数值分析上机报告
第五章

院 (系) 名 称：　微电子学院

学 生 姓 名：　周玉乾

学　　号：　220205764

二〇二〇年十二月

第五章

数值积分

1. 问题

$$I = \int_0^1 \frac{\arctan x}{x^{\frac{3}{2}}} \mathrm{d}x \tag{5.1}$$

(1) 用 Romberg 公式计算改积分，使误差不超过 $\frac{1}{2} \times 10^{-7}$；

(2) 用复化 3 点 Gauss-Legendre 公式计算它，使误差不超过 $\frac{1}{2} \times 10^{-7}$。

2. 分析

复化 Romberg 公式的分析

(1) 首先用递推关系求梯形公式：

$$T_1 = h(\frac{1}{2}f(a) + \frac{1}{2}f(b)) \tag{5.2}$$

$$T_{2n} = \frac{1}{2}T_n + \frac{h(n)}{2}\sum\nolimits_{n=0}^{n-1} f(x_{k+1/2}) \tag{5.3}$$

(2) 利用梯形公式求 Simpson 公式：

$$S_n(f) = \frac{4}{3}T_{2n}(f) - \frac{1}{3}T_n(f) \tag{5.4}$$

(3) 利用 Simpson 公式求 Cotes 公式：

$$C_n(f) = \frac{16}{15}S_{2n}(f) - \frac{1}{15}S_n(f) \tag{5.5}$$

(4) 最后用 Cotes 求 Romberg 公式：

$$R_n(f) = \frac{64}{63}C_{2n}(f) - \frac{1}{63}C_n(f) \tag{5.6}$$

Gauss-Legendre 求积公式分析

(1) $[-1, 1]$ 上的 3 点 Gauss-Legendre 公式：

$$\int_{-1}^{1} g(x)\mathrm{d}x \approx \frac{5}{9}g(-\sqrt{\frac{3}{5}}) + \frac{8}{9}g(0) + \frac{5}{9}g(\sqrt{\frac{3}{5}}) \tag{5.7}$$

(2) 一般区间 $[a,b]$ 上的 Gauss 公式：

令 $x_k=\frac{a+b}{2}+\frac{b-a}{2}t_k$，$A_k=\frac{b-a}{2}\tilde{A}_k$，$k=0:n$

(3) 由于 Gauss 求积公式的节点不具有递推性，因此考虑用截断误差计算节点的数量，Gauss-Lengdre 公式的截断误差为：

$$R(f)=\int_a^b f(x)\mathrm{d}x-\sum_{k=0}^{n}A_kf(x_k)=\frac{f^{2n+2}(\xi)}{(2n+2)!}\int_a^b W_{n+1}^2(x)\mathrm{d}x,$$
$$W_{n+1}(x)=\prod_{j=0}^{n}(x-x_j),\quad \xi\in(a,b) \tag{5.8}$$

由于导数计算不太方便，并且还需要求函数的最大值，增加了程序的复杂性。考虑到使用分段积分可以极大地减少计算量（后面结论分析会给出一个分段与不分段计算时间的对比），因此用每次将区间长度减小一半，计算出一个 $R_n(f)$，用前后两次结果的差值作为误差判断的依据（后验误差），只要误差小于误差限，就停止计算。

待积函数分析

待求积分的函数为：

$$g(x)=\frac{\arctan x}{x^{3/2}} \tag{5.9}$$

该函数的图像如图5.1所示，是一个奇异函数，在 $x=0$ 处有奇异点，值为 $+\infty$，用 Romberg 公式求积时需要用到 $x=0$ 处的值。在 $[0,x_0]$ 上的积分用右矩形公式的两倍近似，即 $\int_0^{x_0}g(x)\mathrm{d}x\approx 2\cdot x_0\cdot g(x_0)$，保证近似值小于一半的误差限，即 $2\cdot x_0\cdot g(x_0)\le 1/2\times 1/2\times 10^{-7}$；

为了减少计算量，在 $[x_0,1]$ 上，做分段积分，分别对 $[x_0,1\times10^{-9}]$、$[1\times10^{-9},1\times10^{-4}]$、$[1\times10^{-4},1]$ 做 Romberg 积分，每一段的误差都要求小于 $1/6\times1/2\times10^{-7}$，这样保证总的误差不超过 $1/2\times10^{-7}$。

3. 程序

q3_romberg.py

```
import math
import time
import os, sys

RESULT_FILE = os.path.join(os.path.dirname(os.path.abspath(__file__)), '
    q3_romberg_result.txt')

def print_row(lst, n):
```

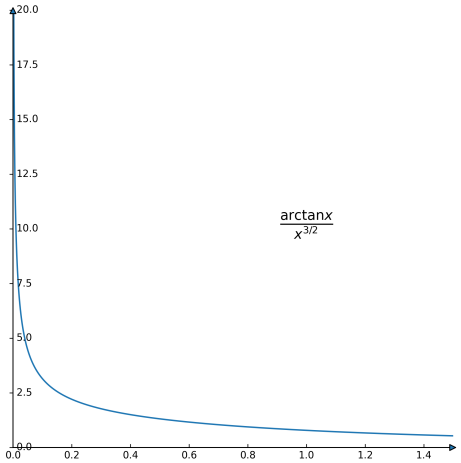

图 5.1　$(\arctan x)/(x^{3/2})$ 图像

```
8         print('n =: ', n, ', ',' '.join('%11.8f, ' % x for x in lst))
9         with open(RESULT_FILE, "a+") as fo:
10            fo.write('n: {0}, '.format(n))
11            for x in lst:
12                fo.write('{0}, '.format(x))
13            fo.write('\n')
14
15
16    def romberg(f, a, b, eps=1e-8):
17        """Approximate the definite integral of f from a to b by Romberg's method.
18        eps is the desired accuracy."""
19        R = [[0.5 * (b - a) * (f(a) + f(b))]] # R[0][0]
20        print_row(R[0], 1)
21        n = 1
22        while True:
23            h = float(b - a) / 2 ** n
24            R_row_tmp = []
25            R_row_tmp_0 = 0.5*R[n-1][0] + h*sum(f(a+(2*k-1)*h) for k in range(1, 2**(n
                  -1)+1))
26            R_row_tmp.append(R_row_tmp_0)
27            for m in range(1, min(n, 3)+1):
28                tmp = R_row_tmp[m-1] + (R_row_tmp[m-1] - R[n-1][m-1]) / (4 ** m - 1)
29                R_row_tmp.append(tmp)
30            R.append(R_row_tmp)
31            print_row(R[n], 2**n)
32            if n >= 4 and abs(R[n-1][3] - R[n][3])/255.0 < eps:
33                return R[n][-1]
34            n += 1
35
```

```
    '''
    DESCRIPTION: 处理反常积分奇异点为 0 的情况，返回
    RETURN {*}
    '''
    def Improper_deal(f, a, b, err=1e-8):
        m = 2
        x = a + (b-a)/m
        while 2.0*f(x)*x > err:
            m = m * 2.0
            x = a + (b-a)/m
        return x

    def expression0(x):
        return 1.0/x

    def expression1(x):
        return math.atan(x)/(pow(x, 1.5))

    def main():
        a = Improper_deal(expression1, 0, 1, (0.5e-7)/2.0)
        print(a)
        with open(RESULT_FILE, "a+") as fo:
            fo.write('a = {0}, '.format(a))
            fo.write('\n')
        print('int3')
        int3 = romberg(expression1, 1e-4, 1, (0.5e-7)/6.0) #
        print('int2')
        int2 = romberg(expression1, 1e-9, 1e-4, (0.5e-7)/6.0) #
        print('int1')
        int1 = romberg(expression1, a, 1e-9, (0.5e-7)/100.0) # 100.0
        int_all = int1+int2+int3
        print('result is {0} .'.format(int_all))
        with open(RESULT_FILE, "a+") as fo:
            fo.write('n: {0}, '.format(int_all))
            fo.write('\n')


    if __name__ == "__main__":
        time_start = time.time()
        if os.path.exists(RESULT_FILE):
            os.remove(RESULT_FILE)
        main()
        time_end=time.time()
        print('time cost {0} s. '.format(time_end - time_start))
        with open(RESULT_FILE, "a+") as fo:
            fo.write('time cost {0} s. \n'.format(time_end - time_start))
```

q3_gauss_legendre.py

```
1   import time
2   import math
3   import os, sys
4
5   RESULT_FILE = os.path.join(os.path.dirname(os.path.abspath(__file__)), '
        q3_gauss_legendre_result.txt')
6
7   def Gauss_Legendre(f, a, b):
8       Int = (b-a) * (5.0 * f(0.5*(a+b-(b-a)*pow(3.0/5.0, 0.5))) + \
9           8.0 * f(0.5*(a+b)) + 5.0 * f(0.5*(a+b+(b-a)*(pow(3.0/5.0, 0.5))))) /
                (9.0*2.0)
10      return Int
11
12  def Com_Gauss_Legendre(f, a, b, n):
13      h = (b-a)/n
14      Int_Sum = 0.0
15      for i in range(1, n+1):
16          x0 = a + (i - 1.0) * h
17          x1 = a + i * h
18          Int_Sum += Gauss_Legendre(f, x0, x1)
19      return Int_Sum
20
21  def Get_Com_Gauss_Legendre(f, a, b, err):
22      Int_Last = 0
23      i = 0
24      while True:
25          Int = Com_Gauss_Legendre(f, a, b, 2 ** i)
26
27          print('n: {0}, {1}'.format(2**i, Int))
28          with open(RESULT_FILE, "a+") as fo:
29              fo.write('n: {0}, {1} \n'.format(2**i, Int))
30
31          if abs(Int - Int_Last) <= err:
32              return Int, i
33          else:
34              Int_Last = Int
35              i += 1
36
37  def expression1(x):
38      return math.atan(x)/(pow(x, 1.5))
39
40  def main():
41      print('int3')
42      int3, n3 = Get_Com_Gauss_Legendre(expression1, 1e-5, 1, (0.5e-7)/6.0) #
43      print('int2')
44      int2, n2 = Get_Com_Gauss_Legendre(expression1, 1e-10, 1e-5, (0.5e-7)/6.0) #
```

```
        print('int1')
        int1, n1 = Get_Com_Gauss_Legendre(expression1, 0, 1e-10, (0.5e-7)/6.0) # 100.0
        int_all = int1+int2+int3
        n_times = 2**(n1+n2+n3)
        print('result is {0} , n is {1}'.format(int_all, n_times))
        with open(RESULT_FILE, "a+") as fo:
            fo.write('result is {0} , n is {1}'.format(int_all, n_times))
            fo.write('\n')

    if __name__ == "__main__":
        time_start = time.time()
        if os.path.exists(RESULT_FILE):
            os.remove(RESULT_FILE)
        main()
        time_end=time.time()
        print('time cost {0} s. '.format(time_end - time_start))
        with open(RESULT_FILE, "a+") as fo:
            fo.write('time cost {0} s. \n'.format(time_end - time_start))
```

4. 算例

$$I = \int_0^1 \frac{\arctan x}{x^{\frac{3}{2}}} \mathrm{d}x \tag{5.10}$$

分段的考虑是分 3 段，调整 3 段的长度，尽量使每一段上面的计算次数相等，这样应该可以使总的计算次数最少。

用 Romberg 求积公式的实际积分区间是 $[1.110223025 \times 10^{-16}, 1 \times 10^{-9}]$、$[1 \times 10^{-9}, 1 \times 10^{-4}]$、$[1 \times 10^{-4}, 1]$，计算出来的结果是：1.897097415；

用 Gauss-Legendre 求积公式实际积分区间是 $[0, 1 \times 10^{-10}]$、$[1 \times 10^{-10}, 1 \times 10^{-5}]$、$[1 \times 10^{-5}, 1]$，计算出来的结果是：1.897095603。

5. 结论

算术解的结果为（使用wolframalpha.com计算）：

$$y = -\frac{log(x - \sqrt{2x} + 1)}{\sqrt{2}} + \frac{log(x + \sqrt{2x} + 1)}{\sqrt{2}} - \sqrt{2}tan^{-1}(1 - \sqrt{2x}) + \sqrt{2}tan^{-1}(\sqrt{2x} + 1) - \frac{2tan^{-1}(x)}{\sqrt{x}} \tag{5.11}$$

因此准确解是：1.897095623。

复化 Romberg 公式

对比准确解可以看到，实际误差为 1.8×10^{-6}，大于所要求的的 $\frac{1}{2} \times 10^{-7}$，且计算值略大于真实值，分析后应该是在 $[x_0, 1 \times 10^{-9}]$ 这段上误差太大，因为在 x_0 处的值还是太大了，因此将这段的误差设为 $1/2 \times 10^{-9}$，其他两段的误差设定保持 $1/6 \times 1/2 \times 10^{-7}$，再次计算出来的结果是 1.897095976，误差是 3.5×10^{-7}，达到了误差的要求。

在没有分段积分时，程序跑了一周多也没有收敛到误差要求内，在设定好合适的分段积分区间后，程序只运行了 0.2 s 就收敛到误差要求内，效率提升很大。

Gauss-Legendre 求积公式

对比准确解可以看到，使用分段后的 Gauss-Legendre 求积公式计算结果的误差为 2.0^{-8}，达到了误差的要求。

与 Romberg 求积类似，在没有分段积分时，程序跑了一周多也没有收敛到误差要求内，在设定好合适的分段积分区间后，程序只运行了 1.9 s 就收敛到误差要求内，效率提升很大。

总结

计算奇异函数，分段计算很有必要，可以极大地减少计算量，提高计算速度。[1]

[1]所有的代码和 tex 格式的报告见https://github.com/Starrynightzyq/SEU-NumericalAnalysis-Exercises