

UPPSALA UNIVERSITET

FÖRELÄSNINGSANTECKNINGAR VT22

Beräkningsvetenskap

Rami Abou Zahra

CONTENTS

1. Interpolation	2
1.1. Interpolation med polynom	2
1.2. Numerisk integration	3
1.3. Numerisk kvadratur	3
1.4. Newton-Coates kvadratur	3
1.5. Sammansatta trapetsregeln	4
2. Föreläsning	6
2.1. Trapetsmetoden i python	6
2.2. Simpsons i python	6
2.3. Observation från pythonexempel	6
2.4. Nogrannhetsordning	7
2.5. Feluppskattning	7
2.6. Richardsson-extrapolation	8
3. Förtydligande/Från boken	9
3.1. Integraler	9
3.2. Riemann integralen	9
3.3. Relationen mellan Simpsons och Trapetsapprox.	9
3.4. Analytiskt bevis för feltermen i trapetsmetoden	10
4. Föreläsning	14
4.1. Numerisk integration med scipy	14
4.2. Vad menas med absolut resp. relativt fel?	14
4.3. Funktionsfelet	14
4.4. Nogrannhet - Sammanfattning	14
4.5. Gammal tentauppgift (2009-12-21)	15
5. Icke-linjära ekvationer	16
5.1. Bisektionsmetoden/Intervallhalvering	16
5.2. Newton-Raphson	18
5.3. Gammal tentatal - 2012-04-11	19
6. Forts. Icke-linjära ekvationer	21
6.1. Konvergenshastighet	23
6.2. Konvergens i bisektionsmetoden	23
6.3. Konvergens i Newton-Raphson	23
7. Förtydligande/Från boken	24
7.1. Rötter av polynom	24
8. Forts. Icke-linjära ekvationer	25
8.1. Hybrid-skiss av Newton-Raphson och bisektionsmetoden	25
8.2. Mer om konvergensordning i praktiken	25
8.3. Sekantmetoden	26
9. Ordinära differentialekvationer	28
9.1. Speciella egenskaper för att klassificera ODE:er	28
9.2. Omskrivning till första ordningens ODE	28
9.3. Begynnelsevärdesproblem i SciPy	29
9.4. Eulers metod (explicit Euler)(Euler framåt)	31
9.5. Diskretiseringsfel - Eulers metod	31
10. Ordinära Differentialekvationer - Forts.	32
10.1. Euler bakåt (Implicit euler)	32
10.2. Klassificering av metoder	32
10.3. Exempel på Euler bakåt + Newton	33
10.4. Globala trunkeringsfel (enstegsmetoder)	33

1. INTERPOLATION

Givet n punkter $(x_i, y_i) \in \mathbb{N}$ där alla x_i är olika. Då vill vi anpassa en funktion $p(x)$ till detta data så att den går igenom alla dessa punkter, det vill säga $p(x_i) = y_i \forall i \in \mathbb{N}$. Detta kallas för interpolation.

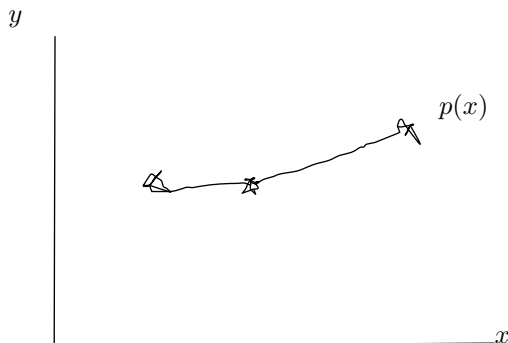


FIGURE 1. Interpolation idé

Vanliga användningsområden kan vara:

- Att läsa mellan raderna i en tabell, även om vi bara har data för $x = 3$ och $x = 2$ så kan vi finna värden för $x = 2.5$
- Anpassa matematisk modell till data.
- Approximera en "svår" funktion, ex. Weierstrass, med en enklare funktion.

1.1. Interpolation med polynom.

- Interpolera alla datapunkter med ett enda polynom:
 - $p_{n-1}(x) = \sum_{i=0}^{n-1} a_i x_i$ där $n - 1$ är polynomgraden

I allmänhet krävs det polynom av grad $n - 1$ för att interpolera n punkter.

Vi sätter in de punkter vi vill lösa i polynomet och löser för koefficienterna. Vi kommer då få ett ekvationssystem.

Ansats med gradtal mindre än $n - 1$ ger generellt ingen interpolationsslösning.

Vid ansats med gradtal högre än $n - 1$ så finns ingen unik lösning.

Läs gärna vidare om Newton interpolation.

- Styckvis polynominterpolation:
 - Anpassar med polynom av låg grad (exvis grad 1 så att den blir linjär) på varje delintervall (mellan varje punkt).
 - $p_k^j(x)$ för $x \in [x_j, x_{j+1}]$ så att $j = 1, \dots, n - 1$ och att punkterna är ordnade så att $x_j < x_{j+1}$. Vanligtvis är $k = 1$ (graden är 1, styckvis linjär) eller $k = 3$ (styckvis kubisk).
 - Vid kubisk interpolation får vi 2 styckna "frihetsgrader", det vill säga x, x^2 . Dessa brukar kombineras med en metod som kallas för *spline* för att ge en kontinuerlig första och andra derivata i hela interpolationen så att kurvan blir mer *smooth*.
 - En annan variant kallas för *pchip* som enbart ger en kontinuerlig första-deriv. Den är monoton mellan datapunkter.

1.2. Numerisk integration.

Problemet som vi vil lösa är att vi förstås vill beräkna integralen av en given funktion:

$$I = \int_a^b f(x)dx$$

Speciellt när det inte går att analytiskt integrera funktionen så blir det som intressantast, eller att det är väldigt svårt, eller då f -värden endast finns som mätvärden i vissa punkter.

1.3. Numerisk kvadratur.

$$I \approx \sum_{i=1}^n w_i f(x_i)$$

Där w_i är "vikter". Då är frågan hur man skall bestämma dessa vikter och vilka punkter x_i som är relevanta att ta med.

Vi gör detta baserat på de interpolerade polynomen och polynom kan vi integrera analytiskt.

1.4. Newton-Coates kvadratur.

Vi väljer x_1, x_2, \dots, x_n värden som ekvi-distanta punkter. Sedan approximeras integralen $\int_a^b f(x)dx$ av $\int_a^b p(x)dx$ där $p(x)$ är polynomet av grad $n - 1$ som interpolerar alla punkter $(x_i, f(x_i)), i = 1, \dots, n$

Exempel: När jag bara har två punkter ($n = 2$) kallas det för *trapetsregeln*:

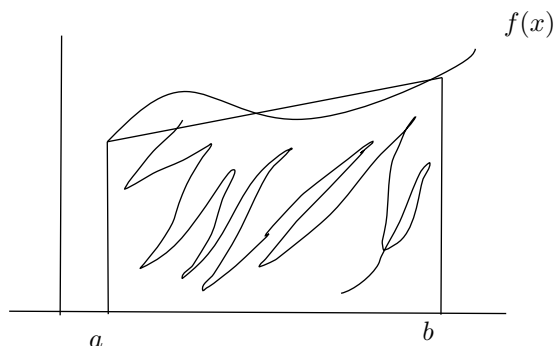


FIGURE 2. Trapetsregeln

En bättre approximering än att använda en första-gradare är simpsons formel ($n = 3$):

Det som kanske verkar rimligt kanske är att ta högre grad, men det som händer är att man får starka oscillationer eftersom ju högre grad desto fler "kupor". Istället tar vi mindre intervall och kör bitvis linjär/simpsons istället.

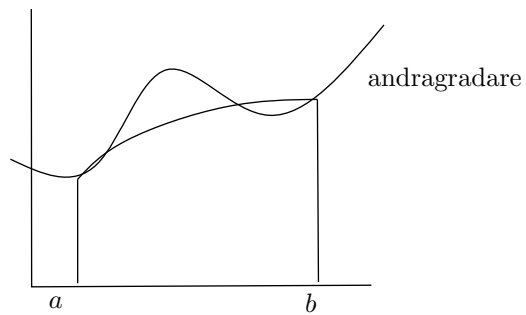


FIGURE 3. Simpsons



FIGURE 4. Exempel: 4 intervall

1.5. Sammansatta trapetsregeln.

Generella trapetsformeln:

$$x_i = a + ih, h = \frac{b-a}{n}$$

$$\int_a^b f(x)dx \approx T(h) = h \left(\sum_{i=0}^n f(x_i) - \frac{f(a) + f(b)}{2} \right)$$

Simpsons formel:

$$x_i = a + ih, h = \frac{b-a}{n}$$

$$\int_a^b f(x)dx \approx S(h) = \frac{h}{3} (f(x_0) + 4f(x_1) + 2f(x_2) + 4f(x_3) + \cdots + 2f(x_{n-2}) + 4f(x_{n-1}) + f(x_n))$$

n måste vara jämn.

2. FÖRELÄSNING

Idag skall vi:

- Implementera trapetsmetoden i python
- Implementera simpsons metod i python
- Hur beror felet på h ($E(h) = I - T(h)$)?
- Är det skillnad p trapets eller simpsons?
- Nogrannhetsordning
- Resultat från anal.
- Konvergensstudie
- Feluppskattning i praktiken.
- Richardsson-extrapolation (ett sätt att förbättra nogrannheten på numeriska kvadraturen)

2.1. Trapetsmetoden i python.

```
import numpy as np

#function = funktionen vi vill integrera
#a = undre integral gräns
#b = övre
#n = antal delintervall

def trapets(func, a, b, n):

    h = (b-a)/n
    x = np.linspace(a, b, n+1) #Gå från a->b med n+1 punkter
    fx = func(x)
    T = h*(np.sum(fx)-(fx[0]+fx[-1])/2)

    return T
```

2.2. Simpsons i python.

```
import numpy as np

#function = funktionen vi vill integrera
#a = undre integral gräns
#b = övre
#n = antal delintervall

def simpsons(func, a, b, n):
    h = (b-a)/n
    x = np.linspace(a,b,n+1)
    fx = func(x)
    S = (h/3)*(fx[0]+4*np.sum(fx[1:-1:2])+2*np.sum(fx[2:-2:2])+fx[-1])

    return S
```

2.3. Observation från pythonexempel.

Vi noterade att i början var trapetsmetoden bättre (mindre fel) än simpsons, men att med finare delintervall så blev simpsons betydligt bättre. Senare tester verifierade följande:

- Trapetsmetoden:
 - Minskning av h med faktor 2 \Rightarrow Minskning av felet med faktor 4
- Simpsons:
 - Minskning av h med faktor 2 \Rightarrow Minskning av fel med faktor 16

2.4. Nogrannhetsordning.

Antag att felet beter sig som Ch^p där C är en konstant, h är steglängden, p är metodens nogrannhetsordning.

Låt $E(h)$ beteckna felet med steglängd h . Då har vi:

$$\begin{aligned} E(h) &= Ch^p \\ E(2h) &= C2^p h^p \\ \frac{E(2h)}{E(h)} &= \frac{2^p Ch^p}{Ch^p} = 2^p \\ p &= \log_2 \frac{E(2h)}{E(h)} \end{aligned}$$

Trapetsmetoden ($\frac{E_T(2h)}{E_T(h)} = 4$) $\Rightarrow p_T = \log_2(4) = 2$, det vill säga nogrannhetsordning 2. Vad vi har gjort nu är uppskattat det med ändligt antal punkter, något som egentligen kräver oändligt antal, och sen har vi dragit en slutsats på detta. Vi säger att *diskretiseringsfelet* (eller *trunkeringsfelet*) är av storleken $O(h^2)$

Simpsons ($\frac{E_S(2h)}{E_S(h)} = 16$) $\Rightarrow p_S = \log_2(16) = 4$, det vill säga nogrannhetsordning 4 och diskretiseringsfelet $= O(h^4)$

Felet kan härledas analytiskt:

$$\text{Låt } I = \int_a^b f(x) dx$$

För trapetsmetoden: $E_T(h) = I - T(h) = -\frac{b-a}{12} h^2 f''(\xi_h)$ för något $\xi \in [a, b]$ eller $E_T(h) = Ch^2 + O(h^4)$

För simpsons: $E_S(h) = I - S(h) = -\frac{b-a}{180} h^4 f^{(4)}(\xi_h)$ för något $\xi_h \in [a, b]$

Exempelvis såg vi att $\int_0^1 x^3 dx$ blev exakt med simpsons, detta beror på att fjärdederivatan av $x^3 = 0$.

2.5. Feluppskattning.

Trapetsregeln ges en härledning av feluppskattningen på följande:

$$\begin{aligned} I_1 &= T(h) + Ch^2 + O(h^4) \\ I_2 &= T(2h) + C(2h)^2 + O(h^4) \\ I_1 - I_2 &= 0 = T(h) - T(2h) + (1 - 2^2)Ch^2 + O(h^4) \\ Ch^2 &= \frac{T(h) - T(2h)}{3} + O(h^4) \end{aligned}$$

Uppskattning av dominerande termen i trunkeringsfelet för $T(h)$. "Tredjedelsregeln". Notera att vi tittar bara i ett ändligt antal punkter, alltså kan vi konstruera en funktion där felet ser ut att vara noll, men i verkliga fallet så kanske felet är jättestort.

2.6. Richardsson-extrapolation.

”Kostar” det något att beräkna detta? Nä, vi har ekvidistanta punkter! Att beräkna ena funktionsvärdet ger den andra.

Vi stoppar in $Ch^2 = \frac{T(h) - T(2h)}{3} + O(h^4)$ i I_1 :

$$I = T(h) + \frac{T(h) - T(2h)}{3} + O(h)$$

Övning: visa att richardsson-extrapolation tillämpat på trapetsmetoden ger simpsons

$$I_1 = Q(h) + Ch^p + O(h^{p+1})$$

$$I_2 = Q(2h) + C(2h)^p + O(h^{p+1})$$

$$Ch^p = \frac{Q(h) - Q(2h)}{2^p - 1} + O(h^{p+1})$$

3. FÖRTYDLIGANDE/FRÅN BOKEN

3.1. Integraler.

Ibland går det inte att lösa integraler analytiskt och då kan vi använda numeriska metoder för att lösa dem. Vi kan göra detta givet hela funktionen, eller så kan vi göra detta givet punkter och där vi senare använder olika metoder för att approximera grafen så att vi kan integrera den. Det finns 2 typer av beräkningsalgoritmer:

- Öppna
 - En väldigt kraftfull typ av öppen integrering är så kallad *Gaussisk kvadratur*. Här uppskattas integralen genom att evaluera den i icke-ekvidistanta punkter och genom att ansätta en ”vikt” vid varje punkt som talar om hur mycket den punkten bidrar.
- Stängda
 - Evaluerar funktion i ändpunkterna av det givna intervallet. Den mest grundläggande algoritmen för detta kallas för *Romberg* integrering vilket är baserat på trapetsidén som man senare har förfinat till Simpsons formula. Romberg integrering är alltså i princip Simpsons, men med lite mer logisk koppling mellan trapetsidén och Simpsons.

3.2. Riemann integralen.

Vi vet från envariabelanalysen att integralens definition ser ut på följande sätt:

$$I = \int_a^b f(x)dx = \lim_{\Delta x \rightarrow 0} \sum_{i=0}^n f(x_i)\Delta x$$

$$\Delta x = \frac{b-a}{n}$$

Detta bildar våra rektanglar som vi sedan summerar deras area över ett intervall. Ett lite bättre sätt att approximera integralen hade varit att om vi istället för att betrakta rektanglar, att vi betraktar trapetsar, det vill säga man ”ansluter” $f(x_i)$ och $f(x_{i+1})$. Arean av en trapets ges av $A = \frac{a+b}{2} \cdot h$. Om vi låter höjden vara Δx och a resp. b ges av funktionsvärdena får vi istället $\frac{f(x_i) + f(x_{i+1}))}{2} \cdot \Delta x = \Delta A$, varpå trapetsformeln kommer ifrån.

Det visar sig att felet som uppstår i trapetsens uppskattning är proportionell mot $\Delta x^3 f''(\xi)$, där ξ är någon okänd punkt i intervallet. Denna metod för att räkna fram felet används sällan, ty man behöver finna andra-derivatan och inte nog med det så måste man även hitta när uttrycket antas sitt största värde (man utgår alltid från det värsta fallet, det vill säga att man har det högsta felet på intervallet).

3.3. Relationen mellan Simpsons och Trapetsapprox.

Eftersom både trapets och Simpsons evaluerar funktionen på precis samma mängd av punkter, bör det finnas något form av samband. De använder även samma geometriska härledning för att komma fram till formlerna, en där man använder parabler, och den andra använder vi trapetsar. Både geometriskt och algebraiskt måste det finnas någon koppling!

Simpsons behöver som absolut minst 3 datapunkter som input. Låt oss kalla dessa f_1, f_2, f_3 . Vad händer om vi stoppar in samma datapunkter i trapetsen istället, kan vi härleda något algebraiskt uttryck/samband mellan de två?

$$S_k = T_k + \frac{T_k - T_{k-1}}{3}$$

3.4. Analytiskt bevis för feltermen i trapetsmetoden.

Antag att vi har en funktion $f(t)$, vars integral $I = \int_a^b f(t)dt$ vi vill approximera.

Vi påstår att med hjälp av trapetsmetoden kommer feltermen vara $\frac{M(b-a)^2}{4n}$ där M är derivatans övre begränsning och n antal steglängder.

Vi påminner oss om att steglängden \neq antal steglängder och att steglängden $h = \frac{b-a}{n}$.

Feltermen uttrycks av $|I - T(h)|$

Vi börjar!

Lemma 3.1: Indelning i delintervall

Låt varje steglängd betecknas med intervallet $[x_i, x_{i+1}]$, där mittpunkten ges av $c_i = \frac{x_{i+1} + x_i}{2}$. Detta betyder att $h = x_{i+1} - x_i$. Då uttrycks feltermen för varje delintervall av:

$$\left| I - \frac{h}{2}(f(x_{i+1}) + f(x_i)) \right| = \left| -\left(I - \frac{h}{2}(f(x_{i+1}) + f(x_i)) \right) \right| = \left| \frac{h}{2}(f(x_{i+1}) + f(x_i)) - I \right|$$

$$\left| \frac{h}{2}(f(x_{i+1}) + f(x_i)) - \int_{x_i}^{x_{i+1}} f(t)dt \right|$$

Och för alla delintervall är det summan av alla delintervall:

$$\sum_{i=0}^n \left| \frac{h}{2}(f(x_{i+1}) + f(x_i)) - \int_{x_i}^{x_{i+1}} f(t)dt \right|$$

Lemma 3.2: Felterm uttryckt i integral

Vi påminner oss om partial integrering, $\int uv' = uv - \int u'v$

Vi vill försöka flytta in feltermen så att den ser ut som att den är partialt integrerad:

$$\left. \begin{aligned} (t - c_i) &= u(t) \\ f'(t) &= v'(t) \end{aligned} \right\}$$

$$\frac{h}{2}(f(x_{i+1}) + f(x_i)) = \frac{x_{i+1} - x_i}{2}f(x_{i+1}) + \frac{x_{i+1} - x_i}{2}f(x_i)$$

$$(x_{i+1} - c_i)f(x_{i+1}) + (c_i - x_i)f(x_i) = (x_{i+1} - c_i)f(x_{i+1}) + (-(c_i - x_i))f(x_i)$$

$$(x_{i+1} - c_i)f(x_{i+1}) - (c_i - x_i)f(x_i)$$

Feltermen ges alltså av $((x_{i+1} - c_i)f(x_{i+1}) - (c_i - x_i)f(x_i)) - \int_{x_i}^{x_{i+1}} f(t)dt$

$$\Leftrightarrow \int_{x_i}^{x_{i+1}} (t - c_i)f'(t)dt$$

Bevis 3.1: Felterm med första derivata

Lemma 3.1 och 3.2 ger att vi kan använda faktumet att $f'(t)$ hade en övre begränsning på M :

$$\begin{aligned}
 \int_{x_i}^{x_{i+1}} (t - c_i) f'(t) dt &\leq \left| M \int_{x_i}^{x_{i+1}} (t - c_i) dt \right| = M \int_{x_i}^{x_{i+1}} |t - c_i| dt \\
 \text{Låt } u = t - c_i, \quad \int_{x_i}^{x_{i+1}} |t - c_i| &= \int_{x_i}^{x_{i+1}} |u| \\
 \left. \begin{aligned} f &= |u| \\ f' &= \frac{|u|}{u} g' = 1 \end{aligned} \right\} \\
 \int_{x_i}^{x_{i+1}} |u| &= \left| |u| u \right|_{x_i}^{x_{i+1}} - \int_{x_i}^{x_{i+1}} \frac{|u|}{u} \cdot u \\
 \int_{x_i}^{x_{i+1}} |u| &= |u| u \Big|_{x_i}^{x_{i+1}} - \int_{x_i}^{x_{i+1}} |u| \\
 2 \int_{x_i}^{x_{i+1}} |u| &= |u| u \Big|_{x_i}^{x_{i+1}} \\
 \Leftrightarrow \int_{x_i}^{x_{i+1}} |u| &= \frac{u |u|}{2} \\
 \text{Bort med } u\text{-sub: } \int_{x_i}^{x_{i+1}} |t - c_i| &= \frac{(x_{i+1} - c_i) |x_{i+1}|}{2} - \frac{(x_i - c_i) |x_i - c_i|}{2} \\
 \Leftrightarrow \frac{(x_{i+1} - c_i) |x_{i+1}|}{2} - \frac{(-(c_i - x_i)) |-(c_i - x_i)|}{2} &= \frac{(x_{i+1} - c_i) |x_{i+1}|}{2} + \frac{(c_i - x_i) |c_i - x_i|}{2} \\
 \left. \begin{aligned} x_{i+1} - c_i \\ c_i - x_i \end{aligned} \right\} &= \frac{x_{i+1} - x_i}{2} \\
 \frac{2 \cdot \left(\frac{x_{i+1} - x_i}{2} \right) \left| \frac{x_{i+1} - x_i}{2} \right|}{2} &= \left(\frac{x_{i+1} - x_i}{2} \right) \left| \frac{x_{i+1} - x_i}{2} \right| = \frac{1}{4} (x_{i+1} - x_i)^2
 \end{aligned}$$

Nu kan vi skriva tillbaks M framför: $\frac{M}{4} (x_{i+1} - x_i)^2$

Notera att $(x_{i+1} - x_i)$ är ju steglängden, dvs h :

$$\frac{Mh^2}{4} \geq \frac{f'(t)h^2}{4}$$

□

Vi vill nu visa att om andraderivatan är så kan vi använda begränsningen för att få en ännu finare felterm.

Lemma 3.3: Partialintegrering av feltermintegral för delintervall

Vi vill partialintegrera, men vi kommer inte göra det enkelt för oss utan vi ansätter $(t - c_i)$ som den ”redan deriverade” termen:

$$\int_{x_i}^{x_{i+1}} (t - c_i) f'(t) dt \Leftrightarrow \left| \frac{(t - c_i)^2}{2} f'(t) \right|_{x_i}^{x_{i+1}} - \int_{x_i}^{x_{i+1}} \frac{(t - c_i)^2}{2} f''(t) dt$$

Vi påminner oss om:

$$x_{i+1} - c_i = c_i - x_i = \frac{x_{i+1} - x_i}{2} = \frac{h}{2}$$

Insättning av detta i första partialintegrerade termen ger:

$$\begin{aligned} \frac{\left(\frac{x_{i+1} - x_i}{2}\right)^2}{2} f'(x_{i+1}) - \frac{(x_i - c_i)^2}{2} f'(x_i) &= \frac{\left(\frac{x_{i+1} - x_i}{2}\right)^2}{2} f'(x_{i+1}) - \frac{(-(c_i - x_i))^2}{2} f'(x_i) \\ &\Leftrightarrow \frac{\left(\frac{x_{i+1} - x_i}{2}\right)^2}{2} f'(x_{i+1}) - \frac{\left(\frac{x_{i+1} - x_i}{2}\right)^2}{2} f'(x_i) \\ &\Leftrightarrow \frac{\left(\frac{x_{i+1} - x_i}{2}\right)^2}{2} (f'(x_{i+1}) - f'(x_i)) = \frac{\left(\frac{h}{2}\right)^2}{2} \\ &= \frac{h^2}{8} (f'(x_{i+1}) - f'(x_i)) = \frac{1}{2} \left(\frac{h}{2}\right)^2 (f'(x_{i+1}) - f'(x_i)) \end{aligned}$$

Men detta är bara följande integral:

$$\frac{1}{2} \int_{x_i}^{x_{i+1}} f''(t) dt = \int_{x_i}^{x_{i+1}} \frac{1}{2} \left(\frac{h^2}{2}\right)^2 f''(t) dt$$

Då har vi alltså:

$$\begin{aligned} \int_{x_i}^{x_{i+1}} \frac{1}{2} \left(\frac{h^2}{2}\right)^2 f''(t) dt - \int_{x_i}^{x_{i+1}} \frac{(t - c_i)^2}{2} f''(t) dt \\ = \int_{x_i}^{x_{i+1}} \frac{1}{2} \left(\frac{h}{2}\right)^2 f''(t) - \frac{(t - c_i)^2}{2} f''(t) dt \\ = \frac{1}{2} \int_{x_i}^{x_{i+1}} f''(t) \left(\left(\frac{h}{2}\right)^2 - (t - c_i)^2 \right) dt \end{aligned}$$

Bevis 3.2: Felterm med andraderivata

Från Lemma 3.3 påminner oss om att vi hade en begränsning M på $f''(t)$:

$$\frac{1}{2}M \int_{x_i}^{x_{i+1}} \left(\left(\frac{h}{2} \right)^2 - (t - c_i)^2 \right) dt$$

Vi vill lösa för integralen:

$$\begin{aligned} \int_{x_i}^{x_{i+1}} \left(\left(\frac{h}{2} \right)^2 - (t - c_i)^2 \right) dt &= \int_{x_i}^{x_{i+1}} \left(\frac{h}{2} \right)^2 dt - \int_{x_i}^{x_{i+1}} (t - c_i)^2 dt \\ &= \left(\frac{h}{2} \right)^2 [x_{i+1} - x_i] - \left| \frac{(t - c_i)^3}{3} \right|_{x_i}^{x_{i+1}} \\ &= \left(\frac{h}{2} \right)^2 [x_{i+1} - x_i] - \left(\frac{(x_{i+1} - c_i)^3}{3} - \frac{(x_i - c_i)^3}{3} \right) \\ &= \left(\frac{h}{2} \right)^2 [x_{i+1} - x_i] - \left(\frac{\left(\frac{h}{2} \right)^3}{3} - \frac{(- (c_i - x_i))^3}{3} \right) \\ &= \left(\frac{h}{2} \right)^2 [x_{i+1} - x_i] - \left(\frac{\left(\frac{h}{2} \right)^3}{3} - \frac{\left(\frac{h}{2} \right)^3}{3} \right) \\ &= \left(\frac{h}{2} \right)^2 [x_{i+1} - x_i] - \left(\frac{h^3}{24} - \frac{-h^3}{24} \right) \\ &= \left(\frac{h}{2} \right)^2 [x_{i+1} - x_i] - 2 \left(\frac{h^3}{24} \right) \\ &= h \left(\frac{h}{2} \right)^2 - \left(\frac{h^3}{12} \right) = \frac{h^3}{4} - \frac{h^3}{12} = \frac{h^3}{6} \end{aligned}$$

Nu när integralen är löst kan vi sätta fram koefficienterna:

$$\frac{1}{2}M \cdot \frac{h^3}{6} = \frac{Mh^3}{12} \geq \frac{h^3}{12} f''(t)$$

□

4. FÖRELÄSNING

- Adaptiva metoder
- Numerisk integration i scipy
- Relativt och absolut fel
- Funktionsfel

Vi vill göra en figur där yaxeln motsvarar felet och x_axeln motsvarar h.

4.1. Numerisk integration med scipy.

Givet en integral $I = \int_a^b f(x)dx$ så kan vi skriva följande kod för att evaluera integralen:

```
from scipy.integrate import quad

(q, aerr) = quad(func, a, b) # Feluppskattning |q-I| ungefär lika med aerr
#Vi kan begära viss noggrannhet:

(q, aerr) = quad(func, a, b, epsabs = atol, epsrel = rtol) #scipy försöker uppfylla kraven

|q-I| <= max(atol, rtol*|I|)
```

4.2. Vad menas med absolut resp. relativt fel?

Om ens chef säger ”ge mig det här med 5 siffrors noggrannhet”, men vad menar grabben egentligen? Säg att jag skall approximera 1 med 3 siffrors noggrannhet och min approximation är 0.9999999 (inga siffror är korrekt!):

4.3. Funktionsfelet.

$I = \int_a^b f(x)dx$. Vi approxierar denna med numerisk kvadratur där vi antar att vi har exakta värden på funktionen. Men vad händer om vi inte har exakta funktionsvärden, det vill säga att vi har ett fel? Det kanske kommer från mätvärden där det är fel i dem, eller något som vi alltid har, avrundningsfel. Antag att vi vet att $|f(x) - \tilde{f}(x)| \leq \varepsilon$, för sammansatta trapets/simpson gäller $\sum_{i=0}^n |w_i| = b - a \Rightarrow \varepsilon \sum_{i=0}^n |w_i| = \varepsilon(b - a)$

- Diskretiseringsfelet är vanligtvis större än avrundningsfelet.
- Om funktionsvärden kommer från mätningar kan de ha stor effekt på noggrannheten.

4.4. Noggrannhet - Sammanfattning.

Två typer av fel

- Diskretiseringsfel (trunkeringsfel)
- Fel i funktionsvärden

$$I = \int_a^b f(x)dx \approx Q(h) \approx \tilde{Q}(h)$$

Totalt fel: $I - \tilde{Q}(h) = I - Q(h) + Q(h) - \tilde{Q}(h)$ där första 2 termerna är diskret. fel och sista 2 är funktionsfel

Vi kan använda Ye Olde' triangelolikheten:

$$|I - \tilde{Q}(h)| \leq |I - Q(h)| + |Q(h) - \tilde{Q}(h)|$$

4.5. Gammal tentauppgift (2009-12-21).

Om en funktion $f(x)$ vet man dels att den för vissa x -värden antar värden enligt tabellen nedan (två korrekta decimaler):

x	0.1	0.2	0.3	0.4	0.5
$f(x)$	1.89	2.07	2.89	2.18	1.74

och dels att absolutbeloppet för de 5 första derivatorna av $f(x)$ är begränsade och mindre än 19 i intervallet. Givet denna information, approximera integralen $I = \int_{0.1}^{0.5} f(x)dx$ så exakt som möjligt samt ge en strikt feluppskattning.

Det är trapets och simpsons som vi har gått igenom, och simpsons är den mest noggranna. Vad är det som gör att jag kan använda simpsons? Jo, jag har ekvidistanta punkter (alla x -värden skiljer sig med lika mycket) och jämt antal intervall:

$$S(h) = \frac{h}{3}[f(x_0) + 4f(x_1) + 2f(x_2) + 4f(x_3) + f(x_4)]$$

Men! Funktionsvärdena är inte exakta, så jag har alltså $\tilde{S}(h)$:

$$\tilde{S}(h) = \frac{0.1}{3}(1.89 + 4 \cdot 2.07 + 2 \cdot 2.89 + 4 \cdot 2.18 + 1.74) \approx 0.88033$$

Vi har 2 fel som vi skall svara på, diskretiseringsfelet och funktionsfelet. Låt oss börja med trunkeringsfelet:

$$I = \int_a^b f(x)dx = S(h) - \frac{(b-a)}{180}h^4 f^{(4)}(\xi) \text{ ej } \tilde{S}(h)$$

$$|I - S(h)| = \left| \frac{(b-a)}{180}h^4 f^{(4)}(\xi) \right| < \frac{0.5-0.1}{180} \cdot 0.1^4 \cdot 19 \approx 4.22 \cdot 10^{-6} = \text{trunkeringsfelet}$$

Funktionsfelet:

$$|f(x) - \tilde{f}(x)| < 0.5 \cdot 10^{-2}$$

$$|S(h) - \tilde{S}(h)| \leq (b-a)\varepsilon = (0.5-0.1) \cdot 0.5 \cdot 10^{-2}$$

Totala felet:

$$|I - \tilde{S}(h)| = |I - S(h) + S(h) - \tilde{S}(h)| \leq |I - S(h)| + |S(h) - \tilde{S}(h)| \leq 4.22 \cdot 10^{-6} + 0.0002 \approx 0.0002$$

$$I \approx 0.880 \pm 0.002$$

För att minska felet, vad ska man göra då? Man kan använda flera värden eller testa trapets, men notera att funktionsfelet är 100 gånger större än trunkeringsfelet, så vi behöver mer exakta värden!

5. ICKE-LINJÄRA EKVATIONER

Exempelvis: Hitta x då $e^x = 10 \cos(x)$. Dessa typer av ekvationer finns det ingen explicit form där man kan lösa ut x . Något vi kommer göra under föreläsningen är att skriva på formen $f(x) = 0$ (detta går alltid genom att flytta över allt till en sida).

Vi använder så kallade *iterativa* metoder/algorithmter för att lösa dessa typer av icke-linjära ekvationer.

Sats 5.1: Iterativ metod

- Behöver en startgissning x_0
- Bilda en följd med bättre och bättre approximationer till den exakta lösningen x_*

Metoden konvergerar om $\lim_{k \rightarrow \infty} x_k = x_*$

I praktiken når man inte till x_* utan stannar när ett stoppvillkor uppfylls.

Implementationen av en sådan metod kallas för *algorithm*.

```
x = [START GISSNING]
while [STOPPVILLKOR EJ UPPFYLLT]:
    x = [NY APPROX]
end
```

Nya approximationen räknas från någon formel eller princip. Det kan hända att den lyckas, eller misslyckas. Lyckas den så har vi konvergens, misslyckas den så har vi divergens.

Hur snabbt metoden når konvergens/hittar lösningen är också av relevans. Kallas för *konvergensthastigheten*.

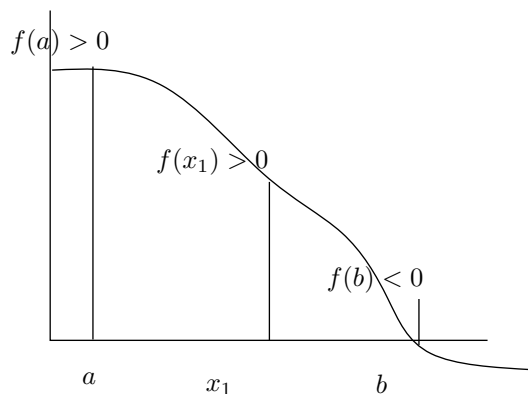
Vi kommer ta upp 2 olika metoder, bisektionsmetoden och Newton.

5.1. Bisektionsmetoden/Intervallhalvering.

Denna går ut på att skriva om på formen $f(x) = 0$ (detta gäller allmänt ty det är så de är implementerade, även i SciPy). Fortsätter vi på exemplet $e^x = 10 \cos(x)$ får vi $f(x) = e^x - 10 \cos(x)$

Idén är att börja med ett startintervall $I = [a, b]$ där vi antar att den är kontinuerlig på det intervallet och att $f(x)$ har teckenväxling på detta intervall. Satsen om mellanliggande värden säger då att den måste korsa x -axeln någonstans, så vi vill helt enkelt förfinas intervallet I .

Det gör vi genom att dela intervallet i två delintervall, väl sedan den delen som har teckenväxling. Upprepa tills intervallet är tillräckligt litet. Hur stort fel man har i sin lösning är begränsat till halva intervall-längden. Vi ritar för en bättre känsla:



Vi skriver upp en pseudo-kod för detta:

```
#f,a,b givet
#Vill börja med att kontrollera input

Kontrollera att sign(f(a)) är skilt från sign(f(b))

x= (a+b)/2
while [!Stoppvillkor]:
  if sign(f(a)) = sign(f(x)):
    a = x #Om vänstra delen ej innehåller teckenväxling så förkortar vi bort VL
  else:
    b = x #Annars, förkorta HL
  x = (a+b)/2
end
```

5.1.1. Konvergenshastighet.

Konvergerar alltid. Men, det kan finnas flera rötter så det säger inte mycket om *vilken* rot. Hastigheten ges av:

$$|x_* - x_1| \leq \frac{b-a}{2}$$

I varje iteration halverar vi avståndet (delar på 2) alltså kommer felet halveras.

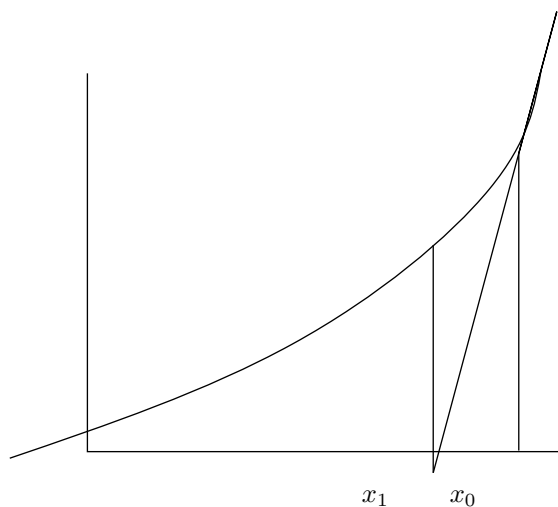
$$|x_* - x_k| \leq \frac{b-a}{2^k}$$

Nu kan vi skriva in lite saker om stoppvillkor:

Given tolerans $|x_* - x_k| \leq Tol$. Vi vet att $|x_* - x_k| \leq \frac{b-a}{2^k}$. Då vet vi att vi ska stanna när $\frac{b-a}{2^k} \leq Tol$. Då kan vi räkna ut k och därmed räkna ut antal iterationer vi behöver köra i while-loopen.

5.2. Newton-Raphson.

Vi skriver återigen på formen $f(x) = 0$. Vi har någon startgissning x_0 (ej intervall, utan värde). Idén är att vi drar en tangent till funktionen och nästa gissning blir roten/nollställe till tangenten. Illustrerat:



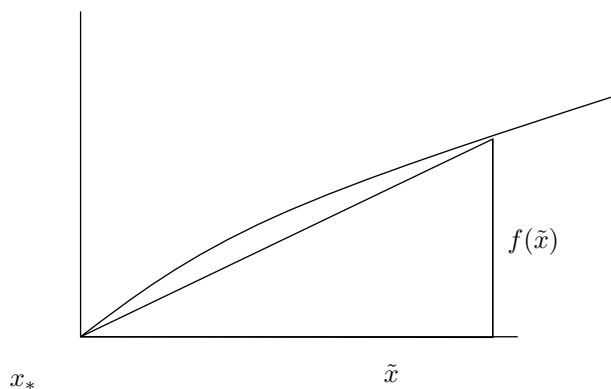
Tangenten ges av $l(x) = f'(x_0)(x - x_0) + f(x_0)$. Vi löser för när $l(x_1) = 0 \Rightarrow f'(x_0)(x_1 - x_0) + f(x_0) = 0 \Rightarrow x_1 = x_0 - \frac{f(x_0)}{f'(x_0)}$

Låt oss skriva en pseudo-kod:

```
x = startgissning
while (!stoppvillkor):
    dx = -f(x)/f'(x)
    x = x+dx
end
```

5.2.1. Stoppvillkor.

Säg att vi har en approximativ lösning \tilde{x} och x_* som är exakt. Då är vi intresserade av $|x_* - \tilde{x}|$. Vi utnyttjar att om vi zoomar in så blir det en triangel:



Vi får då:

$$f'(\tilde{x}) \approx \frac{f(\tilde{x})}{\tilde{x} - x_*}$$

$$\Rightarrow |x_* - \tilde{x}| \approx \left| \frac{f(\tilde{x})}{f'(\tilde{x})} \right| = |\Delta x|$$

Alltså stanna då $|x_{k+1} - x_k| < Tol$

Då kan man fråga, "men farbror Melker, kan man inte använda $|f(x_k)| < Tol$?" Nej, tänk om vi har asymptoter.

- Vertikal asymptot ger att
 - $|x_* - x_{k+1}|$ är stort
 - $|f(x_{k+1})|$ är stort
- Horisontell asymptot ger att
 - $|x_* - x_{k+1}|$ är stort
 - $|f(x_{k+1})|$ är litet

När man skriver while loopar skall man vara aktsam över att man kanske inte konvergerar. Då får man en oändlig loop eftersom stoppvillkoret aldrig uppfylls. Då är det smart att lägga in ett max antal iterationer:

```
maxiter = 100
niter = 0
while felet > tol && niter < maxiter
  niter = niter+1
end
```

5.3. Gammal tentatal - 2012-04-11.

Ekvationen $\cos(x) + 5 = e^x$. Den har en lösning mellan $[1, 2]$

- Formulera intervallhalveringsmetoden för att hitta roten och gör 3 iterationer
- Hur många iterationer skulle krävas för att få ett absolut fel i det beräknade värdet mindre än 10^{-8} ?

Vi börjar med första. Vi börjar givetvis med att skriva om på $f(x) = 0$:

$$f(x) = \cos(x) + 5 - e^x = 0$$

Vi kan nu kontrollera startintervallet $[1, 2]$:

$$f(1) = \cos(1) + 5 - e > 0$$

$$f(2) = \cos(2) + 5 - e^2 < 0$$

Sartintervallet är ok, ty jag har olika tecken. Mittpunkten är 1.5:

$$f\left(\frac{1+2}{2}\right) = f(1.5) \approx 0.6 > 0$$

Vi vill ha delen med teckenväxling, så vi väljer "högra" delen. Mittpunkten är 1.75:

$$f(1.75) \approx -0.93 < 0$$

Vi väljer "vänstra" delen:

$$f(1.625) \approx -0.13 < 0$$

Mittpunkten mellan 1.5 och 1.625 är 1.5625. Vi har nu kört 3 iterationer som frågan frågar efter, så vi uppskattar felet:

$$|x - x_*| \leq \frac{b - a}{2} = \frac{1.625 - 1.5}{2} = 0.0625$$

Svaret blir $x = 1.5625 \pm 0.0625$

Vi kör andra frågan:

Låt ε_k vara feluppskattning efter k iterationer. Då har vi i detta fall:

- $\varepsilon_0 = \frac{b - a}{2} = \frac{2 - 1}{2} = 0.5$
- $\varepsilon_1 = \varepsilon_0 \cdot 0.5 = 0.25$
- $\varepsilon_2 = \varepsilon_1 \cdot 0.5 = \varepsilon_0 \cdot 0.5^2$
- $\varepsilon_k = 0.5^k \varepsilon_0 = 0.5^{k+1}$

Vi vill hitta $\varepsilon_k \leq 10^{-8}$:

$$\begin{aligned} 0.5^{k+1} &< 10^{-8} \\ (k+1) \log(0.5) &< \log(10^{-8}) \\ k &> \frac{\log(10^{-8})}{\log(0.5)} - 1 \approx 25.6 \end{aligned}$$

Eftersom vi ska ha strikt noggrannhet så rundar vi uppåt, så det skulle alltså krävas 26 iterationer.

6. FORTS. ICKE-LINJÄRA EKVATIONER

Vi börjar med exemplet $e^x = 10 \cos(x) \Leftrightarrow e^x - 10 \cos(x)$. Vi ska göra koden:

```
import numpy as np
import matplotlib.pyplot as plt

def bisection(func, a, b, tol):
    # sign_fa = np.sign(func(a))
    # sign_fb = np.sign(func(b))

    x = (a+b)/2
    itercounter = 0
    sign = np.sign(func(a)) == np.sign(func(b))

    assert(not sign)

    while((b-a)/2) > tol:

        itercounter += 1
        localSign = np.sign(func(x))

        if sign == localSign:
            a = x
        else:
            b = x

    x = (a+b)/2
    return x, itercounter
```

Hitta en positiv lösning ($x > 0$) till ekvationen med 8 korrekta decimaler.

- Använd bisection
- Använd Newton-Raphson

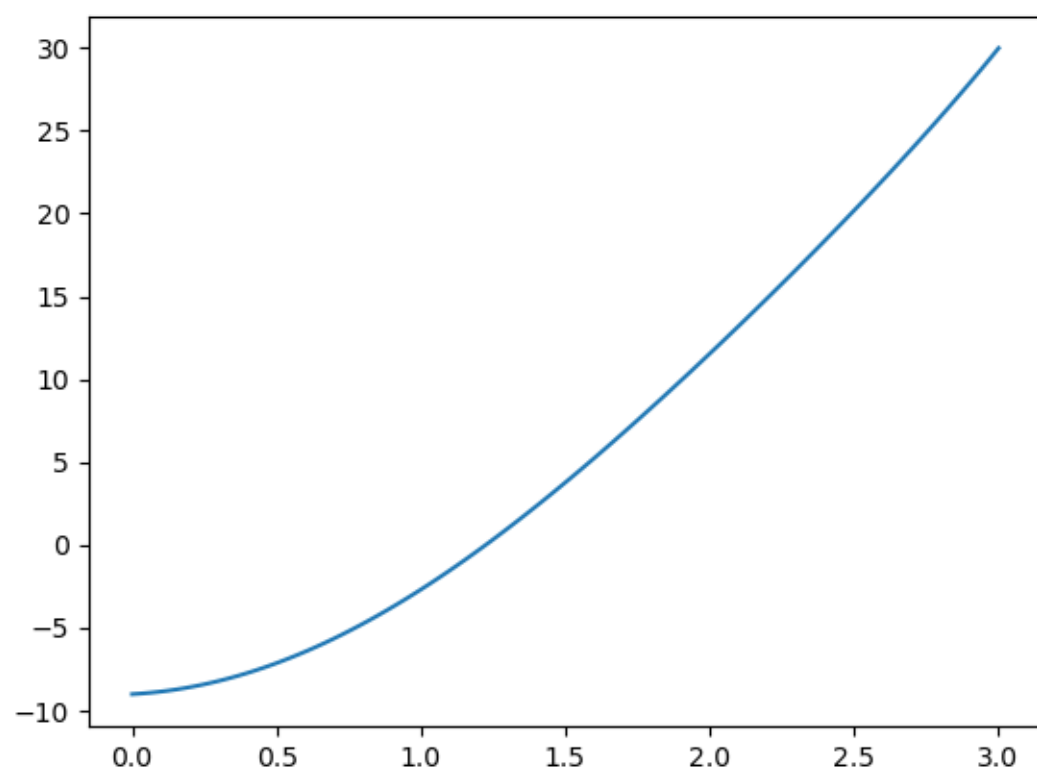
Man börjar givetvis alltid med att skriva om på formen $f(x) = e^x - 10 \cos(x)$. Vi behöver också ett startintervall/startgissning, men hur ska man hitta det? Ett sätt är att fundera över hur funktionen ser ut. Ett annat sätt är att plotta funktionen (beror lite på det specifika fallet man undersöker).

Vi ser att $f(0) = 1 - 10 = 9 < 0$ och $f(\frac{\pi}{2}) = e^{\pi/2} - 0 > 0$.

. Vi testar att plotta vår funktion:

```
func = lambda x: np.exp(x)-10*np.cos(x)
```

Här ser vi en rot mellan 1 och 1.5:



Kör vi koden får vi att den konvergerar mot ≈ 1.2 med 26 iterationer. Implementerar vi Newtons metod och använder startvärde 1.25 får vi konvergens med inget mindre än 4 iterationer! Givetvis måste vi dock räkna derivator.

Slutsats: Newton är mycket snabbare.

Frågan är varför? Kan det bero på likformig kontinuitet eller strikt monoton?

6.1. Konvergensthastighet.

Låt x_* vara vår exakta lösning och vi antar att vi har en iterativ metod som generar en talföljd x_1, x_2, \dots . Antag även att vi har konvergens, dvs $\lim_{k \rightarrow \infty} x_k = x_*$.

Sats 6.1: Konvergensordning

En metod har *konvergensordning* r om $\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{|x_* - x_{k+1}|}{|x_* - x_k|^r} = C$ där C (konstant) kallas för *asymptotisk felkonstant*

Notera att ju större r är, desto snabbare konvergerar den. Om:

- $r = 1, C < 1$ har vi *linjär konvergens*
- $r = 2$ har vi *kvadratisk konvergens*
- $r > 1$ har vi *superlinjär konvergens* (Busigt att använda $r > 1$)

6.2. Konvergens i bisektionsmetoden.

Felet halveras i varje steg. Vi kommer ihåg att vi har $|x_* - x_k| \leq \frac{B-A}{2^k}$ där $[A, B]$ är startintervallet. Det nya felet kommer då vara $\frac{1}{2}$ gamla felet, därför har vi $r = 1$ och $C = \frac{1}{2}$ det vill säga linjär konvergens.

6.3. Konvergens i Newton-Raphson.

Påminner oss om metoden: $x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f'(x_k)}$. Vi Taylorutvecklar kring x_k med steget $(x_* - x_k)$.

sedan har vi $\underbrace{f(x_k + (x_* - x_k))}_{f(x_*) = 0} = f(x_k) + (x_* - x_k)f'(x_k) + (x_* - x_k)^2 f''(\xi) \cdot \frac{1}{2}$

7. FÖRTYDLIGANDE/FRÅN BOKEN

Att hitta rötterna till en ekvation är inte alltid lätt, oftast har vi kikat på explicita funktioner där det är relativt lätt att göra, men det är inte så i verkligheten.

Vanligtvis slänger man lite analysverktyg på den, kollar om det finns några busiga punkter som man kan analysera som ofta ger mycket information om funktionen, men vad gör man om det inte räcker till? Om det enda sättet att hitta rötterna är via kontinuerlig beräkning, så vill vi givetvis hitta den mest effektiva metoden för det!

Det finns ett par sätt att angripa detta unika problem, de 2 metoder som kommer gås igenom kommer vara antingen genom att analysera *typen* av funktionen och därmed anpassa beräkningsmetoden, eller så anpassar vi beräkningsmetoden. The choice is ours.

7.1. Rötter av polynom.

Vad vet vi om polynom?

- Om polynomet är av grad n , så finns det n antal tal där $f(x) = 0$
- De är kontinuerliga på hela sin domän
- Rötter kan faktoriseras bort och ge ett enklare polynom

Vi ska bygga vidare lite på den första punkten.

Ett polynom $f(x) = a_1x^n + a_2x^{n-1} + \dots + a_nx + a_{n+1}$ kan faktoriseras m.h.a dess rötter till följande $f(x) = a_1(x - r_1)(x - r_2) \dots (x - r_n)$ där r_i är rötter. Lägg märke till att vi inte tar hänsyn till rötters multiplicitet eller eventuell komplex form, utan enbart deras existens. Från Algebra 1 vet vi att polynom med reella koefficienter har komplexa rötter, och om ett polynom har en komplex rot så existerar konjugatet även som rot.

7.1.1. *Descartes tecken-regel.*

Om koefficienterna av ett polynom är reelt och antalet teckenväxlingar av koefficienterna är n så gäller:

- Antalet positiva reella rötter är antingen n eller $n - 2m$
- Antalet negativa rötter ges av att invertera polynomet så att $x \rightarrow -x$ och sedan applicering av föregående punkt

Lite flummigt, så vi kör ett exempel! Antag att vi har följande polynom:

$$f(x) = x^4 - 5x^3 + 5x^2 + 5x - 6 = 0$$

För att räkna antal teckenväxlingar börjar vi från vänster och räknar. Vi börjar med positivt tecken, sedan växlar det till negativt (1), sedan tillbaka till positivt (2), sedan i slutet finns en negativ term återigen (3). Totalt 3 teckenväxlingar! Alltså kommer vi ha högst 3 positiva reella rötter och minst 1. Räkna vi de negativa så substituerar vi x med $-x$:

$$(-x)^4 - 5(-x)^3 + 5(-x)^2 + 5(-x) - 6 = 0 = x^4 + 5x^3 + 5x^2 - 5x - 6$$

Detta polynom har en teckenväxling, alltså kommer det ursprungliga polynomets ha 1 negativ reel rot. Det visar sig att våra beräkningar stämmer, ty polynomets rötter är $\{1, 2, 3, -1\}$.

Men det är definitivt inte alltid som vi får en så pass snäll funktion som ett polynom, och då har vi andra metoder för att hitta rötterna.

8. FORTS. ICKE-LINJÄRA EKVATIONER

Vi ska börja med att sammanfatta egenskaper hos bisektionsmetoden och Newton-Raphson:

Bisektion	Newton
Robust: Konvergerar alltid givet teckenväxling och kontinuitet	Kan divergera, ej helt pålitlig
Linjär konvergens	Kvadratisk konvergens (snabb om startgissning bra)
1 funktionseval. per iteration	1 funktionseval. + 1 derivering per iteration

Vi noterar att där den ena är bra, så är den andra sämre. Det vore därför bra om man kan bygga en slags hybridmetod (många av dagens metoder ser ut på detta vis). En sådan metod kan se ut på följande:

8.1. Hybrid-skiss av Newton-Raphson och bisektionsmetoden.

Vi vill:

- Kombinera säkerheten hos bisektionsmetoden med snabbheten hos Newtons metod

Då behöver vi ett startintervall $[a, b]$ där vi vet teckenväxling finns och att det finns en rot, men det bästa är ju om vi kan köra Newton-Raphson eftersom den är snabb. Däremot kanske man hamnar utanför intervallet med Newton-Raphson, och det kan hända att antal iterationer blir för mycket, men om den har konvergerat så är vi klara.

Annars (ex. vis om vi hamnat utanför intervallet), då kör vi bisektionsmetoden för att krympa intervallet för att generera en bättre startgissning för Newton-Raphson och gör om algoritmen.

Något som kan hända är givet en funktion med flera rötter, så kan halvering av ett intervall "ta bort" rötter vilket kanske gör att (beroende på tillämpning) man får underliga svar. Exempel, om man mäter längden på en människa under sin livstid där 150cm är roten, då kanske man passerar den när man växer, och senare i livet när man krymper. Halverar man däremot kanske man bara får vid tillväxten vilket kanske verkar konstigt givet att man vet att man krymper senare.

8.2. Mer om konvergensordning i praktiken.

Vi påminner oss om definitionen:

$$\lim_{i \rightarrow \infty} \frac{|x_* - x_i|}{|x_* - x_{i-1}|^r} = C$$

Där r är konvergensordningen. Oftast är x_* okänd, då tittar man istället på följande kvot:

$$\frac{|x_{i+1} - x_i|}{|x_i - x_{i-1}|^r} = \frac{|\Delta x_i|}{|\Delta x_{i-1}|^r}$$

Exempel:

En metod för ekvationslösning har generat korrektionstermerna (Δx):

i	Δx_i
1	0.01
2	0.001
3	10^{-5}
4	10^{-9}

Vad kan vi säga om metodens konvergens? Kan vi inte säga något? Är den linjär? Eller är den kvadratisk? Kubisk?

Vad är den asymptotiska felkonstanten?

Man kan besvara dessa frågor på lite olika sätt. Vi kan anta olika saker och se:

i	Δx_i	$ \Delta x_i / \Delta x_{i-1} $	$ \Delta x_i / \Delta x_{i-1} ^2$
1	0.01	-	-
2	0.001	0.1	10
3	10^{-5}	0.01	10
4	10^{-9}	0.0001	10

Notera att tillväxten är kvadratisk eftersom skillnaderna mellan $|\Delta x_i|$ är kvadratisk, så om vi antar att den är kvadratisk (som vi gör i sista kolonnen) ser vi att den asymptotiska felkonstanten är 10.

Man kan använda 2 iterationer för att få fram C och r genom att lösa följande ekvationssystem:

$$\begin{cases} |\Delta x_{i+1}| = C |\Delta x_i|^r \\ |\Delta x_i| = C |\Delta x_{i-1}|^r \end{cases}$$

Givet att vi vet värden på $|\Delta x_i|$

8.3. Sekantmetoden.

Den är väldigt lik Newtons-Raphson, i någon mening är derivata bara en väldigt väldigt fin sekant. Som man hör på namnet så tar vi alltså en sekant istället för en tangent. Därför har den i någon mening samma form som Newton-Raphson:

$$x_{i+1} = x_i + \Delta x_i$$

$$\text{I Newton-Raphson har vi } \Delta x_i = -\frac{f(x)}{f'(x)}$$

I Sekantmetoden har vi en uppskattning på sekantens lutning:

$$f'(x_i) \approx \frac{f(x_i) - f(x_{i-1})}{x_i - x_{i-1}}$$

Insättning i Newton-Raphson ger:

$$\Delta x_i = -f(x_i) \frac{x_i - x_{i-1}}{f(x_i) - f(x_{i-1})}$$

Vi behöver 2 startgissningar, men vi behöver inte räkna någon derivata. Konvergensordningen är något lägre än Newton-Raphson, men fortfarande superlinjärt ($r = \frac{1 + \sqrt{5}}{2}$) (gyllene snittet!!)

En vanlig tillämpning av Newton-Raphson är inom miniräknare för att räkna ut roten ur ett tal.

Exempel: Bestäm \sqrt{n} för givet n .

Vi vill lösa $x = \sqrt{n}$ vilket är samma som att lösa $x^2 = n \Leftrightarrow x^2 - n = 0$. Nu kan vi använda Newton-Raphson:

$$f'(x) = 2x$$

$$x_{i+1} = x_i - \frac{f(x_i)}{f'(x_i)} = x_i - \frac{x_i^2 - n}{2x_i}$$

För $\sqrt{423}$ med 4 korrekta decimaler (dvs $|x_* - \tilde{x}| < 0.5 \cdot 10^{-4}$). En rimlig gissning är $x_0 = \sqrt{400} = 20$:

$$x_1 = 20 - \frac{20^2 - 423}{2 \cdot 20} = 20 + 0.575 = 20.575$$

Notera att 0.575 är större än toleransen, vi fortsätter:

$$x_2 = x_1 - \frac{x_1^2 - n}{2x_1} = 20.575 - \frac{(20.575)^2 - 423}{2 \cdot 20.575} \approx \underbrace{20.575 - 0.0080346}_{|\Delta x_1| > 0.5 \cdot 10^{-4}, \text{ fortsätt}} \approx 20.56696537$$

$$x_3 = x_2 - \frac{x_2^2 - n}{2x_2} = 20.56696537 - \underbrace{1.57 \cdot 10^{-6}}_{= |\Delta x_2| < 0.5 \cdot 10^{-4} \text{ Ok!}}$$

Övning! Bestäm p :te roten ur n , dvs $x = n^{1/p}$

Exempel: Startgissning + SciPy
Givet:

$$x^{12} + x = 0.1 \Leftrightarrow f(x) = x^{12} + x - 0.1 = 0$$

Nu är vi ute efter en startgissning för att köra Newton-Raphson på den. Genom att titta på ekvationen ser vi att x är relativt liten. Vi vet även att $x^{12} < x$ vilket ger oss:

$$f(x) \approx x - 0.1 = 0 \Leftrightarrow x = 0.1$$

Kontroll av antagande: $x = 0.1 \Rightarrow x^{12} < x$ Ok!

Vi skriver en SciPy lösning till detta:

```
from scipy import optimize
```

```
fun = lambda x: x**12+x-0.1
```

```
fp = lambda x: 12*x**11+1
```

```
#stoppar man inte in fprime så kör den sekant, busigt!
```

```
x = optimize.newton(fun, 0.1, fprime = fp)
```

Ytterligare exempel: Lös $100e^x - x^2 = 10^{12}$

Skriver vi om den till $f(x) = 100e^x - x^2 - 10^{12} = 0$ ser vi att x måste vara stor för att kompensera mot 10^{12} , gissar vi att x är stor så antar vi helt enkelt att:

$$100e^x > x^2 \Rightarrow f(x) \approx 100e^x - 10^{12} = 0 \Rightarrow e^x = 10^{10} \Rightarrow x = 10 \log(10) \approx 23$$

Vi kontrollerar antagandet: $100e^{23} > 23^2$ Ok!

9. ORDINÄRA DIFFERENTIALEKVATIONER

Man brukar dela in ODE:er i 2 grupper beroende på randvillkorlet.

Explicit: $y^{(k)}(t) = f(t, y, y', y'', \dots, y^{(k-1)})$

Den första gruppen är *Begynnelsevärdesproblem* (IVP).

Exempel på första ordningens IVP:

$$\begin{cases} y'(t) = f(t, y(t)) = 3y + t & t > t_0 \\ y(t_0) = y_0 \end{cases}$$

Andra gruppen är *Randvärdesproblem*

Exempel:

$$\begin{cases} y'' = f(x, y, y') & a \leq x \leq b \\ y(a) = \alpha \\ y(b) = \beta \end{cases}$$

Randvärdesproblem tas inte upp i denna kurs, däremot kommer det i Berv3/Berv för PDE.

Det som är viktigt att notera (för att få en unik lösning) är att antalet villkor som krävs är lika med ordningen på ekvationen.

9.1. Speciella egenskaper för att klassificera ODE:er.

En ODE kallas *linjär* om den är linjär i y och alla dess derivator. Exempelvis $y' = 3y + t$

Variabla koefficienter, exempelvis $y' = \sin(t)y + t$

En icke-linjär ODE kallas för *ickelinjär*, exempelvis $y' = y^2 + t$

System av ekvationen, SIR-modellen för epidemi. Antalet villkor för system av första ordningens ODE:er = antalet ekvationer.

Om alla villkor ges i samma punkt så har vi begynnelsevärdesproblem, annars randvärdesproblem.

Högre ordningens ekvationer, exempelvis:

$$\begin{aligned} y'' &= f(t, y, y') & t \geq t_0 \\ y(t_0) &= y_0 \\ y'(t_0) &= z_0 \end{aligned}$$

9.2. Omskrivning till förta ordningens ODE.

Givet en ODE av ordning n :

$$u^{(n)} = f(t, u, u', u'', \dots, u^{(n-1)})$$

För att skriva om den till system av första ordningen introducerar vi en vektor y med följande komponenter:

$$y_1 = u, \quad y_2 = u', \quad y_3 = u'', \quad \dots, \quad y_n = u^{(n-1)}$$

Vilket ger ett system av första ordningen. Vi behöver HL för varje y_i . Vi kikar närmare på y'_1 , vilket blir y_2 :

$$\begin{cases} y'_1 = y_2 \\ y'_2 = y_3 \\ \vdots \\ y'_{n-1} = y_n \\ y_n = f(t, y_1, y_2, \dots, y_n) \end{cases}$$

Kom ihåg! Begynnelsevärden.

Vad gör man om man har ett system med flera differentialekvationer? Jo, då skriver man om de till första ordningen och lägger ihop i en enda lång vektor.

Vid system kan varje ekvation med högre ordningens derivator skrivas om till första ordningen. Därför är vanligtvis mjukvara för ODE utformad för system av första ordningen.

9.3. Begynnelsevärdesproblem i SciPy.

Vi ska ta fram en slags guide på givet ett problem, hur man löser det i SciPy.

Det första man ska göra är att skriva om på standardformen:

$$\begin{cases} y' = f(t, y) & a \leq t \leq b \\ y(a) = \alpha \end{cases}$$

där y, f, α är vektorvärda.

Skriv om till system av 1:a ordningen och specificera position i vektorn Y för varje komponenter i lösningen.

Exempel, $\begin{pmatrix} S \\ I \\ R \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} y_1 \\ y_2 \\ y_3 \end{pmatrix}$. Man kan givetvis byta runt på raderna, men var konsekvent. Byter man på en rad på ena sidan av ledet måste man göra det på det andra.

Ställ upp begynnelsevärden för Y .

Skriv python funktion för HL, för $f(t, y)$.

Från SciPy.integrate, används solve_ivp(func,(a,b), α).

Exempel: Omloppsbana

$$\begin{cases} x'' = -GM y/r^3 \\ y'' = -GM x/r^3 \end{cases} \quad t > 0$$

där $r = \sqrt{x^2 + y^2}$ och $GM = 1$

$$\begin{cases} x(0) = 1 - e \quad e \text{ är excentritet} \\ y(0) = 0 \\ x'(0) = 0 \\ y'(0) = \sqrt{\frac{1+e}{1-e}} \end{cases}$$

Där $0 \leq e < 1$

Som vi såg tidigare var första steget att skriva om på standardform. Vi kör båda ekvationerna samtidigt:

$$u_1 = x, \quad u_2 = x', \quad u_3 = y, \quad u_4 = y'$$

$$\begin{cases} u_1' = u_2 \\ u_2' = -GMu_1/r^3 \\ u_3' = u_4 \\ u_4' = -GMu_3/r^3 \\ r = \sqrt{u_1^2 + u_3^2} \end{cases}$$

Vi påminner om begynnelsevärden:

$$u(0) = \begin{pmatrix} 1 - e \\ 0 \\ 0 \\ \sqrt{\frac{1+e}{1-e}} \end{pmatrix}$$

Då har vi gjort första steget. Andra steget var att skriva en python-funktion för $f(t, u)$:

```
import numpy as np
from scipy.integrate import solve_ivp
import matplotlib.pyplot as plt

def fun(t,u):
    GM = 1
    r = np.sqrt(u[0]**2+u[2]**2)
    return np.array([u[1],
                    -GM*u[0]/r**3,
                    u[3],
                    -GM*u[2]/r**3])
```

Då kommer nästa steg, sätt begynnelsevillkor och anropa solve_ivp:

```
tspan = (0, 2*np.pi) # en period
ecc = 0
u0 = np.array([1-ecc, 0, 0, np.sqrt((1+ecc)/(1-ecc))])
SOL = solve_ivp(fun, tspan, u0, max_step=0.01)

plt.plot(SOL.y[0,:], SOL.y[2,:])
plt.grid()
plt.axis('equal')
plt.xlabel('x')
plt.ylabel('y')
plt.show()
```

SOL är ett objekt med bland annat SOL.t som är en vektor med $n + 1$ tidpunkter, SOL.y som är den numeriska lösningen i de här tidpunkterna (vilket i vårt fall är 4 vektorer, en vektor för varje komponent) alltså $4 \times (n + 1)$ -matris.

Sista steget är att plotta lösningen. x -axeln kommer ha funktionen x och samma med y -axeln, alltså inte variabeln t .

9.4. Eulers metod (explicit Euler)(Euler framåt).

Givet följande differentialekvation:

$$\left. \begin{array}{l} y'(t) = f(t, y(t)) \\ y(a) = \alpha \end{array} \right\} \quad a \leq t \leq b$$

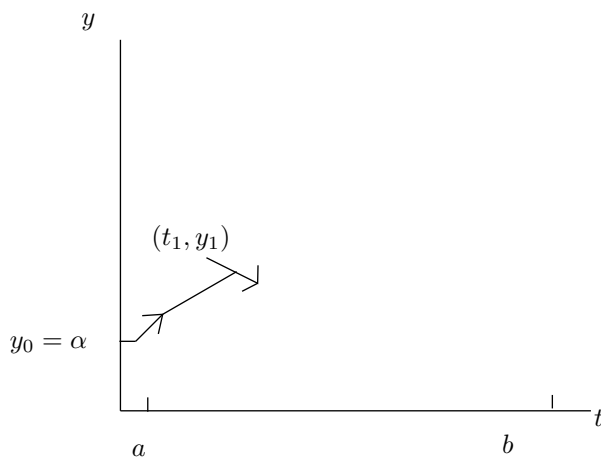


FIGURE 5. Euler

Generellt: $t_{i+1} = t_i + h$ där $h = \frac{b-a}{n}$

$$\left. \begin{array}{l} t_{i+1} = t_i + h \quad \text{där} \quad h = \frac{b-a}{n} \\ y_{i+1} = y_i + hf(t_i, y_i) \\ t_0 = a, \quad y_0 = \alpha \end{array} \right\}$$

Detta är någon slags geometrisk motivering till metoden, men den går att härleda analytiskt via en Taylorserie:

$$y(t+h) = y(t) + hy'(t) + \frac{h^2}{2}y''(t) + \dots$$

$$\underbrace{y(t) = hf(t, y(t))}_{\text{Eulersteg}} + \underbrace{O(h^2)}_{\text{Lokalt trunkeringsfel}}$$

Det lokala trunkeringsfelet är bara i 1 steg, det är bland annat därför den kallas för *lokal*.

9.5. Diskretiseringsfel - Eulers metod.

Vi talade om det *lokala* diskretiseringsfelet, vilket är felet i *ett* steg.

10. ORDINÄRA DIFFERENTIALEKVATIONER - FORTS.

Dagens föreläsning handlar om:

- Euler bakåt
- Klassificering av metoder
- Globalt trunkeringsfel, konvergens
- Frågeställning från labben
- Enstegsmetoder
- Exempel på Euler bakåt + Newton

10.1. Euler bakåt (Implicit euler).

Givet

$$\left. \begin{aligned} y'(t) &= f(t, y(t)) & a \leq t \leq b \\ y(a) &= \alpha \end{aligned} \right\}$$

Vi kollar istället riktningen i *nästa* punkt. Vi tar en punkt som gör att om jag går baklänges, så hamnar jag i (t_0, y_0)

$$y_1 = y_0 + hf(t_1, y_1)$$

Det vi gör är att vi söker y_1 som uppfyller den ekvationen. Finn y_{i+1} så att ett Eulersteg bakåt skulle ge y_i :

$$y_i = y_{i+1} - hf(t_{i+1}, y_{i+1})$$

Metoden antar ekvidistant steglängd:

$$\left. \begin{aligned} t_{i+1} &= t_1 + h & h &= \frac{b-a}{n} \\ y_{i+1} &= y_i + hf(t_{i+1}, y_{i+1}) \\ t_0 &= a \\ y_0 &= \alpha \end{aligned} \right\}$$

Kräver i allmänhet iterativ metod för att hitta y_{i+1} (tex. Newton). Denna har samma trunkeringsfel som Euler framåt. Denna metod kostar lite mer, beräkningsmässigt, men den är mer stabil.

10.2. Klassificering av metoder.

En *implicit metod* kan i allmänhet inte skrivas på formen:

$$y_{i+1} = HL$$

Där HL endast beror på tidigare punkter y_i, y_{i-1}, \dots

En *explicit metod* kan alltid skrivas på formen:

$$y_{i+1} = HL$$

Där HL endast beror på tidigare punkter.

En *enstegsmetod* är en metod som enbart beror på 1 tidigare steg, så y_1 beror på y_0 osv. Metoder:

- Euler framåt:
 - $y_{i+1} = y_i + hf(t_i, y_i)$
 - Explicit
 - Noggrannhetsordning 1 ($O(h)$)
- Euler bakåt:
 - $y_{i+1} = y_i + hf(t_{i+1}, y_{i+1})$

- Implicit
- Nogrannhetsordning 1 ($O(h)$)
- Heuns metod:
 - $k_1 = hf(t_i, y_i), \quad k_2 = hf(t_{i+1}, y_i + k_1) \quad y_{i+1} = y_i + \frac{1}{2}(k_1 + k_2)$
 - Explicit
 - Nogrannhetsordning 2
- Implicita trapetsmetoden:
 - $y_{i+1} = y_i + \frac{h}{2}f(t_i, y_i) + f(t_{i+1}, y_{i+1})$
 - Implicit
 - Nogrannhetsordning 2
- Klassisk Runge-Kutta (RK4):
 - $k_1 = hf(t_i, y_i), \quad k_2 = hf(t_i + \frac{h}{2}, y_i + \frac{k_1}{2}), \quad k_3 = hf(t_i + \frac{h}{2}, y_i + \frac{k_2}{2}), \quad k_4 = hf(t_{i+1}, y_i + k_3), \quad y_{i+1} = y_i + \frac{1}{6}(k_1 + 2k_2 + 2k_3 + k_4)$
 - Explicit
 - Nogrannhetsordning 4

En *flerstegsmetod* är en metod som beror på flera punkter, y_2 kan beror på både y_1 och y_0 . En metod som tillämpar detta kallas för *Leapfrog* ($y_{i+1} = y_{i-1} + 2hf(t_i, y_i)$).

10.3. Exempel på Euler bakåt + Newton.

Betrakta:

$$\begin{cases} y'(t) = \cos(y(t) \cdot t) \\ y(0) = 0 \end{cases}$$

$$\begin{cases} t_{i+1} = t_i + h \\ y_{i+1} = y_i + hf(t_{i+1}, y_{i+1}) = y_i + h \cos((y_{i+1}, t_{i+1})) \\ t_0 = 0 \\ y_0 = 0 \end{cases}$$

$$g(y_{i+1}) = y_{i+1} - y_i - h \cos(y_{i+1}, t_{i+1}) = 0$$

$$g'(y_{i+1}) = 1 - 0 - ht_{i+1} \sin(y_{i+1}, t_{i+1})$$

Newton för detta:

$$s = y_i \leftarrow \text{startgissning}$$

$$\Delta s = -\frac{g(s)}{g'(s)} = -\frac{s - y_i - h \cos(st_{i+1})}{1 + ht_{i+1} \sin(st_{i+1})}$$

$$s = s + \Delta s$$

10.4. Globala trunkeringsfel (enstegsmetoder).

Betrakta:

$$\begin{cases} y'(t) = f(t, y(t)) & a \leq t \leq b \\ y(a) = \alpha \end{cases}$$

$f(t, y)$ är lipschitz kontinuerlig i y :

$$\exists L : |f(t, y_1) - f(t, y_2)| \leq L |y_1 - y_2|$$

En enstegsmetod genererar $\{t_i = a + ih, y_i\}_{i=0}^n$ $h = \frac{b-a}{n}$. Låt $u'_i(t) = f(t, u_i(t))$ och $u_i(t_i) = y_i$ (begynnelsevärden från punkter som Euler genererat).

Antag att lokala trunkeringsfelen $|u_{i-1}(t_i) - y_i| \leq Ch^{p+1}$

Då gäller att det globala felet:

$$|y(b) - y_n| \leq Kh^p$$

En metod för begynnelsevärdesproblem är *konvergent* om:

$$\lim_{h \rightarrow 0} y_n = y(b) \quad nh = (b - a)$$

En enstegsmetod som har lokalt trunkeringsfel $L_i = |u_i(t_{i+1}) - y_{i+1}|$:

- Är *konsistent* om $\lim_{h \rightarrow 0} \frac{L_i}{h} = 0$
- Är konvergent om den är konsistent
- Har nogrannhetsordning p om $L_i = O(h^{p+1})$ när $h \rightarrow 0$