{jeśli } f(a)f(c) < 0, \\ [c, b], & \text{jeśli } f(a)f(c) \geq 0 \end{cases}$$

i powtarzamy wszystkie opisane wyżej czynności dla aktualnych wartości a i b . Proces kończymy wówczas, gdy $|b - a| < \epsilon$ lub gdy $|f(c)| < \delta$, gdzie ϵ i δ są zadanymi z góry małymi liczbami. Proszę pamiętać o ograniczeniu liczby iteracji, żeby wykluczyć bardzo długie obliczenia!

P1.20. 10 punktów Następujące **varianty metody Newtona**:

$$(5) \quad x_{n+1} := x_n - \frac{2f(x_n)}{f'(x_n) + f'(x_{n+1}^*)} \quad (n = 0, 1, \dots);$$

$$(6) \quad x_{n+1} := x_n - \frac{f(x_n)}{f'(\frac{1}{2}x_n + \frac{1}{2}x_{n+1}^*)} \quad (n = 0, 1, \dots);$$

$$(7) \quad x_{n+1} := x_n - \frac{f(x_n)}{2} \left(\frac{1}{f'(x_n)} + \frac{1}{f'(x_{n+1}^*)} \right) \quad (n = 0, 1, \dots),$$

gdzie

$$x_{n+1}^* := x_n - \frac{f(x_n)}{f'(x_n)},$$

są przy pewnych założeniach zbieżne sześciennie do pojedynczego zera α funkcji f . Porównać liczby iteracji oraz obliczeń wartości funkcji f potrzebnych do wyznaczenia dokładnych 20 cyfr dziesiętnych α – przy użyciu metod (5)–(7) oraz klasycznej metody Newtona. W każdym wypadku wyznaczyć wartość **numerycznego wykładnika zbieżności metody** wg wzoru

$$p \approx \frac{\ln |(x_{n+1} - \alpha)/(x_n - \alpha)|}{\ln |(x_n - \alpha)/(x_{n-1} - \alpha)|} \quad (n - \text{dostatecznie duże}).$$

Sugerowane obliczenia przykładowe dla:

$$\begin{aligned} (a) \quad & f(x) = x^3 + 4x^2 - 10, \quad \alpha = 1.3652300134144\dots; \\ (b) \quad & f(x) = \sin^2 x - x^2 + 1, \quad \alpha = 1.4044916482162\dots; \\ (c) \quad & f(x) = \exp(x^2 + 7x - 30) - 1, \quad \alpha = 3. \end{aligned}$$

P1.21. 9 punktów Rozważmy zadanie wyznaczania miejsca zerowego funkcji nieliniowej w zadanym przedziale $[a, b]$, przy założeniu, że $ab > 0$. Metoda bisekcji konstruuje kolejne podprzedziały obliczając nowy początek lub koniec podprzedziału jako średnią arytmetyczną a_{k-1} i b_{k-1} , gdzie $[a_{k-1}, b_{k-1}]$ jest podprzedziałem wyznaczonym w poprzedniej iteracji. Rozważmy podejście, które różni się od metody bisekcji tym, że zamiast średniej arytmetycznej wykorzystuje średnią geometryczną, tzn. początkiem lub końcem nowego podprzedziału jest $\text{sgn}(a)\sqrt{a_{k-1}b_{k-1}}$. Porównaj obie metody dla $f(x) = (x/2)^2 - \sin x$ w przedziale $[1.8, 2]$, oraz dla kilku innych wybranych przykładów.

P1.22. 11 punktów Wykorzystaj sumę częściową rozwinięcia w szereg Taylora,

$$f(x_n) + hf'(x_n) + \frac{h^2}{2}f''(x_n) = 0, \quad h = x - x_n,$$

dla równania $f(x_n + h) = 0$, aby wyprowadzić metodę iteracyjną Eulera,

$$x_{n+1} = x_n - u(x_n) \frac{2}{1 + \sqrt{1 - 2t(x_n)}},$$

gdzie

$$u(x) = \frac{f(x)}{f'(x)}, \quad t(x) = u(x) \frac{f''(x)}{f'(x)},$$

która służy do rozwiązywania równań nieliniowych. Jakie założenia musi spełniać funkcja f ? Przy dodatkowych założeniach, wykorzystaj odpowiednie przybliżenie, aby otrzymać następującą metodę iteracyjną:

$$x_{n+1} = x_n - u(x_n) \left(1 + \frac{1}{2} t(x_n) \right).$$

Przetestuj obie metody dla kilku wybranych nieliniowych funkcji f .

P1.23. 12 punktów Rozważmy metodę iteracyjną Halleya,

$$(8) \quad x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f'(x_k) - \frac{f''(x_k)}{2f'(x_k)} f(x_k)},$$

oraz metodę iteracyjną quasi-Halleya,

$$(9) \quad x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f'(x_k) - \frac{f'(x_k) - f'(x_{k-1})}{2(x_k - x_{k-1})} f'(x_k)} f(x_k)}.$$

Obie metody służą do rozwiązywania równań nieliniowych.

- a) Pokaż w jaki sposób wykorzystać metodę Newtona do wyprowadzenia wzoru (8).
- b) Jaki jest rząd zbieżności metody Halleya?
- c) Pokaż w jaki sposób wykorzystać wzór (8) do wyprowadzenia wzoru (9).
- d) Jaki jest rząd zbieżności metody quasi-Halleya?

Wybierz kilka przykładów i porównaj obie metody w praktyce.

P1.24. Zadanie dla dwuosobowego zespołu. 12 punktów Ważnym z punktu widzenia zastosowań jest zadanie obliczania wszystkich pierwiastków wielomianu $p_n \in \Pi_n$ o współczynnikach rzeczywistych, czyli takich liczb zespolonych z_1, z_2, \dots, z_n dla których zachodzi

$$p_n(z_i) = 0 \quad (i = 1, 2, \dots, n),$$

gdzie

$$p_n(z) := \sum_{k=0}^n a_k z^k \quad (a_k \in \mathbb{R}, k = 0, 1, \dots, n; a_n \neq 0).$$

Przybliżone wartości pierwiastków z_1, z_2, \dots, z_n można wyznaczyć stosując np. *iteracyjną metodę Bairstowa*, której zwięzły opis został podany m.in. w [1, str. 107], [2, str. 112], [3, str. 384] i [4, str. 293]. Wykonując odpowiednie testy numeryczne, sprawdź pod względem dokładności, skuteczności i stabilności powyższą metodę.

Literatura:

- [1] W. Cheney, D. Kincaid, *Analiza numeryczna*, WNT, 2006.
- [2] M. Dryja, J. i M. Jankowscy, *Przegląd metod i algorytmów numerycznych*, cz. 2, WNT, 1988.
- [3] A. Ralston, *Wstęp do analizy numerycznej*, PWN, 1971.
- [4] J. Stoer, R. Bulirsch, *Wstęp do analizy numerycznej*, PWN, 1987.