

Pracownia z ANALIZY NUMERYCZNEJ

Lista nr 2

Początek zapisów: **18 listopada 2019 r.**

Termin realizacji: **31 grudnia 2019 r.**

Termin na poprawki (100%, podgrupa A): **19 stycznia 2020 r.**

Termin na poprawki (100%, podgrupa B): **26 stycznia 2020 r.**

Termin na poprawki (80%, podgrupa A): **26 stycznia 2020 r.**

Termin na poprawki (80%, podgrupa B): **2 lutego 2020 r.**

Punktacja (podana przy każdym zadaniu): **8–12 punktów**

Każde z zadań może być wybrane najwyżej przez trzy osoby (trzy zespoły dwuosobowe — w wypadku zadań P2.12, P2.19, P2.25) spośród wszystkich zapisanych na pracownię.

P2.1. 10 punktów Zrealizować efektywny algorytm obliczania wartości sumy

$$s_n(x) = \sum_{i=0}^n c_i T_i(x),$$

gdzie T_k jest k -tym wielomianem Czebyszewa. Zaburzyć wartości współczynników według wzoru $\tilde{c}_k := c_k(1 + \epsilon_k)$, wybierając losowo liczby ϵ_k z małego przedziału $[-\delta, \delta]$. Porównać wartości wielomianu $s_n(x)$ dla dokładnych i dla zaburzonych współczynników. Wykonać obliczenia **między innymi** dla wielomianów I_n i J_n z zadania **P2.8.**

P2.2. 10 punktów Wyznaczyć taki wielomian w możliwie najniższego stopnia, który spełnia nierówność

$$\sum_{k=0}^r [w(x_k) - f_k]^2 < \delta,$$

gdzie x_0, x_1, \dots, x_r są danymi punktami, f_0, \dots, f_r – danymi wartościami funkcji f w tych punktach, a δ – daną liczbą dodatnią. Wykonać obliczenia kontrolne **między innymi** dla następujących danych:

x_k	−1.00	−0.75	−0.50	−0.25	0	0.25	0.50	0.75	1.00
f_k	−0.2209	0.3295	0.8826	1.4392	2.0003	2.5645	3.1334	3.7061	4.2836

P2.3. 10 punktów Liniowe zadanie najmniejszych kwadratów, tzn. minimalizacji

$$\|\mathbf{Ax} - \mathbf{b}\|,$$

gdzie $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{m \times n}$, $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n$, $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^m$, przy czym $\|\cdot\|$ jest normą euklidesową, można sprowadzić do rozwiązywania układu równań liniowych z macierzą kwadratową układu (układ równań normalnych). Inna metoda polega na postawieniu dwóch układów równań liniowych,

$$\mathbf{r} = \mathbf{b} - \mathbf{Ax}, \quad \mathbf{A}^T \mathbf{r} = \mathbf{0},$$

gdzie $\mathbf{r} \in \mathbb{R}^m$, zapisaniu ich w postaci macierzowej jednego układu typu

$$\mathbf{B} \begin{bmatrix} \mathbf{r} \\ \mathbf{x} \end{bmatrix} = \mathbf{c},$$

gdzie $\mathbf{B} \in \mathbb{R}^{(n+m) \times (n+m)}$, $\mathbf{c} \in \mathbb{R}^{n+m}$, i rozwiązaniu takiego układu. Jaki jest koszt tej metody w porównaniu z metodą układu równań normalnych? Porównaj obie metody na podstawie wybranych testów. W jakich szczególnych wypadkach warto stosować przedstawioną w treści metodę?

- P2.4.** 8 punktów Skonstruować **naturalną funkcję sklejaną III stopnia** s , interpolującą daną funkcję f w $n + 1$ równoodległych punktach przedziału $[a, b]$. Obliczyć błąd

$$\hat{E}_N^{(n)} := \max_{x \in D_N} |f(x) - s(x)|,$$

gdzie D_N jest zbiorem N równoodległych punktów przedziału $[a, b]$. Wykonać obliczenia dla kilku par wartości n i N oraz dla funkcji (a) $f(x) = \sin x$, $0 \leq x \leq \pi$; (b) $f(x) = e^x$, $0 \leq x \leq 4$; (c) $f(x) = (x^2 + 1)^{-1}$, $x \in [-5, 5]$; (d) $f(x) = x/(x^2 + \frac{1}{4})$, $x \in [-\pi, \pi]$.

- P2.5.** 10 punktów Dla danej liczby naturalnej n , danych węzłów x_0, x_1, \dots, x_n ($a = x_0 < x_1 < \dots < x_n = b$) i danej funkcji f istnieje dokładnie jedna funkcja $\tilde{s} \in C^2[a, b]$, zwana **okresową funkcją sklejaną interpolacyjną III stopnia**, spełniająca następujące warunki:

1^o w każdym z podprzedziałów $[x_{k-1}, x_k]$ ($k = 1, 2, \dots, n$) funkcja \tilde{s} jest identyczna z pewnym wielomianem stopnia co najwyżej trzeciego;

$$2^o \tilde{s}(x_k) = f(x_k) \quad (k = 0, 1, \dots, n; f(x_n) = f(x_0));$$

$$3^o \tilde{s}^{(i)}(a + 0) = \tilde{s}^{(i)}(b - 0) \quad (i = 0, 1, 2).$$

Skonstruować funkcję sklejaną \tilde{s} dla kilku wartości n , równoodległych węzłów oraz m. in. dla funkcji $f(x) = \sin x$ ($0 \leq x \leq 2\pi$). W każdym wypadku obliczyć błąd

$$\mathcal{E}_N^{(n)} := \max_{x \in D_N} |f(x) - \tilde{s}(x)|,$$

gdzie D_N jest zbiorem N równoodległych punktów przedziału $[a, b]$.

- P2.6.** 10 punktów Wartości funkcji f znane są jedynie w punktach $x_0 < x_1 < \dots < x_n$ ($n \in \mathbb{N}$). Zaproponuj, jak wykorzystać naturalną funkcję sklejaną trzeciego stopnia do znalezienia przybliżonych wartości wszystkich rozwiązań równania $f(x) = c$ ($c \in \mathbb{R}$) leżących w przedziale (x_0, x_n) . Wykonując odpowiednie testy numeryczne, zbadaj czy pomysł ten sprawdza się w praktyce.

- P2.7.** 10 punktów Zrealizować algorytm, który dla danej funkcji f ciągłej w przedziale $[a, b]$, liczby naturalnej n oraz układu $n + 2$ punktów $D_n := \{x_0, x_1, \dots, x_{n+1}\} \subset [a, b]$ wyznacza n -ty wielomian optymalny w_n^* w sensie aproksymacji jednostajnej dla funkcji f na zbiorze D_n . Wykonać obliczenia dla wybranych funkcji f i wartości n w wypadku, gdy

$$(i) x_k = a + k \frac{b-a}{n+1}; \quad (ii) x_k = \frac{a+b}{2} - \frac{b-a}{2} \cos \frac{k\pi}{n+1} \quad (k = 0, 1, \dots, n+1).$$

Naszkicować wykres funkcji $e_n := f - w_n^*$ w przedziale $[a, b]$.

- P2.8.** 10 punktów Wielomian $I_n \in \Pi_n$ interpolujący funkcję f w węzłach

$$t_{n+1,k} = \cos \frac{2k+1}{2n+2} \pi \quad (k = 0, 1, \dots, n)$$

można zapisać w postaci

$$I_n(x) = \frac{2}{n+1} \sum_{i=0}^n \left(\sum_{j=0}^n f(t_{n+1,j}) T_i(t_{n+1,j}) \right) T_i(x),$$

a wielomian J_n o własności $J_n(u_{n-1,k}) = f(u_{n-1,k})$ ($k = 0, 1, \dots, n$), gdzie $u_{n-1,k} = \cos(k\pi/n)$, ($k = 0, 1, \dots, n$), można zapisać wzorem

$$J_n(x) = \frac{2}{n} \sum_{j=0}^n \left(\sum_{k=0}^n f(u_{n-1,k}) T_k(u_{n-1,j}) \right) T_j(x).$$

Wielomian $K_n \in \Pi_n$ podany wzorem

$$K_n(x) = \frac{2}{n+1} \sum_{j=0}^n \left(\sum_{k=0}^{n+1} f(u_{nk}) T_k(u_{nj}) \right) T_j(x)$$

jest n -tym wielomianem optymalnym w sensie aproksymacji jednostajnej dla funkcji f na zbiorze

$$\{u_{n0}, u_{n1}, \dots, u_{n,n+1}\},$$

gdzie $u_{nk} = \cos(k\pi/(n+1))$ ($k = 0, 1, \dots, n+1$). Dla wybranych funkcji f i wartości n obliczyć (w przybliżeniu) błędy aproksymacji jednostajnej funkcji f za pomocą I_n , J_n i K_n , w przedziale $[-1, 1]$.

Uwaga. Symbol \sum' oznacza sumę, której pierwszy składnik należy podzielić przez 2, a \sum'' – sumę, której pierwszy i ostatni składnik należy podzielić przez 2.

- P2.9.** 8 punktów Wykorzystaj aproksymację średniokwadratową, aby dopasować funkcję postaci $y = ab^x$ do danych

x	1	2	\dots	m
y	y_1	y_2	\dots	y_m

Opracowaną metodę przetestuj na wybranych przykładach.

Wskazówka: w zadaniu może się przydać procedura aproksymacji średniokwadratowej funkcją liniową.

- P2.10.** 10 punktów Niech p będzie wielomianem niewysokiego stopnia, np. równego 4. Obliczyć wartości tego wielomianu w 100 wybranych losowo punktach przedziału $[-1, 1]$. Zaburzyć te wartości dodając liczby losowe z małego przedziału, np. $[-\frac{1}{10}, \frac{1}{10}]$. Dla zaburzonych danych konstruować wielomiany optymalne w sensie aproksymacji średniokwadratowej, stopnia pierwszego, drugiego itd. Zinterpretować wyniki.

- P2.11.** 12 punktów Niech b_0, b_1, \dots, b_n będzie bazą przestrzeni P_n z iloczynem skalarnym $\langle \cdot, \cdot \rangle : P_n \times P_n \rightarrow \mathbb{R}$. Funkcje $d_0^{(n)}, d_1^{(n)}, \dots, d_n^{(n)}$ stanowią bazę dualną przestrzeni P_n względem iloczynu skalarnego $\langle \cdot, \cdot \rangle$, jeżeli spełniają następujące warunki:

$$(1) \quad \begin{cases} \text{span} \{d_0^{(n)}, d_1^{(n)}, \dots, d_n^{(n)}\} = P_n, \\ \langle b_i, d_j^{(n)} \rangle = \delta_{ij} \quad (0 \leq i, j \leq n), \end{cases}$$

gdzie δ_{ij} wynosi 1, jeżeli $i = j$ oraz 0 w przeciwnym wypadku. Dla danej bazy b_0, b_1, \dots, b_n , należy opracować algorytm wyznaczania bazy dualnej $d_0^{(n)}, d_1^{(n)}, \dots, d_n^{(n)}$, spełniającej warunki (1). Następnie, pokaż w jaki sposób wykorzystać własności baz dualnych do znalezienia elementu optymalnego p^* przestrzeni P_n , dla funkcji f , w sensie normy średniokwadratowej,

$$\|f - p^*\| = \min_{p \in P_n} \|f - p\|,$$

gdzie $\|\cdot\| = \sqrt{\langle \cdot, \cdot \rangle}$. W sprawozdaniu należy podać przykłady zastosowania opracowanej metody.

Literatura:

- [1] P. Woźny, Construction of dual bases, Journal of Computational and Applied Mathematics 245 (2013), 75–85.
- [2] P. Woźny, Construction of dual B-spline functions, Journal of Computational and Applied Mathematics 260 (2014), 301–311.

- P2.12.** Zadanie dla dwuosobowego zespołu. 10 punktów Zrealizować i porównać na przykładach dwie poznane metody konstrukcji wielomianów ortogonalnych P_0, P_1, \dots, P_r na danym zbiorze $\{x_0, x_1, \dots, x_r\}$ z wagą p :

a) metodę Grama-Schmidta ortogonalizacji układu $1, x, \dots, x^r$;

b) sposób korzystający ze związku rekurencyjnego, spełnianego przez P_0, P_1, \dots, P_r .

Wykonać obliczenia i zinterpretować wyniki **między innymi** dla zbioru punktów $\{u_0, u_1, \dots, u_r\}$, gdzie $u_k := \cos \frac{k\pi}{r}$ ($k = 0, 1, \dots, r$), oraz takiej wagi p , że

$$p(u_k) = \begin{cases} \frac{1}{2} & (k = 0, r), \\ 1 & (1 \leq k \leq r-1). \end{cases}$$

- P2.13.** 10 punktów Dla danego n i danych węzłów x_0, x_1, \dots, x_n wyznaczyć współczynniki kwadratury interpolacyjnej

$$\int_{-1}^1 f(x) dx \approx \sum_{k=0}^n A_k f(x_k)$$

stosując wzór

$$A_k = \frac{1}{\omega'(x_k)} \int_{-1}^1 \frac{\omega(x)}{x - x_k} dx, \quad \omega(x) = (x - x_0)(x - x_1) \dots (x - x_n).$$

Rozważyć (a) węzły równoodległe, (b) węzły będące zerami $(n+1)$ -go wielomianu Czebyszewa, (c) punkty ekstremalne n -tego wielomianu Czebyszewa. Wykonać obliczenia kontrolne **między innymi** dla funkcji podcałkowych:

$$f_1(x) = \frac{1}{x^4 + x^2 + 0.9}, \quad f_2(x) = \frac{4}{\pi(1+x^2)}, \quad f_3(x) = \frac{2\pi^2(1+x)}{(1-x)(3+x)} \sin \pi(1+x).$$

P2.14. 10 punktów Obliczyć przybliżoną wartość całki $\int_a^b f(x) dx$ przy założeniu, że znane są tylko wartości f w zadanych z góry punktach $a = t_0 < t_1 < \dots < t_n = b$. Wykonać obliczenia kontrolne, m.in., dla następujących funkcji podcałkowych:

$$f_1(x) = \frac{1}{x^4 + x^2 + 0.9}, \quad f_2(x) = \frac{4}{\pi(1+x^2)}, \quad f_3(x) = \frac{2\pi^2(1+x)}{(1-x)(3+x)} \sin \pi(1+x).$$

P2.15. 10 punktów Węzły równoodległe używane w kwadraturach Newtona-Cotesa bywają użyteczne dla wielomianów niskich stopni, ale mogą się okazać złym wyborem, gdy stopień jest wysoki. Należy rozważyć kwadratury dla całek postaci

$$\int_{-1}^1 f(x) dx$$

z węzłami interpolacyjnymi będącymi:

a) zerami wielomianu Czebyszewa pierwszego rodzaju $T_n(x)$ w przedziale $(-1, 1)$,

$$x_k = \cos \frac{(2k-1)\pi}{2n} \quad (k = 1, 2, \dots, n);$$

b) zerami wielomianu Czebyszewa drugiego rodzaju $U_{n-1}(x)$, które są punktami ekstremalnymi $T_n(x)$ w przedziale $(-1, 1)$,

$$(2) \quad x_k = \cos \frac{k\pi}{n} \quad (k = 1, 2, \dots, n-1);$$

c) wartościami danymi wzorem (2) wraz z $x_0 = 1$ i $x_n = -1$.

Podaj jawne wzory na wagi kwadratur w każdym z wymienionych wypadków. Przetestuj uzyskane kwadratury dla kilku wybranych funkcji f .

Literatura:

[1] G. Dahlquist, Å. Björck, *Numerical Methods in Scientific Computing*, Volume 1, SIAM, 2008.

P2.16. 10 punktów Zadanie polega na realizacji metody Romberga obliczania całki $I := \int_a^b f(x) dx$. Dla danych a, b, f i $\varepsilon > 0$ należy skonstruować K początkowych wierszy tablicy Romberga $\{T_{mk}\}$, gdzie K jest najmniejszą liczbą naturalną, dla której zachodzi nierówność

$$|T_{K0} - T_{K-1,0}| < \varepsilon |T_{K0}|.$$

Zapewnić możliwość drukowania pełnej tablicy błędów $\{|I - T_{mk}|/|I|\}$. Wykonać obliczenia kontrolne **między innymi** dla następujących całek:

$$\int_{-1}^1 \frac{1}{x^4 + x^2 + 0.9} dx, \quad \int_0^1 \frac{1}{1+x^4} dx, \quad \int_0^1 \frac{2}{2 + \sin(10\pi x)} dx.$$

P2.17. 10 punktów Wyprowadź wzory na współczynniki kwadratury Newtona-Cotesa

a) z dwoma węzłami (wzór trapezów),

b) z trzema węzłami (wzór Simpsona),

c) z czterema węzłami itd.

Następnie wykorzystaj otrzymane wzory do skonstruowania odpowiednich kwadratur złożonych. Przeprowadź eksperymenty numeryczne m.in. dla całek typu

$$\int_a^b P(x) dx, \quad \int_a^b \frac{P(x)}{Q(x)} dx, \quad \int_a^b R(\sin x, \cos x) dx,$$

gdzie P i Q są wielomianami, a R – funkcją wymierną dwu zmiennych. Wyciągnij wnioski.

- P2.18.** 12 punktów Wykorzystując poznane metody numerycznego obliczania całek oznaczonych, zaproponuj i zrealizuj algorytmy wyznaczania przybliżonej wartości całki podwójnej

$$\int_a^b \int_c^d f(x, y) dy dx.$$

Przeprowadź eksperymenty numeryczne m.in. dla całki

$$\int_0^1 \int_0^1 \frac{dy dx}{x^2 + y^2 + 1} = 0.639510351870311001962693085427323679 \dots$$

Literatura:

- [1] J. i M. Jankowscy, *Przegląd metod i algorytmów numerycznych, cz. 1*, WNT, 1988, str. 164–166.
 [2] A. Ralston, *Wstęp do analizy numerycznej*, PWN, 1971, str. 139–140.

- P2.19.** Zadanie dla dwuosobowego zespołu. 12 punktów Rozważać następujące sugestie co do sposobu obliczenia całek

$$I_c := \int_0^1 \frac{\cos x}{\sqrt{x}} dx \approx 1.809045218947 \quad I_s := \int_0^1 \frac{\sin x}{\sqrt{x}} dx \approx 0.620549071924.$$

- a) Użyć złożonego wzoru trapezów z $n + 1$ równoodległymi węzłami, „ignorując” osobliwość w $x = 0$ (tj. przyjmując arbitralnie zerową wartość funkcji podcałkowej dla $x = 0$). Wykonać obliczenia dla $n = 100(100)1000$.
 b) Wybrać małe $h > 0$, użyć złożonego wzoru trapezów z n równoodległymi węzłami do obliczenia całki \int_h^1 oraz (odpowiednio przekształconego) wzoru

$$\int_0^1 t^{-1/2} g(t) dt \approx \frac{4}{3} g(0) + \frac{2}{3} g(1)$$

do obliczenia całki \int_0^h . Wykonać obliczenia dla $n = 100(100)1000$.

- c) Zamienić zmienną całkowania według wzoru $x = t^2$, a następnie użyć złożonego wzoru trapezów z $n + 1$ równoodległymi węzłami. Wykonać obliczenia dla $n = 20(20)200$.
 d) Użyć kwadratury Gaussa-Legendre’a do obliczenia całek otrzymanych w punkcie c). Wykonać obliczenia dla $n = 1, 2, 3, 4$.

Skomentować otrzymane wyniki.

- P2.20.** 10 punktów Jak wiadomo, rzędem macierzy $A \in \mathbb{R}^{n \times m}$ nazywamy maksymalną liczbę jej liniowo niezależnych kolumn. Wykorzystując wiadomości podane na wykładzie z algebry liniowej, opracuj efektywny sposób wyznaczania rzędu macierzy. Następnie, wykonując odpowiednie testy numeryczne, sprawdź pod względem dokładności, skuteczności i stabilności zaproponowaną metodę.

- P2.21.** 10 punktów Stosując metodę eliminacji z wyborem częściowym elementów głównych obliczyć wyznacznik macierzy A . Zauważyć, że dla uniknięcia nadmiaru lub niedomiaru warto informację o $\det A$ podać w postaci:

$$\sigma, \quad \log |\det A|,$$

gdzie $\sigma := \operatorname{sgn} \det A$. Wykonać obliczenia kontrolne m.in. dla macierzy Pei i Hilberta oraz omówić wyniki, przyjmując różne wartości parametrów n i d (w tym $-d \approx 1$).

- P2.22.** 10 punktów Zaproponować algorytm rozwiązywania układu równań postaci

$$\begin{bmatrix} d_1 & c_1 & & & \\ a_1 & d_2 & c_2 & & \\ & a_2 & d_3 & c_3 & \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ & & a_{n-2} & d_{n-1} & c_{n-1} \\ & & & a_{n-1} & d_n \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ \vdots \\ x_{n-1} \\ x_n \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} b_1 \\ b_2 \\ b_3 \\ \vdots \\ b_{n-1} \\ b_n \end{bmatrix}.$$

Czy uprości sprawę (jak?) założenie, że stałe a_i, c_i, d_i spełniają nierówności

$$|a_{i-1}| - |d_i| + |c_i| < 0 \quad (i = 1, 2, \dots, n; a_0 := c_n := 0)?$$

Wykonać obliczenia kontrolne i omówić wyniki, podając wartość $\|\mathbf{b} - A\tilde{\mathbf{x}}\|_\infty$, gdzie $\tilde{\mathbf{x}}$ jest obliczonym rozwiązaniem.

- P2.23.** 10 punktów Dla danej macierzy kwadratowej $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ wartość własna λ i odpowiadający jej wektor własny $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n$ spełniają równanie $A\mathbf{x} = \lambda\mathbf{x}$. Zastosować tzw. *metodę Jacobiego* diagonalizacji rzeczywistej macierzy symetrycznej $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ do znajdowania wszystkich jej wartości (wektorów) własnych. Zobacz np. [1, §10.4.1, s. 497]. Wykonać odpowiednie doświadczenia numeryczne z analizą złożoności, zbieżności i stabilności opracowanej metody.

Literatura

[1] A. Ralston, *Wstęp do analizy numerycznej*, PWN, 1965.

- P2.24.** 12 punktów Załóżmy, że znany jest rozkład LU macierzy nieosobliwej $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$. W wielu zadaniach praktycznych należy wyznaczyć rozkład LU macierzy A^* danej wzorem $A^* := A + \mathbf{u}\mathbf{v}^t$, gdzie $\mathbf{u}, \mathbf{v} \in \mathbb{R}^n$ są danymi wektorami. Patrz np. [1, §6.3]. Zaproponuj szybki algorytm znajdowania rozkładu LU macierzy A^* . Wykonaj odpowiednie testy numeryczne sprawdzające jego stabilność i skuteczność.

Literatura:

[1] A. Kiełbasiński, H. Schwetlick, *Numeryczna algebra liniowa*, WNT, 1992.

- P2.25.** Zadanie dla dwuosobowego zespołu. 12 punktów Porównać na wybranych przykładach cztery warianty metody eliminacji rozwiązywania układów równań liniowych – pod względem dokładności wyników:

- a) bez wyboru elementów głównych,
- b) z pełnym wyborem elementów głównych,
- c) z wyborem elementów głównych w kolumnach,
- d) z wyborem elementów głównych w wierszach.

Wykonać obliczenia kontrolne i omówić wyniki, podając dla każdego z wariantów wartość $\|\mathbf{b} - A\tilde{\mathbf{x}}\|_\infty$, gdzie $\tilde{\mathbf{x}}$ jest obliczonym rozwiązaniem.