

Table of Contents

- [1 概要:補間と近似](#)
- [2 多項式補間\(polynomial interpolation\)](#)
- [3 Lagrange\(ラグランジュ\)の内挿公式](#)
- [3.0.1 python code](#)
- [4 Newton\(ニュートン\)の差分商公式](#)
- [4.1 Newton補間と多項式補間の一致の検証](#)
- [5 数値積分 \(Numerical integration\)](#)
- [5.1 中点則 \(midpoint rule\)](#)
- [5.2 台形則 \(trapezoidal rule\)](#)
- [5.3 Simpson\(シンプソン\)則](#)
- [6 数値積分のコード](#)
- [6.0.0.1 Midpoint rule\(中点法\)](#)
- [6.0.0.2 Trapezoidal rule\(台形公式\)](#)
- [6.0.0.3 Simpson's rule\(シンプソンの公式\)](#)
- [7 課題](#)
- [7.1 補間法](#)
- [7.2 対数関数のニュートンの差分商補間\(2014期末試験, 25点\)](#)
- [7.2.1 差分商補間の表中の開いている箇所\[XXX\]を埋めよ。](#)
- [7.2.2 ニュートンの二次多項式](#)
- [7.2.3 ニュートンの三次多項式の値を求めよ。](#)
- [7.3 数値積分\(I\)](#)
- [8 解答例\[7.3\]](#)

補間(interpolation)と数値積分(Integral)

file:/Users/bob/Github/TeamNishitani/jupyter_num_calc/interpolationintegral
https://github.com/daddygongon/jupyter_num_calc/tree/master/notebooks_pythor
 cc by Shigeto R. Nishitani 2017

概要:補間と近似

単純な2次元データについて補間と近似を考える。補間はたんに点を「滑らかに」つなぐことを、近似はある関数にできるだけ近くなるように「フィット」することを言う。補間はIllustratorなどのドロー系ツールで曲線を引くときの、ベジエやスプライン補間の基本となる。本章では補間とそれに密接に関連した積分について述べる。

```
In [20]: %matplotlib inline

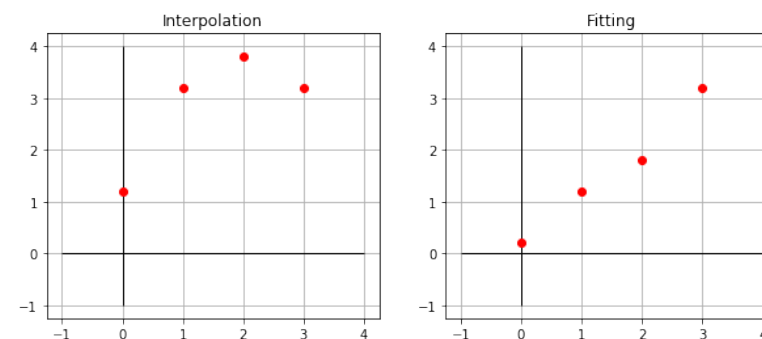
import matplotlib.pyplot as plt
import numpy as np

fig, (axL, axR) = plt.subplots(ncols=2, figsize=(10,4))

x = np.array([0,1,2,3])
y = np.array([1.2,3.2,3.8,3.2])
for i in range(0,4):
    axL.plot(x[i],y[i], 'o', color='r')
axL.hlines(0, -1, 4, linewidth=1)
axL.vlines(0, -1, 4, linewidth=1)
axL.set_title('Interpolation')
axL.grid(True)

x = np.array([0,1,2,3])
y = np.array([0.2,1.2,1.8,3.2])
for i in range(0,4):
    axR.plot(x[i],y[i], 'o', color='r')
axR.hlines(0, -1, 4, linewidth=1)
axR.vlines(0, -1, 4, linewidth=1)
axR.set_title('Fitting')
axR.grid(True)

# fig.show()
```



多項式補間(polynomial interpolation)

データを単純に多項式で補間する方法を先ず示そう。 $N + 1$ 点を N 次の多項式でつなぐ。 この場合の補間関数は、

$$F(x) = \sum_{i=0}^N a_i x^i = a_0 + a_1 x + a_2 x^2 + \cdots + a_N x^N$$

である。 データの点を $(x_i, y_i), i = 0..N$ とすると

$$\begin{aligned} a_0 + a_1 x_0 + a_2 x_0^2 + \cdots + a_N x_0^N &= y_0 \\ a_0 + a_1 x_1 + a_2 x_1^2 + \cdots + a_N x_1^N &= y_1 \\ &\vdots \\ a_0 + a_1 x_N + a_2 x_N^2 + \cdots + a_N x_N^N &= y_N \end{aligned}$$

が、 係数 a_i を未知数と見なした線形の連立方程式となっている。 係数行列は

$$A = \begin{bmatrix} 1 & x_0 & x_0^2 & \cdots & x_0^N \\ 1 & x_1 & x_1^2 & \cdots & x_1^N \\ \vdots & & & & \vdots \\ 1 & x_N & x_N^2 & \cdots & x_N^N \end{bmatrix}$$

となる。 a_i と y_i をそれぞれベクトルとみなすと

A と b から $\mathbf{a_i}$ を導出：

により未知数ベクトル $\mathbf{a_i}$ が求まる。 これは単純に、 前に紹介した Gauss の消去法や LU 分解で解ける。

Lagrange(ラグランジュ) の内挿公式

多項式補間は手続きが簡単であるため、 計算間違いが少なく、 プログラムとして組むのに適している。 しかし、 あまり"みとうし"のよい方法とはいえない。 その点、 Lagrange(ラグランジュ)の内挿公式は見通しがよい。 これは

$$F(x) = \sum_{k=0}^N \frac{\prod_{j \neq k} (x - x_j)}{\prod_{j \neq k} (x_k - x_j)} y_k = \sum_{k=0}^N \frac{\frac{(x-x_0)(x-x_1)\cdots(x-x_N)}{(x-x_k)}}{\frac{(x_k-x_0)(x_k-x_1)\cdots(x_k-x_N)}{(x_k-x_k)}} y_k$$

と表わされる。 数学的に 2 つ目の表記は間違っているが、 先に割り算を実行すると読み取って欲しい。 これは一見複雑に見えるが、 単純な発想から出発している。 求めたい関数 $F(x)$ を

$$F(x) = y_0 L_0(x) + y_1 L_1(x) + y_2 L_2(x)$$

とすると

$$\begin{aligned} L_0(x_0) &= 1 & L_0(x_1) &= 0 & L_0(x_2) &= 0 \\ L_1(x_0) &= 0 & L_1(x_1) &= 1 & L_1(x_2) &= 0 \\ L_2(x_0) &= 0 & L_2(x_1) &= 0 & L_2(x_2) &= 1 \end{aligned}$$

となるように関数 $L_i(x)$ を決めればよい。 これを以下のようにとればLagrangeの内挿公式となる。

$L_0(x)$ ：

$L_1(x)$ ：

$L_2(x)$ ：

$F(x)$ ：

python code

pythonではLagrange補間はinterpolate.lagrangeで用意されている。

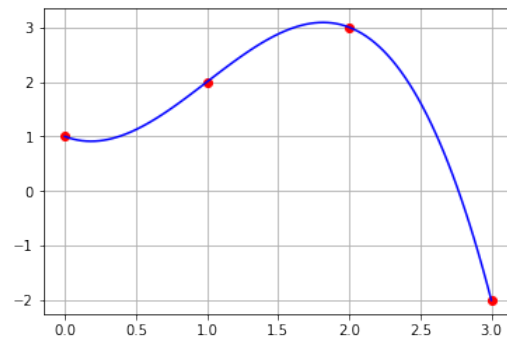
```
In [11]: import numpy as np
from scipy import interpolate
import matplotlib.pyplot as plt

# もとの点
x = np.array([0,1,2,3])
y = np.array([1,2,3,-2])
for i in range(0,4):
    plt.plot(x[i],y[i], 'o',color='r')

# Lagrange補間
f = interpolate.lagrange(x,y)
print(f)
x = np.linspace(0,3, 100)
y = f(x)
plt.plot(x, y, color = 'b')

plt.grid()
plt.show()
```

3 2
-1 x + 3 x - 1 x + 1



Newton(ニュートン) の差分商公式

もう一つ有名なNewton(ニュートン) の内挿公式は,

$$F(x) = F(x_0) + (x - x_0)f_1[x_0, x_1] + (x - x_0)(x - x_1)f_2[x_0, x_1, x_2] + \dots + \prod_{i=0}^{n-1} (x - x_i)f_n[x_0, x_1, \dots, x_n]$$

となる. ここで $f_i[\]$ は次のような関数を意味していて,

$$\begin{aligned} f_1[x_0, x_1] &= \frac{y_1 - y_0}{x_1 - x_0} \\ f_2[x_0, x_1, x_2] &= \frac{f_1[x_1, x_2] - f_1[x_0, x_1]}{x_2 - x_0} \\ &\vdots \\ f_n[x_0, x_1, \dots, x_n] &= \frac{f_{n-1}[x_1, x_2, \dots, x_n] - f_{n-1}[x_0, x_1, \dots, x_{n-1}]}{x_n - x_0} \end{aligned}$$

差分商と呼ばれる. 得られた多項式は, Lagrange の内挿公式で得られたものと当然一致する. Newton の内挿公式の利点は, 新たなデータ点が増えたときに, 新たな項を加えるだけで, 内挿式が得られる点である.

```
In [1]: # https://stackoverflow.com/questions/14823891/newton-s-interpolati
ng-polynomial-python
# by Khalil Al Hooti (stackoverflow)
```

```
def _poly_newton_coefficient(x,y):
    """
    x: list or np array containing x data points
    y: list or np array containing y data points
    """

    m = len(x)

    x = np.copy(x)
    a = np.copy(y)
    for k in range(1,m):
        a[k:m] = (a[k:m] - a[k-1])/(x[k:m] - x[k-1])

    return a

def newton_polynomial(x_data, y_data, x):
    """
    x_data: data points at x
    y_data: data points at y
    x: evaluation point(s)
    """

    a = _poly_newton_coefficient(x_data, y_data)
    n = len(x_data) - 1 # Degree of polynomial
    p = a[n]
    for k in range(1,n+1):
        p = a[n-k] + (x - x_data[n-k])*p
    return p
```

```
In [4]: import numpy as np
from scipy import interpolate
import matplotlib.pyplot as plt

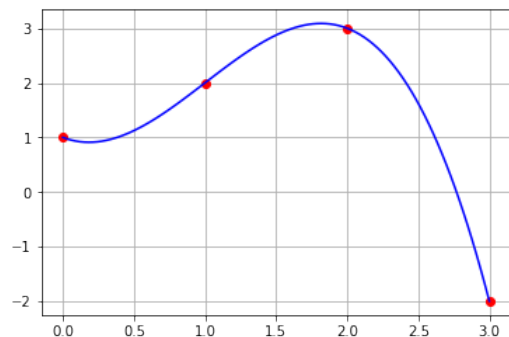
# もとの点
x = np.array([0,1,2,3])
y = np.array([1,2,3,-2])
for i in range(0,4):
    plt.plot(x[i],y[i], 'o',color='r')

print(_poly_newton_coefficient(x,y))

xx = np.linspace(0,3, 100)
yy = newton_polynomial(x, y, xx)
plt.plot(xx, yy, color = 'b')

plt.grid()
plt.show()
```

```
[ 1  1  0 -1]
```



Newton補間と多項式補間の一致の検証

関数 $F(x)$ を x の多項式として展開。その時の、係数の取るべき値と、差分商で得られる値が一致。

```
maple
> restart: F:=x->f0+(x-x0)*f1p+(x-x0)*(x-x1)*f2p;


$$F := x \mapsto f_0 + (x - x_0)f_{1p} + (x - x_0)(x - x_1)f_{2p}$$

```

```
maple
> F(x1);
sf1p:=solve(F(x1)=f1,f1p);
```

$$f_0 + (x_1 - x_0)f_{1p}$$

$$sf_{1p} := \frac{f_0 - f_1}{-x_1 + x_0}$$

f20の取るべき値の導出

```
maple
> sf2p:=solve(F(x2)=f2,f2p);
fac_f2p:=factor(subs(f1p=sf1p,sf2p));
```

$$sf_{2p} := -\frac{f_0 + f_{1p}x_2 - f_{1p}x_0 - f_2}{(-x_2 + x_0)(-x_2 + x_1)}$$

$$fac_f2p := \frac{f_0x_1 - x_2f_0 + x_2f_1 - x_0f_1 - f_2x_1 + f_2x_0}{(-x_1 + x_0)(-x_2 + x_0)(-x_2 + x_1)}$$

ニュートンの差分商公式を変形

```
maple
> ff11:=(f0-f1)/(x0-x1);
ff12:=(f1-f2)/(x1-x2);
ff2:=(ff11-ff12)/(x0-x2);
fac_newton:=factor(ff2);
```

$$ff_{11} := \frac{f_0 - f_1}{-x_1 + x_0}$$

$$ff_{12} := \frac{f_1 - f_2}{-x_2 + x_1}$$

$$ff_2 := \frac{\frac{f_0 - f_1}{-x_1 + x_0} - \frac{f_1 - f_2}{-x_2 + x_1}}{-x_2 + x_0}$$

$$fac_newton := \frac{f_0x_1 - x_2f_0 + x_2f_1 - x_0f_1 - f_2x_1 + f_2x_0}{(-x_1 + x_0)(-x_2 + x_0)(-x_2 + x_1)}$$

二式が等しいかどうかをevalbで判定

```
maple
> evalb(fac_f2p=fac_newton);
```

true

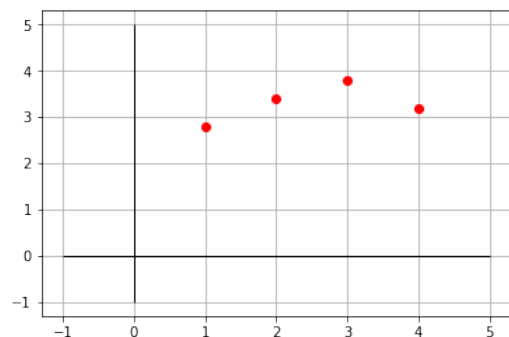
数値積分 (Numerical integration)

In [1]: %matplotlib inline

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

x = np.array([1,2,3,4])
y = np.array([2.8,3.4,3.8,3.2])
for i in range(0,4):
    plt.plot(x[i],y[i], 'o', color='r')
plt.hlines(0, -1, 5, linewidth=1)
plt.vlines(0, -1, 5, linewidth=1)
plt.grid(True)
```

数値積分の模式図



積分,

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

を求めよう。1次元の数値積分法では連続した領域を細かい短冊に分けて、それぞれの面積を寄せ集めることに相当する。分点の数を N とすると、

$$x_i = a + \frac{b-a}{N}i = a + h \times i$$

$$h = \frac{b-a}{N}$$

ととれる。そうすると、もっとも単純には、

$$I_N = \left\{ \sum_{i=0}^{N-1} f(x_i) \right\} h = \left\{ \sum_{i=0}^{N-1} f(a + i \times h) \right\} h$$

となる。

中点則 (midpoint rule)

中点法 (midpoint rule) は、短冊を左端から書くのではなく、真ん中から書くことに対応し、

$$I_N = \left\{ \sum_{i=0}^{N-1} f\left(a + \left(i + \frac{1}{2}\right) \times h\right) \right\} h$$

となる。

台形則 (trapezoidal rule)

さらに短冊の上側を斜めにして、短冊を台形にすれば精度が上がりそうに思う。その場合は、短冊一枚の面積 S_i は、

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

で求まる。これを端から端まで加えあわせると、

$$I_N = \sum_{i=0}^{N-1} S_i = h \left\{ \frac{1}{2}f(x_0) + \sum_{i=1}^{N-1} f(x_i) + \frac{1}{2}f(x_N) \right\}$$

が得られる。

Simpson(シンプソン)則

Simpson(シンプソン) 則では、短冊を2次関数、

$$f(x) = ax^2 + bx + c$$

で近似することに対応する。こうすると、

$$S_i = \int_{x_i}^{x_{i+1}} f(x) dx = \int_{x_i}^{x_{i+1}} (ax^2 + bx + c) dx$$

Simpson則の導出（数式変形）：

$$\frac{h}{6} \left\{ f(x_i) + 4f\left(x_i + \frac{h}{2}\right) + f(x_{i+1}) \right\}$$

となる。これより、

$$I_N = \frac{h}{6} \left\{ f(x_0) + 4 \sum_{i=0}^{N-1} f\left(x_i + \frac{h}{2}\right) + 2 \sum_{i=1}^{N-1} f(x_i) + f(x_N) \right\}$$

として計算できる。ただし、関数値を計算する点の数は台形則などの倍となっている。

教科書によっては、分割数 N を偶数にして、点を偶数番目(even)と奇数番目(odd)に分けて、

$$I_N = \frac{h}{3} \left\{ f(x_0) + 4 \sum_{i=even}^{N-2} f\left(x_i + \frac{h}{2}\right) + 2 \sum_{i=odd}^{N-1} f(x_i) + f(x_N) \right\}$$

としている記述があるが、同じ計算になるので誤解せぬよう。

数値積分のコード

次の積分を例に、pythonのコードを示す。

$$\int_0^1 \frac{4}{1+x^2} dx$$

まずは問題が与えられたらできるだけお任せで解いてしまう。答えをあらかじめ知っておくと間違いを見つけるのが容易。プロットしてみる。

scipyで積分計算をお任せでしてくれる関数はquadで、これはFortran libraryのQUADPACKを利用している。自動で色々してくれるが、精度は1.49e_08以下。

```
In [18]: import matplotlib.pyplot as plt
from scipy import integrate

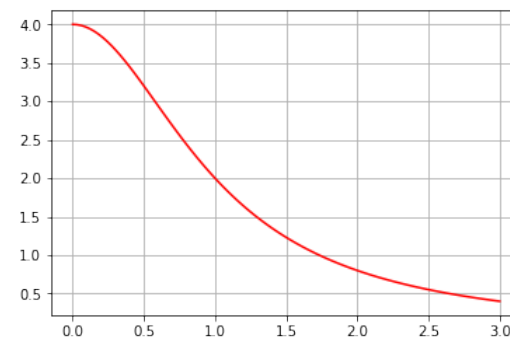
def func(x):
    return 4.0/(1.0+x**2)

x = np.linspace(0,3, 100)
y = func(x)

plt.plot(x, y, color = 'r')

plt.grid()
plt.show()

print(integrate.quad(func, 0, 1))
```



(3.1415926535897936, 3.4878684980086326e-14)

なんだろうかもしれないが,

```
maple
>int(1/(1+x^2),x);
```

$\arctan(x)$

となるので、納得できるでしょう.

Midpoint rule(中点法)

```
In [26]: def func(x):
          return 4.0/(1.0+x**2)

N, x0, xn = 8, 0.0, 1.0

h = (xn-x0)/N
S = 0.0
for i in range(0, N):
    xi = x0 + (i+0.5)*h
    dS = h * func(xi)
    S = S + dS

print(S)

3.142894729591689
```

Trapezoidal rule(台形公式)

```
In [5]: def func(x):
          return 4.0/(1.0+x**2)

N, x0, xn = 8, 0.0, 1.0

h = (xn-x0)/N
S = func(x0)/2.0
for i in range(1, N):
    xi = x0 + i*h
    dS = func(xi)
    S = S + dS
    print("{0}".format(i))

S = S + func(xn)/2.0
print(h*S)

1
2
3
4
5
6
7
3.138988494491089
```

Simpson's rule(シンブソンの公式)

```
In [40]: def func(x):
        return 4.0/(1.0+x**2)

N, x0, xn = 8, 0.0, 1.0

M = int(N/2)
h = (xn-x0)/N
Seven, Sodd = 0.0, 0.0
for i in range(1, 2*M, 2): #rangeの終わりに注意
    xi = x0 + i*h
    Sodd += func(xi)
    print("{0}".format(i))
for i in range(2, 2*M, 2):
    xi = x0 + i*h
    Seven += func(xi)
    print("{0}".format(i))

print(h*( func(x0)+4*Sodd+2*Seven+func(xn) )/3)

1
3
5
7
2
4
6
3.141592502458707
```

課題

補間法

次の4点

maple
x y
0 1
1 2
2 3
3 1

を通る多項式を(a)ラグランジュ補間, (b)逆行列で求めよ.

対数関数のニュートンの差分商補間(2014期末試験, 25点)

2を底とする対数関数(Mapleではlog[2](x))のF(9.2) = 2.219203をニュートンの差分商補間を用いて求める. ニュートンの内挿公式は,

$$F(x) = F(x_0) + (x - x_0)f_1[x_0, x_1] + (x - x_0)(x - x_1)f_2[x_0, x_1, x_2] + \cdots + \prod_{i=0}^{n-1}(x - x_i)f_n[x_0, x_1, \cdots, x_n]$$

である. ここで $f_i[\]$ は次のような関数を意味していて,

$$\begin{aligned} f_1[x_0, x_1] &= \frac{y_1 - y_0}{x_1 - x_0} \\ f_2[x_0, x_1, x_2] &= \frac{f_1[x_1, x_2] - f_1[x_0, x_1]}{x_2 - x_0} \\ &\vdots \\ f_n[x_0, x_1, \cdots, x_n] &= \frac{f_{n-1}[x_1, x_2, \cdots, x_n] - f_{n-1}[x_0, x_1, \cdots, x_{n-1}]}{x_n - x_0} \end{aligned}$$

差分商と呼ばれる. $x_k = 8.0, 9.0, 10.0, 11.0$ をそれぞれ選ぶと, 差分商補間のそれぞれの項は以下の通りとなる.

k	x_k	$y_k = F_0(x_k)$	$f_1[x_k, x_{k+1}]$	$f_2[x_k, x_{k+1}, x_{k+2}]$	$f_3[x_k, x_{k+1}, x_{k+2}, x_{k+3}]$
0	8.0	2.079442	0.117783		
1	9.0	2.197225	[XXX]		
			0.105360		0.0003955000
2	10.0	2.302585		-0.0050250	
				0.095310	
3	11.0	2.397895			

それぞれの項は, 例えば,

$$f_2[x_1, x_2, x_3] = \frac{0.095310 - 0.105360}{11.0 - 9.0} = -0.0050250$$

で求められる. ニュートンの差分商の一次多項式の値は $x=9.2$ で

$$F(x) = F_0(8.0) + (x - x_0)f_1[x_1, x_0] = 2.079442 + 0.117783(9.2 - 8.0) = 2.220782$$

となる.

差分商補間の表中の開いている箇所[XXX]を埋めよ.

ニュートンの二次多項式

$$F(x) = F(x_0) + (x - x_0)f_1[x_0, x_1] + (x - x_0)(x - x_1)f_2[x_0, x_1, x_2]$$

の値を求めよ.

ニュートンの三次多項式の値を求めよ.

ただし, ここでは有効数字7桁程度はとるように. (E.クライツィグ著「数値解析」(培風館,2003), p.31, 例4改)

数値積分(I)

次の関数

$$f(x) = \frac{4}{1+x^2}$$

を $x = 0..1$ で数値積分する.

1. N を 2,4,8,...256 ととり, N 個の等間隔な区間にわけて中点法で求めよ. (15)
2. 小数点以下10桁まで求めた値3.141592654との差をdXとする. dXと分割数Nとを両対数プロット(loglogplot)して比較せよ(10) (2008年度期末試験)

解答例[7.3]

```
In [2]: import numpy as np

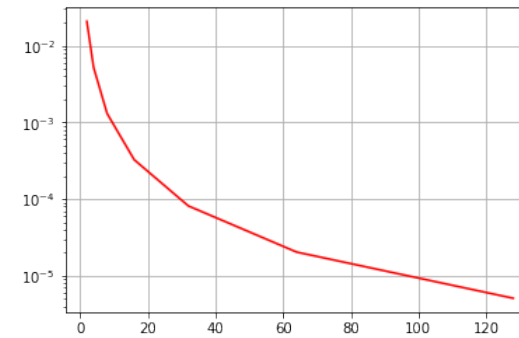
def func(x):
    return 4.0/(1.0+x**2)

def mid(N):
    x0, xn = 0.0, 1.0

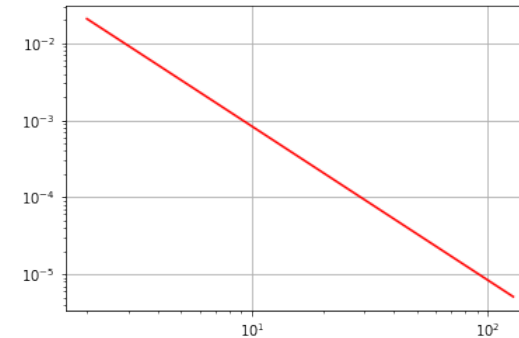
    h = (xn-x0)/N
    S = 0.0
    for i in range(0, N):
        xi = x0 + (i+0.5)*h
        dS = h * func(xi)
        S = S + dS
    return S

x, y = [], []
for i in range(1,8):
    x.append(2**i)
    y.append(abs(mid(2**i)-np.pi))
```

```
In [3]: plt.plot(x, y, color = 'r')
plt.yscale('log')
plt.grid()
plt.show()
```



```
In [4]: plt.plot(x, y, color = 'r')
plt.yscale('log')
plt.xscale('log')
plt.grid()
plt.show()
```



In []: