

Ville Väänänen

Numeerinen integrointi: kvadratuureista kubatuureihin

Elektroniikan, tietoliikenteen ja automaation tiedekunta

Kandidaatintyö
Espoo 10.5.2010

Vastuopettaja:

Prof. Markus Turunen

Työn ohjaaja:

TkT Simo Särkkä



Aalto-yliopisto
Teknillinen korkeakoulu

Esipuhe

Espoo 10.5.2010

1cm

Sisältö

| | |
|---|------------|
| Esipuhe | iii |
| Sisällysluettelo | iv |
| 1 Johdanto | 1 |
| 2 Integraali | 2 |
| 2.1 Geometrinen tulkinta | 2 |
| 2.2 Numeerisia menetelmiä | 2 |
| 2.2.1 Polynomiinterpolatio | 3 |
| 2.2.2 Eulerin menetelmä | 5 |
| 2.2.3 Simpsonin menetelmä | 5 |
| 3 Yksiulotteinen kvadratuuri-integrointi | 5 |
| 3.1 Ortogonaaliset polynomikannat | 5 |
| 3.2 Gaussinen kvadratuuri | 5 |
| 3.3 Gauss-Hermite kvadratuuri | 5 |
| 3.4 Muita Gaussisia kvadratuureja | 5 |
| 4 Moniulotteinen kvadratuuri-integrointi | 5 |
| 4.1 Tulosäännöt | 5 |
| 4.2 Kubatuurit | 5 |
| 4.2.1 Gauss-Hermite | 5 |
| 4.3 Muita menetelmiä | 5 |
| 5 Koeasetelma | 5 |
| 6 Tulokset | 5 |
| 7 Yhteenveto | 5 |
| Viitteet | 6 |

1 Johdanto

Pinta-alojen ja tilavuuksien määrittäminen on tavallinen ongelma matematiikan ja fysiikan sovelluksissa. Ei siis ole yllättävää, että jo kauan on tiedetty keinoja muuntaa pinta-aloja *kvadratuureiksi*, samansuuruisiksi suorakulmioiksi. Matemaattinen työkalu jolla on läheinen yhteys edellä mainittuun ongelmaan on nimeltään *integraali*. Tänä päivänä tekniikan alan ammattilaiset arkkitehteistä tilastotieteilijöihin tarvitsevat työssään tarkkoja ja tehokkaita keinoja integraalien määrittämiseen.

Numeerinen integrointi on sovelletun matematiikan alalaji, joka pyrkii vastaamaan tähän tarpeeseen. Alalta on aikojen saatossa julkaistu suunnaton määrä tutkimustuloksia ja kirjallisuutta, joten minkä tahansa käytännössä esiintyvän integraalin ratkaisemiseen voisi olettaa löytyvän laskennallisesti tehokas ratkaisualgoritmi. Näin todennäköisesti onkin mikäli ongelmallinen integraali on määritelty ainoastaan yhdessä ulottuvuudessa. Jos kuitenkin dimensioita on enemmän, on ongelma, ehkä hieman yllättäen, kaikkea muuta kuin ratkaistu.

Tässä kandidaatintyössä pyritään esittämään syitä siihen miksi näin on. Samalla luodaan katsaus niihin ongelmiin joihin törmätään, kun yhdessä ulottuvuudessa niin erinomaisia tuloksia tuottavia *Gaussisia kvadratuureja* yritetään soveltaa useassa ulottuvuudessa.

Teoreettisen selvityksen jälkeen vertaillaan eräitä kiinnostavia menetelmiä keskenään soveltamalla niitä esimerkki-integraaleihin useissa eri dimensioissa. Saatujen tulosten ja esitellyn teorian perusteella tehdään päätelmiä menetelmien soveltuvuudesta erilaisiin tilanteisiin.

[2, 5, 8, 4, 3, 7, 9, 6, 10, 1]

2 Integraali

Integraalille on olemassa useita kehittäjiensä mukaan nimettyjä määritelmiä, joista Riemann-integraali lienee yksinkertaisin ja intuitiivisin. Usein kun puhutaan integraalista tarkoitetaan nimenomaan Riemann-integraalia, mikä pätee myös tähän työhön. Jokainen suljetulla välillä $[a, b]$ jatkuva ja rajoitettu reaaliarvoinen funktio on (Riemann-)integroituva ja integraalia merkitään $\int_a^b f(x) \, dx \in \mathbb{R}$, jota kutsutaan myös *määrätyksi integraaliksi*. Määrätyllä integraalilla ja *integraalifunktiolla* $F(x)$ (ja sitä kautta derivoinnilla) on läheinen yhteys, joka tunnetaan *analyysin ensimmäisenä peruslauseena*:

$$\int_a^b f(x) \, dx = \int_a^b F'(x) \, dx = F(b) - F(a) \quad (1)$$

Huomionarvoista on se, että määrätyn integraalin *olemassaolo* ei ole millään tavalla riippuvainen integraalifunktion $F(x)$ olemassaolosta.[1]

2.1 Geometrinen tulkinta

Geometrisesti tarkasteltuna luku $\int_a^b f(x) \, dx$ tarkoittaa kuvaajan $y = f(x)$, x -akselin ja suorien $x = a$ ja $x = b$ rajaamaa pinta-alaa. Tämä on suora seuraus Riemann-integraalin määritelmästä. Olkoon $P_n = \{a = x_0 < x_1 < \dots < x_{n-1} < x_n = b\}$ välin $[a, b]$ n -välinen jako, $m_i = \inf\{f(x) : x_i \leq x \leq x_{i+1}\}$ funktion $f(x)$ suurin alaraja ja $M_i = \sup\{f(x) : x_i \leq x \leq x_{i+1}\}$ vastaavasti pienin yläraja välillä $[x_i, x_{i+1}]$. Jakoa P_i kutsutaan P_j :n *tihentymäksi* mikäli $P_i \subset P_j$ ja merkitään $|P_i|$ jaon P_i pisintä jakoväliä. Tällöin Riemann-integraali voidaan määritellä *ala-*

$$L_{P_n}(f) = \sum_{i=0}^n m_i(x_{i+1} - x_i)$$

ja *yläsummien*

$$U_{P_n}(f) = \sum_{i=0}^n M_i(x_{i+1} - x_i)$$

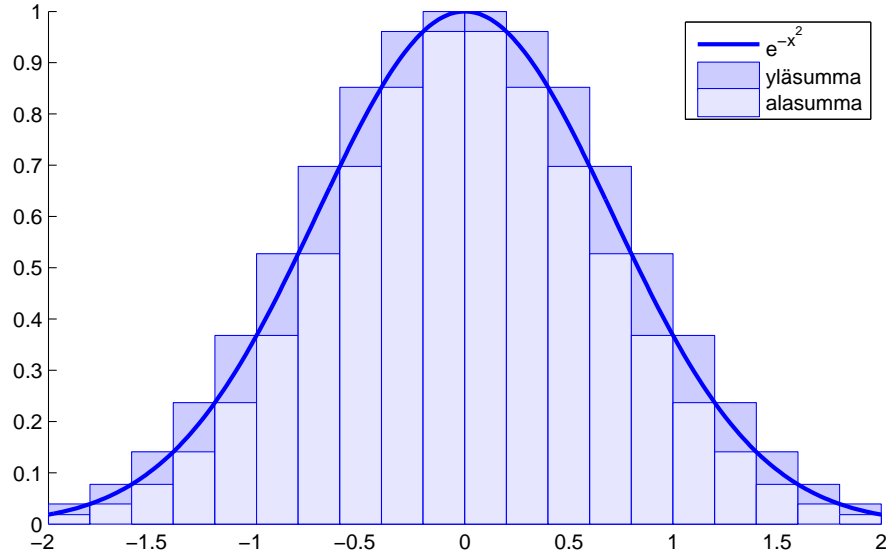
avulla [1]:

$$\begin{aligned} \lim_{n \rightarrow \infty} |P_n| = 0 & \implies \\ \liminf_{n \rightarrow \infty} U_{P_n}(f) = \limsup_{n \rightarrow \infty} L_{P_n}(f) = S & \implies \int_a^b f(x) \, dx = S \end{aligned} \quad (2)$$

Ala- ja yläsummia on havainnollistettu kuvassa 1 (jaon ei välttämättä tarvitse olla tasavälinen), josta on helppo nähdä, että jaon tihentyessä ala- ja yläsummat suppenevat samaan arvoon, joka vastaa kuvaajan $y = f(x)$ ja x -akselin rajaamaa pinta-alaa.

2.2 Numeerisia menetelmiä

Käyttämällä tasavälistä jakoa, edellä esitellyistä ala- tai yläsummista saadaan suoraan eräs, melkoisen epätarkka, numeerinen integraaliapproksimaatio, nimeltään



Kuva 1: Ala- ja yläsummat 20-välisellä jaolla

suorakulmiosääntö. Kuvan 1 esittämässä tapauksessa saadaan $L_{P_{20}}(e^{-x^2}) \approx 1.57$ ja $U_{P_{20}}(e^{-x^2}) \approx 1.96$, todellisen arvon ollessa $\int_{-2}^2 e^{-x^2} dx \approx 1.76$. Tulosta voidaan hiukan parantaa valitsemalla suorakulmion i korkeudeksi $f(\frac{x_i+x_{i+1}}{2})$.

Selkeä parannus saadaan aikaiseksi *puolisuunnikassäännöllä*, jossa myös käytetään tasavälistä jakoa $P_n = \{x_i = a + hi\}$, mutta suorakulmiot on korvattu puolisuunnikkailla:

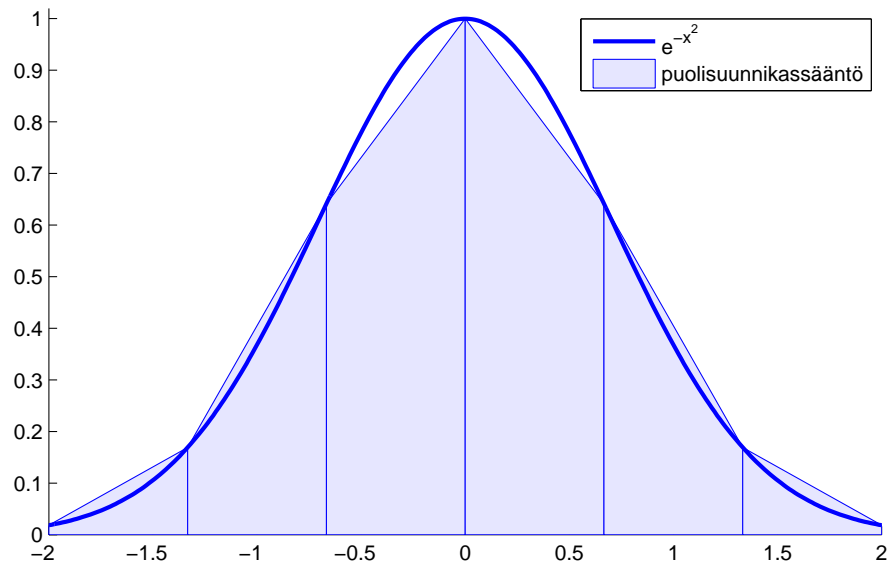
$$\int_a^b f(x) dx = \sum_{i=0}^{n-1} (x_{i+1} - x_i) \frac{f(x_i) + f(x_{i+1})}{2} = h \left(\frac{f(x_0) + f(x_n)}{2} + \sum_{i=0}^{n-1} f(x_i) \right) \quad (3)$$

Puolisuunnikassääntöä on havainnollistettu kuvassa 2.

Puolisuunnikassääntö voidaan tulkita myös siten, että jokaisella välillä integroitavaa funktioita approksimoidaan suoralla, joka kulkee välin päätepisteiden kautta. Alkuperäinen integraali on siis n :n ensimmäisen asteen polynomin integraalien summa. Tällaisen tulkinnan siivittämänä puolisuunnikassäännölle löytyy ilmeinen parannusehdotus: käytetään approksimointiin korkeamman asteen polynomia.

2.2.1 Polynomiinterpolatio

Usein olisi edullista kyetä konstruoimaan arbitraärin monimutkaiselle funktiolle f jokin yksinkertaisempi vastine g . Mikäli mielivaltainen joukko f :n arvoja $f(x_i)$ on tunnettu, on polynomifunktio luonteva valinta g :si, sillä algebran peruslauseen nojalla aina on mahdollista konstruoida polynomifunktio, joka kulkee jokaisen pisteen $(x_i, f(x_i))$ kautta.



Kuva 2: Puolisuunnikassääntö

2.2.2 Eulerin menetelmä

2.2.3 Simpsonin menetelmä

3 Yksiulotteinen kvadratuuri-integrointi

3.1 Ortogonaaliset polynomikannat

3.2 Gaussinen kvadratuuri

3.3 Gauss-Hermite kvadratuuri

3.4 Muita Gaussisia kvadratuureja

4 Moniulotteinen kvadratuuri-integrointi

4.1 Tulosäännöt

4.2 Kubatuurit

4.2.1 Gauss-Hermite

4.3 Muita menetelmiä

5 Koeasetelma

6 Tulokset

7 Yhteenveto

Viitteet

- [1] W. Cheney and D. Kincaid. *Numerical mathematics and computing*. Cengage Learning, 6 edition, 2007.
- [2] R. Cools. Advances in multidimensional integration. *Journal of Computational and Applied Mathematics*, 149(1):1–12, 2002.
- [3] R. Cools. The state of the art of constructing cubature formulas for multivariate integrals. *FEMTEC 2006*, page 4, 2006.
- [4] R. Cools, D. Huybrechs, and D. Nuyens. Recent topics in numerical integration. *International Journal of Quantum Chemistry*, 109(8):1748–1755, 2009.
- [5] R. Cools, I. P. Mysovskikh, and H. J. Schmid. Cubature formulae and orthogonal polynomials. *Journal of Computational and Applied Mathematics*, 127(1-2):121–152, 2001.
- [6] P. J. Davis and P. Rabinowitz. *Methods of numerical integration*. Academic Press, 1975.
- [7] V. I. Krylov. *Approximate calculation of integrals*. Macmillan, 1962.
- [8] F. Y. Kuo, I. H. Sloan, G. W. Wasilkowski, and H. Woźniakowski. Liberating the dimension. *Journal of Complexity*, 2010.
- [9] A. H. Stroud. *Approximate calculation of multiple integrals*. Prentice-Hall, 1971.
- [10] C. W. Ueberhuber. *Numerical computation: methods, software, and analysis, Volume 2*. Springer, 1997.