関数の近似と補間法

山内 仁喬

2022年10月4日

1 線形最小二乗法

次のようなn組みのデータのあてはめ問題を考える:

観測点:
$$t_1, t_2, \ldots, t_n$$
 (1)

測定値:
$$f_1, f_2, \ldots, f_n$$
 (2)

測定値の分散:
$$\sigma_1, \sigma_2, \ldots, \sigma_n$$
 (3)

測定の誤差 $(分散)\sigma_i^2$ は、測定値 f_i の信頼性を表す尺度として考えることができる.このデータを、ある一次独立な関数系

$$\phi_1(t), \ \phi_2(t), \ \dots, \ \phi_m(t) \tag{4}$$

の一次結合

$$f(t) = \sum_{j=0}^{m} x_j \phi_j(t) \tag{5}$$

によってあてはめる。この形の f(t) は $\{\phi_j(t)\}$ に関して線形であるから,線形モデルと呼ばれる.一次独立な関数系として,単項式

$$\phi_i(t) = t^{j-1} \tag{6}$$

が最も広く採用されている.

最小二乗法は,

$$S(x_1, x_2, \dots, x_m) = \sum_{i=1}^{n} \frac{[f_i - f(t_i)]^2}{\sigma_i^2}$$
 (7)

$$= \sum_{i=1}^{n} \frac{[f_i - \sum_{j=1}^{n} x_j \phi_j(t_i)]^2}{\sigma_i^2}$$
 (8)

を最小にすることによって、未知係数 x_1, \ldots, x_m の組みを決定する方法である. S を最小にする条件は、

$$\frac{\partial S}{\partial x_k} = 0, \quad k = 1, 2, \dots, m \tag{9}$$

によって与えられるので,

$$\sum_{i=1}^{n} \frac{[f_i - \sum_{j=1}^{n} x_j \phi_j(t_i)] \phi_k(t_i)}{\sigma_i^2} = 0, \quad k = 1, 2, \dots, m$$
 (10)

とかける. ここでi, j成分が

$$A_{ij} = \frac{\phi_j(t_j)}{\sigma_i}, \quad (i = 1, 2, \dots, n, \ j = 1, 2, \dots, m)$$
 (11)

で定義される $n \times m$ 行列を導入する. この A_{ij} はヤコビアン行列あるいは計画行列と呼ばれている. このとき、式 (10) は

$$\sum_{i=1}^{n} \sum_{j=1}^{m} \frac{\phi_j(t_i)}{\sigma_i} \frac{\phi_k(t_i)}{\sigma_i} = \sum_{j=1}^{n} \frac{\phi_k(t_i)}{\sigma_i} \frac{f_i}{\sigma_i}$$
(12)

$$\to \sum_{j=1}^{m} \left(\sum_{i=1}^{n} A_{ik} A_{ij} \right) x_j = \sum_{i=1}^{n} A_{ik} \frac{f_i}{\sigma_i}, \quad (k = 1, 2, \dots, m)$$
 (13)

となる. さらに

$$b_i = \frac{f_i}{\sigma_i}, \quad (i = 1, 2, \dots, n)$$

$$\tag{14}$$

を第i 成分にもつベクトル b, x_j を第j 成分にもつベクトルをx とおくと, 式(13) は次のようにかける:

$$A^t A \boldsymbol{x} = A^t \boldsymbol{b} \tag{15}$$

ここで, A^t は行列 A の転置である. これを正規方程式という. この方程式を解けば, 未知係数 x_i を求めることができる.

1.1 単純な多項式 $\phi_i(t)=t^{j-1}$ の場合

単純な多項式 $\phi_j(t)=t^{j-1}$ を用いた、最小二乗法を考える.

$$f(t) = \sum_{j=1}^{m} x_j t^{j-1} = x_1 + x_2 t + \dots + x_m t^{m-1},$$
(16)

$$A_{ij} = \frac{t_i^{j-1}}{\sigma_i},\tag{17}$$

$$A_{ik} = \frac{t_i^{k-1}}{\sigma_i},\tag{18}$$

$$b_i = \frac{f_i}{\sigma_i} \tag{19}$$

であるので、式 (13) に代入すると、

$$\sum_{j=1}^{m} \left(\sum_{i=1}^{n} \frac{t_i^{k-1}}{\sigma_i} \frac{t_i^{j-1}}{\sigma_i} \right) x_j = \sum_{i=1}^{n} \frac{t_i^{k-1}}{\sigma_i} \frac{f_i}{\sigma_i}$$
 (20)

を得る. 行列形式で愚直に書くと,

$$\begin{bmatrix} \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{0} t_{i}^{0} & \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{0} t_{i}^{1} & \cdots & \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{0} t_{i}^{m-1} \\ \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{1} t_{i}^{0} & \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{1} t_{i}^{1} & \cdots & \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{1} t_{i}^{m-1} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{m} t_{i}^{0} & \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{m} t_{i}^{1} & \cdots & \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{m} t_{i}^{m-1} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_{0} \\ x_{1} \\ \vdots \\ x_{m} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} f_{i} \\ \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} f_{i} t_{i} \\ \vdots \\ \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} f_{i} t_{i} \end{bmatrix}$$

$$(21)$$

となる. 左辺の左の行列について、

$$\mathbf{D} = \begin{bmatrix} \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{0} & \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{1} & \dots & \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{m-1} \\ \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{1} & \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{2} & \dots & \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{m} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{m-1} & \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{m} & \dots & \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_{i}^{2}} t_{i}^{2m-1} \end{bmatrix}$$

$$(22)$$

と置くと、正規方程式は

$$\begin{bmatrix} x_0 \\ x_1 \\ \vdots \\ x_m \end{bmatrix} = \mathbf{D}^{-1} \begin{bmatrix} \sum_{i=1}^n \frac{1}{\sigma_i^2} f_i \\ \sum_{i=1}^n \frac{1}{\sigma_i^2} f_i t_i \\ \vdots \\ \sum_{i=1}^n \frac{1}{\sigma_i^2} f_i t_i^{m-1} \end{bmatrix}$$
(23)

$$= \begin{bmatrix} D_{11}^{-1} & D_{12}^{-1} & \dots & D_{1m}^{-1} \\ D_{21}^{-1} & D_{22}^{-1} & \dots & D_{2m}^{-1} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ D_{m1}^{-1} & D_{m2}^{-1} & \dots & D_{mm}^{-1} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_i^2} f_i \\ \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_i^2} f_i t_i \\ \vdots \\ \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_i^2} f_i t_i^{m-1} \end{bmatrix}$$
(24)

$$= \begin{bmatrix} D_{11}^{-1} \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_i^2} f_i + D_{12}^{-1} \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_i^2} f_i t_i + \dots + D_{1m}^{-1} \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_i^2} f_i t_i^{m-1} \\ D_{21}^{-1} \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_i^2} f_i + D_{22}^{-1} \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_i^2} f_i t_i + \dots + D_{2m}^{-1} \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_i^2} f_i t_i^{m-1} \\ \vdots \\ D_{m1}^{-1} \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_i^2} f_i + D_{m2}^{-1} \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_i^2} f_i t_i + \dots + D_{mm}^{-1} \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_i^2} f_i t_i^{m-1} \end{bmatrix}$$
 (25)

のように解くことができる. また, 係数の誤差は,

$$\sigma_{xk} = \sqrt{\sum_{i=1}^{n} \left(\frac{\partial x_k}{\partial f_i} \sigma_i\right)^2}$$
 (26)

であるので、式 (25) を用いると具体的に

$$\sigma_{xk} = \sqrt{\sum_{i=1}^{n} \left(\sum_{j=1}^{m} D_{kj}^{-1} \frac{1}{\sigma_i} t_i^{j-1}\right)^2}$$
 (27)

と計算される.

1.2 具体例: 一次関数 $f(t) = x_0 + x_1 t$ で最小二乗法

一次関数 $f(t)=x_0+x_1t$ で最小二乗法を実行するときの、具体的な未知係数と誤差の表式を見ていく。行列 (22) を具体的に計算すると、

$$D = \begin{bmatrix} \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_i^2} & \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_i^2} t_i \\ \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_i^2} t_i & \sum_{i=1}^{n} \frac{1}{\sigma_i^2} t_i^2 \end{bmatrix} \equiv \begin{bmatrix} \sum_{i=1}^{n} w_i & \sum_{i=1}^{n} w_i t_i \\ \sum_{i=1}^{n} w_i t_i & \sum_{i=1}^{n} w_i t_i^2 \end{bmatrix}$$
(28)

なので、逆行列は

$$\mathbf{D}^{-1} = \frac{1}{\Delta} \begin{bmatrix} \sum_{i=1}^{n} w_i t_i^2 & -\sum_{i=1}^{n} w_i t_i \\ -\sum_{i=1}^{n} w_i t_i & \sum_{i=1}^{n} w_i \end{bmatrix}$$
 (29)

$$\Delta \equiv \left(\sum_{i=1}^{n} w_i\right) \left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i^2\right) - \left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i\right)^2 \tag{30}$$

と計算される.ここで、 $w_i=1/\sigma_i^2$ とおいた.したがって、未知係数は

$$x_0 = \frac{\left(\sum_{i=1}^n w_i t_i^2\right) \left(\sum_{i=1}^n w_i f_i\right) - \left(\sum_{i=1}^n w_i t_i\right) \left(\sum_{i=1}^n w_i t_i f_i\right)}{\Delta}$$
(31)

$$x_{1} = \frac{\left(\sum_{i=1}^{n} w_{i}\right)\left(\sum_{i=1}^{n} w_{i} t_{i} f_{i}\right) - \left(\sum_{i=1}^{n} w_{i} t_{i}\right)\left(\sum_{i=1}^{n} w_{i} f_{i}\right)}{\Lambda}$$
(32)

と計算される.

続いて、係数の誤差を求めていく、 x_0 の誤差は、

$$\sigma_{x_0} = \sqrt{\sum_{i=1}^{n} \left(\frac{\partial x_0}{\partial f_i} \sigma_i\right)^2} \tag{33}$$

である. 以下, 具体的に計算をしていく:

$$\frac{\partial x_0}{\partial f_i} \sigma_i = \frac{1}{\Delta} \left[\left(\sum_{i=1}^n w_i t_i^2 \right) w_i - \left(\sum_{i=1}^n w_i t_i \right) w_i t_i \right] \sigma_i$$
(34)

$$\left(\frac{\partial x_0}{\partial f_i}\sigma_i\right)^2 = \frac{1}{\Delta^2} \left[\left(\sum_{i=1}^n w_i t_i^2\right)^2 w_i^2 + \left(\sum_{i=1}^n w_i t_i\right)^2 w_i^2 t_i^2 - 2\left(\sum_{i=1}^n w_i t_i^2\right) \left(\sum_{i=1}^n w_i t_i\right) w_i^2 t_i \right] \sigma_i^2$$
(35)

$$= \frac{1}{\Delta^2} \left[\left(\sum_{i=1}^n w_i t_i^2 \right)^2 w_i + \left(\sum_{i=1}^n w_i t_i \right)^2 w_i t_i^2 - 2 \left(\sum_{i=1}^n w_i t_i^2 \right) \left(\sum_{i=1}^n w_i t_i \right) w_i t_i \right]$$
(36)

最後の式変形には、 $w_i = 1/\sigma_i^2$ であることを用いた。 さらに、i について和をとると、

$$\sum_{i=1}^{n} \left(\frac{\partial x_0}{\partial f_i} \sigma_i\right)^2$$

$$= \frac{1}{\Delta^2} \left[\left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i^2 \right)^2 \left(\sum_{i=1}^{n} w_i \right) + \left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i \right)^2 \left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i^2 \right) - 2 \left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i^2 \right) \left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i \right)^2 \right]$$

$$= \frac{1}{\Delta^2} \left[\left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i^2 \right)^2 \left(\sum_{i=1}^{n} w_i \right) - \left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i \right)^2 \left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i^2 \right) \right]$$

$$= \frac{\sum_{i=1}^{n} w_i t_i^2}{\Delta^2} \left[\left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i^2 \right) \left(\sum_{i=1}^{n} w_i \right) - \left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i \right)^2 \right]$$

$$= \frac{\sum_{i=1}^{n} w_i t_i^2}{\Delta^2} \left[\left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i^2 \right) \left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i \right) - \left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i \right)^2 \right]$$
(37)

したがって, x_0 の誤差は,

$$\sigma_{x_0} = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^{n} w_i t_i^2}{\Lambda^2}} \tag{38}$$

である.

同様にして, x_1 の誤差,

$$\sigma_{x_1} = \sqrt{\sum_{i=1}^{n} \left(\frac{\partial x_1}{\partial f_i} \sigma_i\right)^2} \tag{39}$$

を計算する.

$$\frac{\partial x_1}{\partial f_i} \sigma_i = \frac{1}{\Delta} \left[\left(\sum_{i=1}^n w_i \right) w_i t_i - \left(\sum_{i=1}^n w_i t_i \right) w_i \right] \sigma_i \tag{40}$$

$$\left(\frac{\partial x_1}{\partial f_i}\sigma_i\right)^2 = \frac{1}{\Delta^2} \left[\left(\sum_{i=1}^n w_i\right)^2 w_i^2 t_i^2 + \left(\sum_{i=1}^n w_i t_i\right)^2 w_i^2 - 2\left(\sum_{i=1}^n w_i\right) \left(\sum_{i=1}^n w_i t_i\right) w_i^2 t_i \right] \sigma_i^2$$
(41)

$$= \frac{1}{\Delta^2} \left[\left(\sum_{i=1}^n w_i \right)^2 w_i t_i^2 + \left(\sum_{i=1}^n w_i t_i \right)^2 w_i - 2 \left(\sum_{i=1}^n w_i \right) \left(\sum_{i=1}^n w_i t_i \right) w_i t_i \right]$$
(42)

最後の式変形には, $w_i=1/\sigma_i^2$ であることを用いた. i について和をとると,

$$\sum_{i=1}^{n} \left(\frac{\partial x_1}{\partial f_i} \sigma_i \right)^2$$

$$= \frac{1}{\Delta^2} \left[\left(\sum_{i=1}^{n} w_i \right)^2 \left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i^2 \right) + \left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i \right)^2 \left(\sum_{i=1}^{n} w_i \right) - 2 \left(\sum_{i=1}^{n} w_i \right) \left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i \right) \left(\sum_{i=1}^{n} w_i t_i \right) \right]$$

$$= \frac{\sum_{i=1}^{n} w_i}{\Delta^2} \left[\left(\sum_{i=1}^{2} w_i \right) \left(\sum_{i=1}^{2} w_i t_i^2 \right) - \left(\sum_{i=1}^{2} w_i t_i \right)^2 \right]$$

$$= \frac{\sum_{i=1}^{n} w_i}{\Delta}$$
(43)

したがって, x_1 の誤差は,

$$\sigma_{x_1} = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n w_i}{\Lambda}} \tag{44}$$

である.

2 スプライン補間

スプライン補間ではデータ点間の区画を補間する関数を決定する際に、関数のつなぎ目において、できるだけ 高次の微分まで滑らかになるように条件を課す.

2.1 3次のスプライン補間

2.1.1 区分多項式

データ点 x_i と x_{i+1} の区間を次の 3 次関数で補間することを考える:

$$S_i(x) = a_i + b_i(x - x_i) + c_i(x - x_i)^2 + d_i(x - x_i)^3, \quad (i = 0, 1, 2, \dots, N - 1)$$
(45)

この式を区分多項式と呼ぶ。N+1 個のデータをつなぐためには、N 個の区分多項式を使用する。データを補間するには、係数 $a_i,\,b_i,\,c_i,\,d_i$ が決める必要がある。未知係数は全部で 4N 個であるので、4N 個の方程式が必要である。そこで、以下の条件を課すことで未知係数を決定するための方程式を得る。

- 1. 各 $S_i(x)$ に対して両端の値が決まっている. つまり、全てのデータ点を通る.
 - (a) 各区間の始点はデータ点の値をとる (N 個の方程式).
 - (b) 隣合う区分多項式は、境界点で同じ値をとる (N 個の方程式).
- 2. 各 $S_i(x)$ について、境界点の一次微分は連続である (N-1 個の方程式).
- 3. 各 $S_i(x)$ について、境界点の二次微分は連続である (N-1 個の方程式).
- 4. 自然なスプラインである条件: 最初と最後のデータ点 (j=0,N+1) において、二次微分がゼロである (2 個の方程式).

区分多項式の一次微分と二次微分はそれぞれ

$$S_i' = b_i + 2c_i(x - x_i) + 3d_i(x - x_i)^2$$
(46)

$$S_i'' = 2c_i + 6d_i(x - x_i) \tag{47}$$

である.

2.1.2 未知係数の決定

条件 1-(a): 各区間の始点はデータ点の値をとる 各区間の始点 $S_i(x_i)$ でデータ点と同じ値であるとすると、

$$S_i(x_i) = y_i$$

すなわち,

$$a_i = y_i \tag{48}$$

を得る.

条件 4: 自然なスプラインである条件 最初と最後のデータ点において, 二次微分がゼロであるので直ちに

$$c_0 = 0 (49)$$

$$c_{N-1} = 0 \tag{50}$$

を得る.

条件 3: 境界点での二次微分の連続性 境界点の二次微分は連続性は

$$S_i''(x_{i+1}) = S_{i+1}''(x_{i+1})$$

とかける. 具体的に計算すると、

$$2c_i + 6d_i(x_{i+1} - x_i) = 2c_{i+1} + 6d_{i+1}(x_{i+1} - x_{i+1})$$

である. これより直ちに

$$d_i = \frac{c_{i+1} - c_i}{3(x_{i+1} - x_i)} = \frac{c_{i+1} - c_i}{3h_i}$$
(51)

を得る. ここで $h_i \equiv x_{i+1} - x_i$ を定義した.

条件 1-(b): 隣合う区分多項式は, 境界点で同じ値をとる この条件を書き下すと

$$S_i(x_{i+1}) = S_{i+1}(x_{i+1}) = y_{i+1}$$

とかける. 具体的に計算すると、

$$a_i + b_i(x_{i+1} - x_i) + c_i(x_{i+1} - x_i)^2 + d_i(x_{i+1} - x_i)^3$$

$$= a_{i+1} + b_{i+1}(x_{i+1} - x_i) + c_{i+1}(x_{i+1} - x_i)^2 + d_{i+1}(x_{i+1} - x_i)^3$$

$$\to a_{i+1} = a_i + b_i h_i + c_i h_i^2 + d_i h_i^3$$

結果を整理すると、

$$b_{i} = \frac{a_{i+1} - a_{i}}{h_{i}} - c_{i}h_{i} - d_{i}h_{i}^{2}$$

$$= \frac{a_{i+1} - a_{i}}{h_{i}} - c_{i}h_{i} - \frac{c_{i+1} - c_{i}}{3h_{i}}h_{i}^{2}$$

$$= \frac{a_{i+1} - a_{i}}{h_{i}} - \frac{h_{i}(c_{i+1} + 2c_{i})}{3}$$
(52)

条件 2: 境界点での一次微分の連続性 この条件を書き下すと

$$S_i'(x_{i+1}) = S_{i+1}'(x_{i+1}) \tag{53}$$

とかける. 具体的に計算すると、

$$b_{i} + 2c_{i}(x_{i+1} - x_{i}) + 3d_{i}(x_{i+1} - x_{i})^{2}$$

$$= b_{i+1} + 2c_{i+1}(x_{i+1} - x_{i}) + 3d_{i+1}(x_{i+1} - x_{i})^{2}$$

$$\rightarrow b_{i+1} = b_{i} + 2c_{i}(x_{i+1} - x_{i}) + 3d_{i}(x_{i+1} - x_{i})^{2}$$

$$\rightarrow b_{i+1} = b_{i} + 2c_{i}h_{i} + 3d_{i}h_{i}^{2}$$

を得る. ここまでに得られた a_i, b_i, d_i の表式を代入すると,

$$\left[\frac{a_{i+2} - a_{i+1}}{h_i} - \frac{h_i(c_{i+2} + 2c_{i+1})}{3} \right] = \left[\frac{a_{i+1} - a_i}{h_i} - \frac{h_i(c_{i+1} + 2c_i)}{3} \right] + 2c_i h_i + 3\left(\frac{c_{i+1} - c_i}{3h_i} \right) h_i^2$$
(54)

となる. さらに整理すると

$$h_{i+1}c_{i+2} + 2(h_{i+1} + h_i)c_{i+1} + c_i h_i = \frac{3}{h_{i-1}}(a_{i+2} - a_{i+1}) - \frac{3}{h_i}(a_{i+1} - a_i)$$

$$= \frac{3}{h_{i-1}}(y_{i+2} - y_{i+1}) - \frac{3}{h_i}(y_{i+1} - y_i)$$
(55)

を得る. この式を行列形式で書くと

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 & 0 \\ h_0 & 2(h_0 - h_1) & h_1 & 0 & 0 & \cdots & 0 & 0 \\ 0 & h_1 & 2(h_1 - h_2) & h_2 & 0 & \cdots & 0 & 0 \\ 0 & 0 & h_2 & 2(h_2 - h_3) & h_3 & 0 & \cdots & 0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & & \vdots & & & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & \cdots & 0 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} c_0 \\ c_1 \\ \vdots \\ c_{N-2} \\ c_{N-1} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ \frac{3}{h_1}(y_2 - y_1) - \frac{3}{h_0}(y_1 - y_0) \\ \vdots \\ \vdots \\ \frac{3}{h_{n-1}}(y_n - y_{n-1}) - \frac{3}{h_i}(y_{n-1} - y_{n-2}) \end{pmatrix}$$

となる. この連立方程式を解くと係数 c_i を決定できる.