

Métodos Numéricos I

Tema 4:Aproximación

Miguel A. Piñar
Departamento de Matemática Aplicada
Facultad de Ciencias
Universidad de Granada

19 de mayo de 2022

Introducción

- Problema de aproximación

- Producto escalar

Aproximación por mínimos cuadrados

- Existencia y unicidad de la mejor aproximación

- Mejor aproximación por m. c. continua y discreta

- Bases ortogonales. Polinomios ortogonales

Polinomios de Hermite, Laguerre, Jacobi

- Polinomios de Jacobi

- Polinomios de Laguerre

- Polinomios de Hermite

A veces, los datos de un cierto problema presentan **errores de medida** que hacen que los datos se presenten en forma de **nube de puntos** con una forma determinada (recta, parábola, exponencial, sinusoidal,...), pero no están sobre ella.

La interpolación en este caso pierde sentido, pues una función que pase por todos los datos del problema no siempre reproduce la forma exacta de la función original.

Problema de aproximación

Dados N puntos $\{(x_1, y_1), (x_2, y_2), \dots, (x_N, y_N)\}$, el problema de **aproximar (ajustar)** dichos puntos consiste en encontrar una función $g(x)$, con unas ciertas condiciones, que esté **lo más cerca posible** de los puntos.

Esto es, se busca una función $g(x)$ que **minimice la distancia** a los puntos (x_i, y_i) , $i = 0, 1, \dots, n$.

Problema de aproximación

Dados N puntos $\{(x_1, y_1), (x_2, y_2), \dots, (x_N, y_N)\}$, el problema de **aproximar (ajustar)** dichos puntos consiste en encontrar una función $g(x)$, con unas ciertas condiciones, que esté **lo más cerca posible** de los puntos.

Esto es, se busca una función $g(x)$ que **minimice la distancia** a los puntos (x_i, y_i) , $i = 0, 1, \dots, n$.

Gráficamente, esta condición significa que la curva que representa a $g(x)$ está **lo más cerca posible** de los puntos $\{(x_0, y_0), (x_1, y_1), \dots, (x_n, y_n)\}$.

Buscamos funciones $g(x)$ que posean ciertas propiedades:

- ▶ fácil de implementar,
- ▶ fácil de evaluar,
- ▶ simple de calcular,
- ▶ suficientemente regular,
- ▶ ...

Buscamos funciones $g(x)$ que posean ciertas propiedades:

- ▶ fácil de implementar,
- ▶ fácil de evaluar,
- ▶ simple de calcular,
- ▶ suficientemente regular,
- ▶ ...

¿ Cómo se formalizan los conceptos de aproximación, distancia, ... ?

Sea V un espacio vectorial. Un **producto escalar** es una función

$$\begin{aligned}\langle \cdot, \cdot \rangle : V \times V &\longrightarrow \mathbb{R} \\ (v, w) &\longrightarrow \langle v, w \rangle\end{aligned}$$

- (i) $\langle v, v \rangle \geq 0, \quad \forall v \in V,$
- (ii) $\langle v, w \rangle = \langle w, v \rangle, \quad \forall v, w \in V,$
- (iii) $\langle \alpha v + \beta w, z \rangle = \alpha \langle v, z \rangle + \beta \langle w, z \rangle, \forall \alpha, \beta \in \mathbb{R}, \forall v, w, z \in V,$
- (iv) $\langle v, v \rangle = 0 \iff v = 0.$

Un espacio vectorial V en el que se ha definido un producto escalar se llama **espacio con producto escalar**.

Definición

Todo producto escalar induce una norma, definida en la forma

$$\|v\| = \sqrt{\langle v, v \rangle}.$$

Definición

Todo producto escalar induce una norma, definida en la forma

$$\|v\| = \sqrt{\langle v, v \rangle}.$$

Todo espacio con producto escalar es normado, y, por tanto es métrico, con la distancia

$$d(v, w) := \|v - w\| = \sqrt{\langle v - w, v - w \rangle}.$$

Sea V un espacio con producto escalar y $U \subset V$ un subconjunto de V . Sea $f \in V$. Se dice que $u \in U$ es una **mejor aproximación** de f en U si u minimiza la distancia, esto es,

$$d(f, u) = d(f, U) = \inf\{d(f, w) / w \in U\}.$$

Cuestiones

- ▶ Existencia de mejor aproximación, **(no siempre existe)**
- ▶ Unicidad, **(si existe, no siempre es única)**

Mejor aproximación por mínimos cuadrados



Sea V un **espacio con producto escalar** y $U \subset V$ un subconjunto de V . En este caso,

$$d(f, w) = \|f - w\| = \sqrt{\langle f - w, f - w \rangle}.$$

Para calcular la mejor aproximación, se quiere **minimizar**, si es posible,

$$\{d(f, w)/w \in U\} = \{\sqrt{\langle f - w, f - w \rangle}/w \in U\}.$$

Para evitar el uso de raíces cuadradas, **la expresión anterior es equivalente a minimizar**

$$\{d(f, w)^2/w \in U\} = \{\langle f - w, f - w \rangle/w \in U\}.$$

De este modo, el problema se llama en este caso, **problema de aproximación por mínimos cuadrados**.

Mejor aproximación por mínimos cuadrados en subespacios de dimensión finita



Ortogonalidad

Se dice que $v, w \in V$ son **ortogonales** si

$$\langle v, w \rangle = 0.$$

Mejor aproximación por mínimos cuadrados en subespacios de dimensión finita



Ortogonalidad

Se dice que $v, w \in V$ son **ortogonales** si

$$\langle v, w \rangle = 0.$$

Teorema

Sea V un espacio con producto escalar, y U un subespacio de V . Dada $f \in V$, un elemento $u \in U$ es **mejor aproximación de f en U si y sólo si**

$$\langle f - u, w \rangle = 0, \quad \forall w \in U.$$

Teorema

Sea V un espacio con producto escalar, y U un subespacio de dimensión finita, entonces **la mejor aproximación existe y es única.**

Teorema

Sea V un espacio con producto escalar, y U un subespacio de dimensión finita, entonces **la mejor aproximación existe y es única**.

Buscamos un elemento $u \in U = L\langle\varphi_0, \varphi_1, \varphi_2, \dots, \varphi_m\rangle$, la envolvente lineal. De este modo,

$$u = a_0 \varphi_0 + a_1 \varphi_1 + \dots + a_m \varphi_m = \sum_{k=0}^m a_k \varphi_k,$$

y debemos hallar los coeficientes a_0, a_1, \dots, a_m .

Teorema

Sea V un espacio con producto escalar, y U un subespacio de dimensión finita, entonces **la mejor aproximación existe y es única**.

Buscamos un elemento $u \in U = L\langle\varphi_0, \varphi_1, \varphi_2, \dots, \varphi_m\rangle$, la envolvente lineal. De este modo,

$$u = a_0 \varphi_0 + a_1 \varphi_1 + \dots + a_m \varphi_m = \sum_{k=0}^m a_k \varphi_k,$$

y debemos hallar los coeficientes a_0, a_1, \dots, a_m .

$$0 = \langle f - u, w \rangle = \langle f, w \rangle - \langle u, w \rangle, \quad \forall w \in U.$$

De este modo, se tiene

$$\left\langle \sum_{k=0}^m a_k \varphi_k, \varphi_i \right\rangle = \langle f, \varphi_i \rangle, \quad i = 0, 1, \dots, m.$$

La expresión anterior es un sistema de $m+1$ ecuaciones

$$\begin{array}{rcl} a_0 \langle \varphi_0, \varphi_0 \rangle + a_1 \langle \varphi_1, \varphi_0 \rangle + \dots + a_m \langle \varphi_m, \varphi_0 \rangle & = & \langle f, \varphi_0 \rangle \\ a_0 \langle \varphi_0, \varphi_1 \rangle + a_1 \langle \varphi_1, \varphi_1 \rangle + \dots + a_m \langle \varphi_m, \varphi_1 \rangle & = & \langle f, \varphi_1 \rangle \\ \dots & & \dots \\ a_0 \langle \varphi_0, \varphi_m \rangle + a_1 \langle \varphi_1, \varphi_m \rangle + \dots + a_m \langle \varphi_m, \varphi_m \rangle & = & \langle f, \varphi_m \rangle \end{array}$$

con incógnitas a_0, a_1, \dots, a_m .

La matriz de coeficientes del sistema anterior

$$\mathbf{G} = \begin{pmatrix} \langle \varphi_0, \varphi_0 \rangle & \langle \varphi_1, \varphi_0 \rangle & \cdots & \langle \varphi_m, \varphi_0 \rangle \\ \langle \varphi_0, \varphi_1 \rangle & \langle \varphi_1, \varphi_1 \rangle & \cdots & \langle \varphi_m, \varphi_1 \rangle \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \langle \varphi_0, \varphi_m \rangle & \langle \varphi_1, \varphi_m \rangle & \cdots & \langle \varphi_m, \varphi_m \rangle \end{pmatrix}$$

se denomina **matriz de Gram** y es simétrica y definida positiva, y, por tanto, el sistema tiene solución única.

Ejemplo 1



13

Calcular la mejor aproximación de la función x^3 en \mathcal{P}_1 utilizando el producto escalar

$$\langle v, w \rangle = \int_{-1}^1 v(x)w(x)dx.$$

En este caso, $U = \mathcal{P}_1$, cuya dimensión es finita. Una base para este espacio puede ser $\{1, x\}$, esto es, $\varphi_0 = 1$, y $\varphi_1 = x$. La mejor aproximación será $u = a_0\varphi_0 + a_1\varphi_1 = a_0 + a_1x$, donde a_0 y a_1 son la solución del sistema:

$$\begin{aligned}\langle 1, 1 \rangle a_0 + \langle x, 1 \rangle a_1 &= \langle x^3, 1 \rangle \\ \langle 1, x \rangle a_0 + \langle x, x \rangle a_1 &= \langle x^3, x \rangle\end{aligned}$$

- ▶ Estudiar la distancia inducida por el “producto escalar”

$$\langle f, g \rangle = \sum_{i=0}^n \omega_i f(x_i) g(x_i),$$

donde x_0, x_1, \dots, x_n son números reales y $\omega_i > 0$ para $i = 0, 1, \dots, n$.

- ▶ Estudiar la distancia inducida por el producto escalar

$$\langle f, g \rangle = \int_a^b f(x) g(x) \omega(x) dx,$$

donde $[a, b]$ es un intervalo real y ω es una función integrable verificando $\omega(x) \geq 0$ para todo $x \in [a, b]$.

Ejemplo 1



15

Los productos escalares son:

$$\begin{aligned}\langle 1, 1 \rangle &= \int_{-1}^1 dx = 2, & \langle x, 1 \rangle &= \langle x, 1 \rangle = \langle x^3, 1 \rangle = 0, \\ \langle x, x \rangle &= \int_{-1}^1 x^2 dx = \frac{2}{3}, & \langle x^3, x \rangle &= \int_{-1}^1 x^4 dx = \frac{2}{5}.\end{aligned}$$

De este modo, el sistema queda

$$\begin{aligned}2a_0 &= 0 \\ \frac{2}{3}a_1 &= \frac{2}{5}\end{aligned}$$

cuya solución es $a_0 = 0$ y $a_1 = 3/5$. La recta de mínimos cuadrados es $u = 3/5x$.

Calcular la recta que mejor aproxima por mínimos cuadrados los datos $(1, 0), (2, 1), (3, 2), (4, 3), (5, 4)$

En este caso, una base de $U = \mathcal{P}_1$ es $\{1, x\}$, y el producto escalar es

$$\langle v, w \rangle = v(1)w(1) + v(2)w(2) + v(3)w(3) + v(4)w(4) + v(5)w(5).$$

No tenemos la expresión analítica de la función $f(x)$ que queremos aproximar. Sin embargo, conocemos los valores de esta función en ciertos puntos: $f(1) = 0, f(2) = 1, f(3) = 2, f(4) = 3, f(5) = 4$.

Ejemplo 2



La mejor aproximación será $u = a_0\varphi_0 + a_1\varphi_1 = a_0 + a_1x$, donde a_0 y a_1 son la solución del sistema:

$$\langle 1, 1 \rangle a_0 + \langle x, 1 \rangle a_1 = \langle f, 1 \rangle$$

$$\langle 1, x \rangle a_0 + \langle x, x \rangle a_1 = \langle f, x \rangle$$

Los productos escalares son:

$$\langle 1, 1 \rangle = 5,$$

$$\langle x, 1 \rangle = \langle x, x \rangle = 1 \cdot 1 + 2 \cdot 1 + 3 \cdot 1 + 4 \cdot 1 + 5 \cdot 1 = 15,$$

$$\langle x, x \rangle = 1 \cdot 1 + 2 \cdot 2 + 3 \cdot 3 + 4 \cdot 4 + 5 \cdot 5 = 55,$$

$$\langle f, 1 \rangle = 0 \cdot 1 + 1 \cdot 1 + 2 \cdot 1 + 3 \cdot 1 + 4 \cdot 1 = 10,$$

$$\langle f, x \rangle = 0 \cdot 1 + 1 \cdot 2 + 2 \cdot 3 + 3 \cdot 4 + 4 \cdot 5 = 40.$$

Ejemplo 2



De este modo, el sistema queda

$$\begin{aligned}5a_0 + 15a_1 &= 10, \\15a_0 + 55a_1 &= 40,\end{aligned}$$

cuya solución es $a_0 = -1$ y $a_1 = 1$. La recta de mínimos cuadrados es $u = -1 + x$.

Atendiendo al tipo de producto escalar

- **Aproximación por mínimos cuadrados continua**

$$\langle f, g \rangle = \int_a^b f(x)g(x)w(x)dx,$$

donde $w(x)$ es una **función peso**: $w(x) \geq 0, \forall x \in [a, b]$.

- **Aproximación por mínimos cuadrados discreta**

$$\langle f, g \rangle = \sum_{i=0}^n f(x_i)g(x_i)w(x_i),$$

donde x_0, x_1, \dots, x_n son nodos fijos, y $w_i > 0, i = 0, 1, \dots, n$, son los **pesos**.

Si la base del subespacio U es ortogonal, esto es,

$$\langle \tilde{\varphi}_i, \tilde{\varphi}_j \rangle = 0, \quad i \neq j,$$

el sistema de ecuaciones se convierte en diagonal:

$$\langle \tilde{\varphi}_k, \tilde{\varphi}_k \rangle a_k = \langle f, \tilde{\varphi}_k \rangle, \quad k = 0, 1, \dots, m.$$

Por tanto

$$a_k = \frac{\langle f, \tilde{\varphi}_k \rangle}{\langle \tilde{\varphi}_k, \tilde{\varphi}_k \rangle} \quad k = 0, 1, \dots, m.$$

y la mejor aproximación se calcula en la forma

$$u = \sum_{k=0}^m \frac{\langle f, \tilde{\varphi}_k \rangle}{\langle \tilde{\varphi}_k, \tilde{\varphi}_k \rangle} \tilde{\varphi}_k.$$

Suma de Fourier

A la expresión

$$u = \sum_{k=0}^m \frac{\langle f, \tilde{\varphi}_k \rangle}{\langle \tilde{\varphi}_k, \tilde{\varphi}_k \rangle} \tilde{\varphi}_k.$$

se le llama **m -ésima suma de Fourier** de f asociada a la base ortogonal $\{\tilde{\varphi}_0, \tilde{\varphi}_1, \dots, \tilde{\varphi}_m\}$.

A la cantidad

$$a_k = \frac{\langle f, \tilde{\varphi}_k \rangle}{\langle \tilde{\varphi}_k, \tilde{\varphi}_k \rangle} \quad k = 0, 1, \dots, m.$$

se le denomina **k -ésimo coeficiente de Fourier** de f asociado a la base ortogonal $\{\tilde{\varphi}_0, \tilde{\varphi}_1, \dots, \tilde{\varphi}_m\}$.

Algoritmo de Gram–Schmidt

Si $\{\varphi_0, \varphi_1, \dots, \varphi_m\}$ es una base dada de U , es posible obtener una base ortogonal $\{\tilde{\varphi}_0, \tilde{\varphi}_1, \dots, \tilde{\varphi}_m\}$ en la forma:

$$\begin{aligned}\tilde{\varphi}_0 &= \varphi_0 \\ \tilde{\varphi}_k &= \varphi_k - \sum_{j=0}^{k-1} \frac{\langle \varphi_k, \tilde{\varphi}_j \rangle}{\langle \tilde{\varphi}_j, \tilde{\varphi}_j \rangle} \tilde{\varphi}_j, \quad k = 1, 2, \dots, m.\end{aligned}$$

Consecuencia: Las bases ortogonales existen siempre.

Dado un producto escalar (continuo o discreto), $\langle \cdot, \cdot \rangle$, una familia de polinomios $\{P_n(x)\}_{n \geq 0}$ se dice que es una **sucesión de polinomios ortogonales** (SPO) si verifica:

(i) grado $P_n = n$, $n \geq 0$,

(ii) $\langle P_n, P_m \rangle = 0$, $n \neq m$.

De este modo, $\{P_0, P_1, \dots, P_m\}$ es una base de \mathbb{P}_m , $m \geq 0$.

Dado un producto escalar (continuo o discreto), $\langle \cdot, \cdot \rangle$, una familia de polinomios $\{P_n(x)\}_{n \geq 0}$ se dice que es una **sucesión de polinomios ortogonales** (SPO) si verifica:

- (i) grado $P_n = n$, $n \geq 0$,
- (ii) $\langle P_n, P_m \rangle = 0$, $n \neq m$.

De este modo, $\{P_0, P_1, \dots, P_m\}$ es una base de \mathbb{P}_m , $m \geq 0$.

Una **sucesión de polinomios ortogonales mónica** (coeficiente líder 1) puede obtenerse aplicando el algoritmo de Gram-Schmidt a la base de \mathbb{P}_m

$$\{1, x, x^2, \dots, x^m\}$$

Dado un producto escalar (continuo o discreto), $\langle \cdot, \cdot \rangle$, una familia de polinomios $\{P_n(x)\}_{n \geq 0}$ se dice que es una **sucesión de polinomios ortogonales** (SPO) si verifica:

- (i) grado $P_n = n$, $n \geq 0$,
- (ii) $\langle P_n, P_m \rangle = 0$, $n \neq m$.

De este modo, $\{P_0, P_1, \dots, P_m\}$ es una base de \mathbb{P}_m , $m \geq 0$.

Una **sucesión de polinomios ortogonales mónica** (coeficiente líder 1) puede obtenerse aplicando el algoritmo de Gram-Schmidt a la base de \mathbb{P}_m

$$\{1, x, x^2, \dots, x^m\}$$

Las **sucesiones de polinomios ortogonales** son únicas salvo constante multiplicativa.

Teorema

Dado un producto escalar (continuo o discreto), $\langle \cdot, \cdot \rangle$, y sea $\{P_n\}_{n \geq 0}$ la correspondiente **SPOM** (sucesión de polinomios ortogonales mónicos), entonces existen $\{c_n\}_{n \geq 0}$ y $\{\lambda_n\}_{n \geq 1}$, con $\lambda_n > 0 \quad \forall n$, tales que

$$P_{n+1}(x) = (x - c_{n+1})P_n(x) - \lambda_{n+1}P_{n-1}(x).$$

$\forall n \geq 0$. $P_{-1}(x) = 0$, $P_0(x) = 1$. En particular

$$c_{n+1} = \frac{\langle xP_n(x), P_n(x) \rangle}{\langle P_n(x), P_n(x) \rangle}$$
$$\lambda_{n+1} = \frac{\langle P_n(x), P_n(x) \rangle}{\langle P_{n-1}(x), P_{n-1}(x) \rangle}$$



K. G. J. Jacobi (1804–1851)

Se obtienen como la familia de polinomios ortogonales asociados a la función de peso dada por

$$\omega(x) = (1-x)^{\alpha}(1+x)^{\beta},$$

en $[-1, 1]$ y verificando $\alpha, \beta > -1$.

Denotamos por $P_n^{(\alpha, \beta)}(x)$ a los polinomios de Jacobi, que verifican la condición de normalización

$$P_n^{(\alpha, \beta)}(1) = \binom{n + \alpha}{n}.$$

Presentan como casos particulares a las familias de polinomios de:

- ▶ $\alpha = \beta = -\frac{1}{2}$ (Chebyshev primera especie)
- ▶ $\alpha = \beta = \frac{1}{2}$ (Chebyshev segunda especie)
- ▶ $\alpha = \beta = 0$ (Legendre)
- ▶ $\alpha = \beta$ (Gegenbauer o ultraesféricos)

Coeficiente líder

$$P_n^{(\alpha, \beta)}(x) = \frac{(n + \alpha + \beta + 1)_n}{2n!} x^n + \dots$$

► Fórmula de Rodrigues

$$P_n^{(\alpha, \beta)}(x) = \frac{(-1)^n}{2^n n!} (1-x)^{-\alpha} (1+x)^{-\beta} D^n((1-x)^{n+\alpha} (1+x)^{n+\beta}) \quad \alpha, \beta > -1$$

► Ortogonalidad

$$\int_{-1}^1 P_n^{(\alpha, \beta)}(x) P_m^{(\alpha, \beta)}(x) (1-x)^\alpha (1+x)^\beta dx = \begin{cases} \tau_n \delta_{mn} & n = m \\ = 0 & n \neq m \end{cases}.$$

$$\tau_n = \frac{2^{\alpha+\beta+1}}{2n + \alpha + \beta + 1} \frac{\Gamma(n + \alpha + 1) \Gamma(n + \beta + 1)}{\Gamma(n + \alpha + \beta + 1) n!}$$

► Fórmula de recurrencia

$$\begin{aligned} xP_n^{(\alpha,\beta)}(x) &= \frac{2(n+1)(n+\alpha+\beta+1)}{(2n+\alpha+\beta+1)(2n+\alpha+\beta+2)}P_{n+1}^{(\alpha,\beta)}(x) \\ &+ \frac{\beta^2 - \alpha^2}{(2n+\alpha+\beta)(2n+\alpha+\beta+2)}P_n^{(\alpha,\beta)}(x) \\ &+ \frac{2(n+\alpha)(n+\beta)}{(2n+\alpha+\beta)(2n+\alpha+\beta+1)}P_{n-1}^{(\alpha,\beta)}(x) \end{aligned}$$

Polinomios de Laguerre



E. N. Laguerre (1834–1886)

Se obtienen para la función de peso $\omega(x) = x^\alpha e^{-x}$ en $[0, \infty)$ con $\alpha > -1$. Los correspondientes momentos existen y verifican

$$\int_0^{+\infty} x^n x^\alpha e^{-x} dx = \int_0^\infty x^{n+\alpha} e^{-x} dx = \Gamma(n + \alpha)$$

Notemos por $\{L_n^{(\alpha)}(x)\}_{n \geq 0}$ a los polinomios de Laguerre con coeficiente líder $L_n^{(\alpha)}(x) = \frac{(-1)^n}{n!} x^n + \dots$

► Fórmula de Rodrigues

$$L_n^{(\alpha)}(x) = \frac{1}{n!} x^{-\alpha} e^x D^n (x^{n+\alpha} e^{-x}); \quad \alpha > -1.$$

► Ortogonalidad

$$\int_0^\infty L_m^{(\alpha)}(x) L_n^{(\alpha)}(x) x^\alpha e^{-x} dx = \begin{cases} 0 & n \neq m \\ \frac{\Gamma(n + \alpha + 1)}{n!} \delta_{mn} & n = m \end{cases}$$

► Relación de recurrencia

$$(n+1)L_{n+1}^{(\alpha)}(x) = (2n+\alpha+1-x)L_n^{(\alpha)}(x) - (n+\alpha)L_{n-1}^{(\alpha)}(x).$$



C. Hermite (1822–1901)

Se obtienen para la función peso $\omega(x) = e^{-x^2}$ definida en el intervalo $I = (-\infty, \infty)$.

Para cada $n \in \mathbb{N}$, notaremos por $H_n(x)$ el polinomio ortogonal con respecto a $\omega(x)$ y cuyo coeficiente líder es

$$H_n(x) = 2^n x^n + \dots$$

entonces se verifican las siguientes propiedades.

► Fórmula de Rodrigues

$$H_n(x) = (-1)^n e^{x^2} D^n(e^{-x^2})$$

► Ortogonalidad

$$\int_{-\infty}^{\infty} H_m(x) H_n(x) e^{-x^2} dx = \begin{cases} 2^n n! \sqrt{\pi} \delta_{nm} & n = m \\ 0 & m \neq n \end{cases}$$

► Relación de recurrencia

$$H_n(x) = 2xH_{n-1}(x) - 2nH_{n-2}(x)$$