第13章 递推方程与生成函数

- □递推方程的公式解法
- □ 递推方程的其他解法
- □生成函数的定义及其性质
- □生成函数的应用
- □指数生成函数及其应用
- □ Catalan数与Stirling数

递推方程的公式解法

- □递推方程的定义
- □ 递推方程的实例
- □常系数线性递推方程的求解
 - ■常系数线性递推方程定义
 - ■公式解法
- □ 递推方程在计数问题中的应用

递推方程的定义

设序列 $a_0, a_1, ..., a_n, ...$,简记为 $\{a_n\}$,一个把 a_n 与某些个 a_i (i < n) 联系起来的等式 叫做关于序列 $\{a_n\}$ 的递推方程 当给定递推方程和适当的初值就唯一确定了序列.

例 1: Fibonacci 数列: 1, 1, 2, 3, 5, 8, ...,

Fibonacci 数列的递推方程 $f_n = f_{n-1} + f_{n-2}$

初值 $f_0 = 1$, $f_1 = 1$

例 2: 阶乘计算数列: 1, 2, 6, 24, 5!, ...,

递推方程 F(n) = nF(n-1)

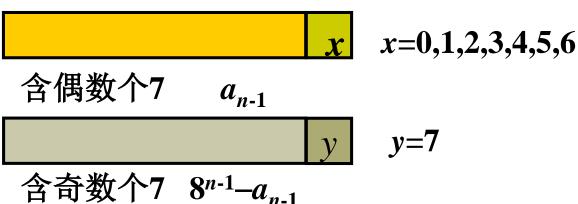
初值 F(1) = 1

递推方程的实例

例 3 一个编码系统用 8 进制数字对信息编码,一个码是有效的 当且仅当含有偶数个 7, 求 n 位长的有效码字有多少个?

解 设所求有效码字为 a_n 个,则 $a_n = 7a_{n-1} + 8^{n-1} - a_{n-1}$ 即 $a_n = 6a_{n-1} + 8^{n-1}$, $a_1 = 7$ 解得 $a_n = (6^n + 8^n)/2$

n-1位长的八进制串



递推方程的实例—Hanoi塔

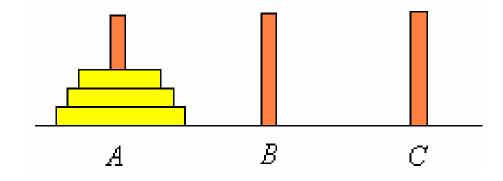
例4 从A柱将这些圆盘移到C柱上去.如果把一个圆盘从一个柱子移到另一个柱子称作一次移动,在移动和放置时允许使用B柱,但不允许大圆盘放到小圆盘的上面.问把所有的圆盘的从A移到C总计需要多少次移动?

移动n个盘子的总次数为T(n). 因此得到递推方程 T(n) = 2T(n-1) + 1.

初值是

$$T(1)=1$$

可证明解是
 $T(n)=2^{n}-1$



常系数线性齐次递推方程

定义

$$\begin{cases} H(n) - a_1 H(n-1) - a_2 H(n-2) - \dots - a_k H(n-k) = 0 \\ H(0) = b_0, H(1) = b_1, H(2) = b_2, \dots, H(k-1) = b_{k-1} \end{cases}$$

其中 $a_1,a_2,...,a_k$ 为常数, $a_k \neq 0$,称为k 阶常系数线性 齐次递推方程, $b_0,b_1,...,b_{k-1}$ 为k个初值

实例: Fibonacci数列的递推方程 $f_n = f_{n-1} + f_{n-2}$

公式解法

- □特征方程、特征根
- □递推方程的解与特征根的关系
- □解的线性性质
- □无重根下通解的结构及求解实例
- □有重根下通解结构及求解实例

特征方程与特征根

$$\begin{cases} H(n) - a_1 H(n-1) - a_2 H(n-2) - \dots - a_k H(n-k) = 0 \\ H(0) = b_0, H(1) = b_1, H(2) = b_2, \dots, H(k-1) = b_{k-1} \end{cases}$$

特征方程 $x^{k}-a_{1}x^{k-1}-...-a_{k}=0$

特征方程的根称为递推方程的特征根

实例

递推方程
$$f_n = f_{n-1} + f_{n-2}$$
 特征方程 $x^2 - x - 1 = 0$ 特征根 $\frac{1 + \sqrt{5}}{2}, \frac{1 - \sqrt{5}}{2}$

递推方程解与特征根的关系

定理 1 q 是非零复数,则 q^n 是递推方程的解 $\Leftrightarrow q$ 是它的特征根

证: q^n 是递推方程的解

$$\Leftrightarrow q^{n} - a_{1}q^{n-1} - a_{2}q^{n-2} - \dots - a_{k}q^{n-k} = 0$$

$$\Leftrightarrow q^{n-k}(q^{k} - a_{1}q^{k-1} - a_{2}q^{k-2} - \dots - a_{k}) = 0$$

$$\Leftrightarrow q^{k} - a_{1}q^{k-1} - a_{2}q^{k-2} - \dots - a_{k} = 0$$

⇔ q 是它的特征根

解的线性性质

定理 2 $h_1(n)$ 和 $h_2(n)$ 是递推方程的解,

 c_1,c_2 为任意常数,

则 $c_1h_1(n)+c_2h_2(n)$ 是递推方程的解.

证明 将 $c_1h_1(n)+c_2h_2(n)$ 代入递推方程左边, 化简后等于 0

推论: 若 $q_1,q_2,...,q_k$ 是递推方程的特征根,则 $c_1q_1^n+c_2q_2^n+...+c_kq_k^n$ 是递推方程的解,其中 $c_1,c_2,...,c_k$ 是任意常数.

无重根时的通解结构

通解定义:

若对递推方程的每个解 h(n)都存在一组常数 c_1 ', c_2 ',…, c_k ' 使得 $h(n)=c_1$ ' $q_1^n+c_2$ ' $q_2^n+\ldots+c_k$ ' q_k^n 成立,则称 $c_1q_1^n+c_2q_2^n+\ldots+c_kq_k^n$ 为通解.

定理 3 设 q_1, q_2, \ldots, q_k 是递推方程不等的特征根,则 $H(n) = c_1 q_1^n + c_2 q_2^n + \ldots + c_k q_k^n$ 为通解. 证明: 略。

求解实例

例5 Fibonacci 数列:

$$f_n = f_{n-1} + f_{n-2}$$
,特征根为 $\frac{1+\sqrt{5}}{2}, \frac{1-\sqrt{5}}{2}$

通解为
$$f_n = c_1 \left(\frac{1+\sqrt{5}}{2}\right)^n + c_2 \left(\frac{1-\sqrt{5}}{2}\right)^n$$

代入初值
$$f_0 = 1, f_1 = 1$$
, 得
$$\begin{cases} c_1 + c_2 = 1 \\ c_1 \left(\frac{1 + \sqrt{5}}{2} \right) + c_2 \left(\frac{1 - \sqrt{5}}{2} \right) = 1 \end{cases}$$

解得
$$c_1 = \frac{1}{\sqrt{5}} \frac{1+\sqrt{5}}{2}$$
, $c_2 = -\frac{1}{\sqrt{5}} \frac{1-\sqrt{5}}{2}$

解是
$$f_n = \frac{1}{\sqrt{5}} \left(\frac{1+\sqrt{5}}{2} \right)^{n+1} - \frac{1}{\sqrt{5}} \left(\frac{1-\sqrt{5}}{2} \right)^{n+1}$$

有重根时求解中的问题

例 6
$$H(n) -4H(n-1) + 4H(n-2) = 0$$

 $H(0) = 0, H(1) = 1$
特征方程 $x^2-4x+4=0$
通解 $H(n) - c_1 2^n + c_2 2^n - c_2 2^n$

通解 $H(n) = c_1 2^n + c_2 2^n = c_2 2^n$

代入方程得:

$$c2^n - 4c2^{n-1} + 4c2^{n-2} = 0$$

c-2c+c=0, 任意 c 都是解,但还有 其它形式的解,例如 $n2^n$ 是解,且与 2^n 线 性无关.

问题:两个解 c_12^n 与 c_22^n 线性相关.

有重根时的通解结构

定理 4 若 q 是递推方程的 e 重特征根,则 $q^n,nq^n,...,n^{e-1}q^n$ 是递推方程的线性无关的解

定理 5 设 q_1, q_2, \ldots, q_t 是递推方程的不相等的特征根,且 q_i 的重数为 e_i ,令

$$H_i(n) = (c_{i1} + c_{i2}n + ... + c_{ie_i}n^{e_i-1})q_i^n$$

则通解
$$H(n) = \sum_{i=1}^{t} H_i(n)$$

证明:略。

求解实例

例 7
$$H(n) + H(n-1) - 3H(n-2) - 5H(n-3) - 2H(n-4) = 0$$

 $H(0) = 1, H(1) = 0, H(2) = 1, H(3) = 2$
特征方程 $x^4 + x^3 - 3x^2 - 5x - 2 = 0$, 特征根-1,-1,-1,2,
通解为 $H(n) = (c_1 + c_2 n + c_3 n^2)(-1)^n + c_4 2^n$

$$\begin{cases} c_1 + c_4 = 1 \\ -c_1 - c_2 - c_3 + 2c_4 = 0 \\ c_1 + 2c_2 + 4c_3 + 4c_4 = 1 \\ -c_1 - 3c_2 - 9c_3 + 8c_4 = 2 \end{cases}$$
解得 $c_1 = \frac{7}{9}, c_2 = -\frac{1}{3}, c_3 = 0, c_4 = \frac{2}{9}$
解为 $H(n) = \frac{7}{9}(-1)^n - \frac{1}{3}n(-1)^n + \frac{2}{9}2^n$

常系数线性非齐次递推方程求解

- □ 递推方程的标准型
- □ 通解结构
- □ 特解的求法
 - 多项式函数
 - 指数函数
 - 组合形式

递推方程的标准型及通解

$$H(n)-a_1H(n-1)-...-a_kH(n-k)=f(n), n \ge k, a_k \ne 0, f(n) \ne 0.$$

定理 6 设 $\overline{H(n)}$ 是对应齐次方程的通解, $H^*(n)$ 是一个特解,则

$$H(n) = \overline{H(n)} + H * (n)$$

是递推方程的通解.

- 证(1) H(n)是解,代入验证.
 - (2) 设 h(n)是解,证明 h(n)为一个齐次解与特解 $H^*(n)$ 之和.

$$h(n) - a_1 h(n-1) - ... - a_k h(n-k) = f(n)$$

$$-)H*(n)-a_1H*(n-1)-...-a_kH*(n-k)=f(n)$$

$$[h(n)-H*(n)]-a_1[h(n-1)-H*(n-1)]-...$$

$$-a_{k}[h(n-k)-H*(n-k)]=0$$

 $h(n) - H^*(n)$ 是齐次解,即 h(n)是一个齐次解与 $H^*(n)$ 之和17

特解的求法

f(n)为n的t次多项式,一般 $H^*(n)$ 也为n的t次多项式

例 8
$$a_n + 5a_{n-1} + 6a_{n-2} = 3n^2$$
 设 $a_n^* = P_1 n^2 + P_2 n + P_3$,代入得
$$P_1 n^2 + P_2 n + P_3 + 5[P_1(n-1)^2 + P_2(n-1) + P_3] + 6[P_1(n-2)^2 + P_2(n-2) + P_3] = 3n^2$$

$$\begin{cases} 12P_1 = 3 \\ -34P_1 + 12P_2 = 0 \\ 29P_1 - 17P_2 + 12P_3 = 0 \end{cases}$$

$$P_1 = \frac{1}{4}, \quad P_2 = \frac{17}{24}, \quad P_3 = \frac{115}{288},$$

$$a_n^* = \frac{1}{4}n^2 + \frac{17}{24}n + \frac{115}{288}$$

通解为
$$a_n = c_1(-2)^n + c_2(-3)^n + \frac{1}{4}n^2 + \frac{17}{24}n + \frac{115}{288}$$

实例

例 9 Hanoi 塔

$$T(n) = 2 T(n-1)+1$$
 $T^*(n) = P$
 $P = 2 P + 1, P = -1$
 $T(n) = c 2^n - 1,$ 代入初值 $T(1) = 1,$ 得 $c = 1,$ 解为 $T(n) = 2^n - 1.$

例 10 H(n)- H(n-1) = 7n

设特解 P_1n+P_2 不行,应设 n^2 次项,因为特征根是 1.

设
$$H^*(n) = P_1 n^2 + P_2 n$$
, 代入 解得 $P_1 = P_2 = 7/2$,

通解为
$$H(n) = c \cdot 1^n + \frac{7}{2} n(n+1) = c + \frac{7}{2} n(n+1)$$

特解的求法(续)

f(n)为指数函数 β^n ,若 β 不是特征根,则特解为

$$\boldsymbol{H}^*(n) = \boldsymbol{P}\boldsymbol{\beta}^n$$

例 11 通信编码问题

$$a_n = 6a_{n-1} + 8^{n-1}, \quad a_1 = 7$$

解:
$$a_n^* = P 8^{n-1}$$
, 代入得 $P = 4$

通解
$$a_n = c \cdot 6^n + 4 \cdot 8^{n-1}$$

代入初值得
$$a_n = (6^n + 8^n)/2$$

特解的求法(续)

若 β 是 e 重特征根,则特解为 $Pn^e\beta^n$

例 12 求
$$H(n)$$
 – $5H(n-1)$ + $6H(n-2)$ = 2^n 的一个特解。

解: 设
$$H^*(n) = Pn2^n$$
,

代入得

$$Pn2^{n}-5P(n-1)2^{n-1}+6P(n-2)2^{n-2}=2^{n}$$

解得
$$P = -2$$

$$H^*(n) = -n2^{n+1}$$

特解的求法(续)

例 13 递推公式

$$a_n - 2a_{n-1} = n + 3^n$$
$$a_0 = 0$$

解: 设特解为
$$a_n^* = P_1 n + P_2 + P_3 3^n$$
,代入得
$$(P_1 n + P_2 + P_3 3^n) - 2[P_1 (n-1) + P_2 + P_3 3^{n-1}] = n + 3^n$$

$$-P_1 n + (2P_1 - P_2) + P_3 3^{n-1} = n + 3^n$$

$$P_1 = -1, P_2 = -2, P_3 = 3$$

$$a_n = c2^n - n - 2 + 3^{n+1}$$
 解得 $c = -1, a_n = -2^n - n - 2 + 3^{n+1}$

递推方程的其他解法

- □ 换元法
- □ 迭代归纳法
- □差消法
- □尝试法

换元法

思想:通过换元转化成常系数线性递推方程

例 1
$$\begin{cases} a_n^2 = 2a_{n-1}^2 + 1 \\ a_0 = 2 \end{cases} \qquad a_n > 0$$

解: 令
$$b_n = a_n^2$$
, 代入得 $b_n = 2 b_{n-1} + 1$, $b_0 = 4$ 解得 $b_n = 5 \cdot 2^n - 1$, $a_n = \sqrt{5 \cdot 2^n - 1}$

换元法一归并排序

例 2 归并排序 $T(n) = 2 T(n/2) + n-1, \quad n = 2^{k}$ T(2) = 1

解
$$H(k)=2H(k-1)+2^k-1$$

 $H(1)=1$
令 $H^*(k)=P_1k2^k+P_2$,解得 $P_1=P_2=1$,
 $H^*(k)=k2^k+1$
通解 $H(k)=C2^k+k2^k+1$,
代入初值,得 $C=-1$,
 $H(k)=-2^k+k2^k+1$,
 $T(n)=n\log n-n+1$

迭代归纳法

$$(a \times c) \times b; (c \times a) \times b;$$

 $a \times (b \times c); a \times (c \times b);$
 $c \times (a \times b); (a \times b) \times c$

例3 给定n个实数 a_1 , a_2 , …, a_n ,可以用多少种不同的方式来构成它们的乘积? 这里认为相乘的次序不同也是不同的方法,如 $(a_1 \times a_2) \times a_3$ 与 $a_1 \times (a_2 \times a_3)$ 是不同的方法。

解:令h(n)表示这n个数构成乘积的方法数。显然有h(1) = 1. 假设n-1个数 a_1,a_2,\cdots,a_{n-1} 的乘积已经构成,有h(n-1)个。任取其中的一个乘积,它是由n-2次乘法得到的。对于其中任一次相乘的两个因式,加入 a_n 的方法有4种,因此这种加入 a_n 的方法数共有4(n-2)种。另外,还可以把 a_n 分别乘在整个乘积的左边或右边,因此加入 a_n 的方法数是4(n-2)+2=4n-6.

迭代归纳法

根据以上的分析可以得到递推方程:

$$h(n) = (4n-6) h(n-1)$$

$$h(1) = 1$$

$$h(n) = (4n-6) h(n-1)$$

$$= (4n-6)(4n-10) h(n-2)$$

$$= ...$$

$$= (4n-6)(4n-10) ... 6 \cdot 2 \cdot h(1)$$

$$= 2^{n-1}[(2n-3)(2n-5) ... 3 \cdot 1]$$

$$= 2^{n-1} \frac{(2n-2)!}{(2n-2)(2n-4) ... 4 \cdot 2} = \frac{(2n-2)!}{(n-1)!}$$

迭代归纳法一错位排列

例 4 错位排列问题

错位排列: $\{1,2,\ldots,n\}$ 的排列 $a_1a_2\ldots a_n, a_i\neq i, i=1,2,\ldots,n$,

n 个元素的错位排列数记作 D_n

将错位排列按首元素 2,3,...,n 分类: 有 n-1 类,

第一位为2的类:

第二位为 1: 方法数为 D_{n-2}

第二位不是 1: 方法数为 D_{n-1}

递推方程:

$$D_n = (n-1)(D_{n-1} + D_{n-2})$$

$$D_1 = 0, D_2 = 1$$

迭代归纳法一错位排列(续)

$$\mathbf{P}: D_{n} = (n-1)(D_{n-1} + D_{n-2})
D_{n} - nD_{n-1} = -[D_{n-1} - (n-1)D_{n-2}] = \dots
= (-1)^{n-2}[D_{2} - 2D_{1}] = (-1)^{n-2}
D_{n} = nD_{n-1} + (-1)^{n}, D_{1} = 0
D_{n} = n(n-1)D_{n-2} + n(-1)^{n-1} + (-1)^{n}
= n(n-1)(n-2)D_{n-3} + n(n-1)(-1)^{n-2} + n(-1)^{n-1} + (-1)^{n}
= \dots
= n(n-1) \dots 2D_{1} + n(n-1) \dots 3(-1)^{2}
+ n(n-1) \dots 4(-1)^{3} + \dots + n(-1)^{n-1} + (-1)^{n}
= n![1 - \frac{1}{1!} + \frac{1}{2!} - \dots + (-1)^{n} \frac{1}{n!}]$$

用归纳法验证。

迭代归纳法一递归树

例 5 归并排序

$$T(n) = 2T(n/2) + n-1$$
, $n=2^k$
 $T(2) = 1$
递归树有 k 层,总数为
 $nk-(1+2+...+2^{k-1})$
 $= nk-(2^k-1) = n\log n-n+1$

$$T(n) = T(\frac{n}{2}) - T(\frac{n}{2}) = T(\frac{n}{4}) - T(\frac{n}{4}$$

1 1 1 1 1 1 1 1 1 111 n-2^{k-1}

迭代归纳法一归并排序

$$T(n) = 2 T(n/2) + n-1$$

$$= 2 [2 T(n/4) + n/2-1] + n-1$$

$$= 2^{2} T(n/2^{2}) + n-2 + n-1$$

$$= \dots$$

$$= 2^{k-1} T(n/2^{k-1}) + n-2^{k-2} + \dots + n-2 + n-1$$

$$= 2^{k-1} T(2) + n(k-1) - (1 + 2 + \dots + 2^{k-2})$$

$$= 2^{k-1} + n(k-1) - (2^{k-1} - 1)$$

$$= nk - n + 1$$

$$= n\log n - n + 1$$

差消法—快速排序

例6 求解递推方程:
$$\begin{cases} T(n) = \frac{2}{n} \sum_{i=1}^{n-1} T(i) + n + 1, & n \ge 2 \\ T(1) = 0 \end{cases}$$
解: $nT(n) = 2 \sum_{i=1}^{n-1} T(i) + n^2 + n$

$$(n-1)T(n-1) = 2 \sum_{i=1}^{n-2} T(i) + (n-1)^2 + (n-1)$$

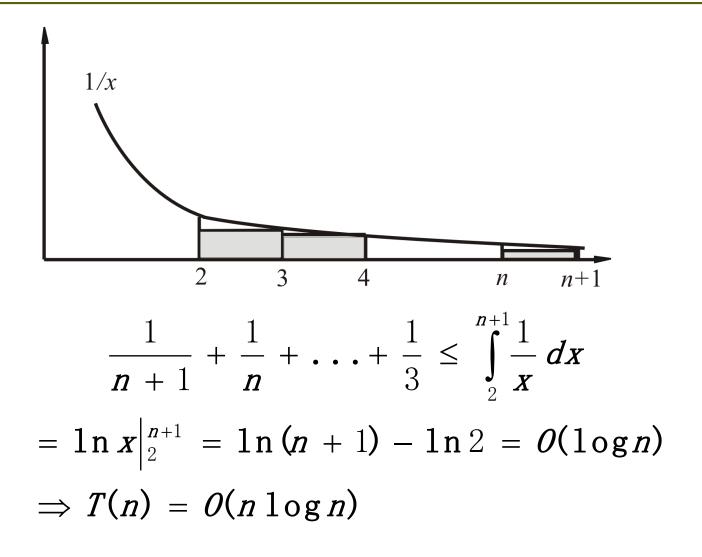
$$nT(n) - (n-1)T(n-1) = 2T(n-1) + 2n$$

$$nT(n) = (n+1)T(n-1) + 2n$$

$$\frac{T(n)}{n+1} = \frac{T(n-1)}{n} + \frac{2}{n+1} = \frac{2}{n+1} + \frac{2}{n} + \dots + \frac{2}{3} + \frac{T(1)}{2}$$

$$= 2 \left[\frac{1}{n+1} + \frac{1}{n} + \dots + \frac{1}{3} \right] \Rightarrow T(n) = 2(n+1) \left[\frac{1}{n+1} + \frac{1}{n} + \dots + \frac{1}{3} \right]$$

差消法(续)



尝试法一快速排序

例7
$$T(n) = \frac{2}{n} \sum_{i=1}^{n-1} T(i) + n + 1$$

(1)
$$T(n)=C$$
, 左边= $O(1)$,

右边= $\frac{2}{n}C(n-1)+n+1=2C-\frac{2C}{n}+n+1=O(n)$

尝试法一快速排序

(3) $T(n)=cn^2$,左边= cn^2

右边=
$$\frac{2}{n}\sum_{i=1}^{n-1}ci^2+n+1=\frac{2}{n}\left[\frac{cn^3}{3}+O(n^2)\right]+n+1=\frac{2c}{3}n^2+O(n)$$

(4) $T(n)=cn\log n$,左边= $cn\log n$

右边 =
$$\frac{2c}{n} \sum_{i=1}^{n-1} i \log i + n + 1$$

$$= \frac{2c}{n} \left[\frac{n^2}{2} \log n - \frac{n^2}{4 \ln 2} + O(n \log n) \right] + n + 1$$

$$= cn\log n + (1 - \frac{c}{2\ln 2})n + O(\log n)$$

积分近似

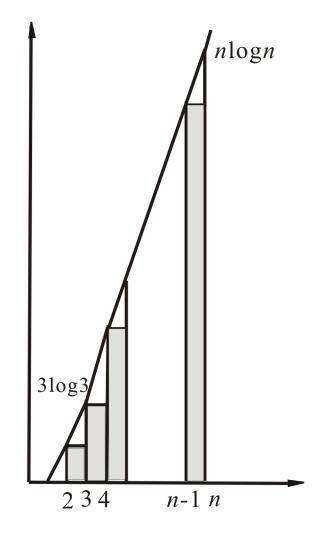
$$\int_{2}^{n} x \log x dx = \int_{2}^{n} \frac{x}{\ln 2} \ln x dx$$

$$= \frac{1}{\ln 2} \left[\frac{x^{2}}{2} \ln x - \frac{x^{2}}{4} \right] \Big|_{2}^{n}$$

$$= \frac{1}{\ln 2} \left(\frac{n^{2}}{2} \ln n - \frac{n^{2}}{4} \right)$$

$$- \frac{1}{\ln 2} \left(\frac{4}{2} \ln 2 - \frac{4}{4} \right)$$

$$= \frac{n^{2}}{2} \log n - \frac{n^{2}}{4 \ln 2} + O(n \log n)$$



分治算法

n 为输入规模,n/b 为子问题输入规模, a 为子问题个数,d(n)为分解及综合的代价 $T(n) = aT(n/b) + d(n), \quad n = b^k$ T(1) = 1 $T(n) = a^2T(n/b^2) + ad(n/b) + d(n) = ...$ $= a^{k}T(n/b^{k}) + a^{k-1}d(n/b^{k-1}) + a^{k-2}(n/b^{k-2}) +$ $\dots + ad(n/b) + d(n)$ $=a^k + \sum_{i=1}^{k-1} a^i d(n/b^i)$

$$a^k = a^{\log_b n} = n^{\log_b a}$$

分治与递归算法一二分检索

$$T(n) = a^k + \sum_{i=0}^{k-1} a^i d(n/b^i), \quad a^k = n^{\log_b a}$$

(1) d(n)=c

$$T(n) = \begin{cases} a^{k} + c\frac{a^{k} - 1}{a - 1} = O(a^{k}) = O(n^{\log_{b} a}) & a \neq 1 \\ a^{k} + kc = O(kc) = O(\log n) & a = 1 \end{cases}$$

二分检索

$$W(n) = W(n/2) + 1$$

$$a = 1, b = 2, d(n) = c$$

$$W(n) = O(\log n)$$

分治与递归算法一二分归并

(2) d(n)=cn

$$T(n) = a^{k} + \sum_{i=1}^{k-1} a^{i} \frac{cn}{b^{i}} = a^{k} + cn \sum_{i=1}^{k-1} (\frac{a}{b})^{i}$$

$$= \begin{cases} n^{\log_{b} a} + cn \frac{(a/b)^{k} - 1}{a/b - 1} = O(n) & a < b \\ n + cnk = O(n\log n) & a = b \\ a^{k} + cn \frac{(a/b)^{k} - 1}{a/b - 1} = a^{k} + c \frac{a^{k} - b^{k}}{a/b - 1} = O(n^{\log_{b} a}) & a > b \end{cases}$$

归并排序

$$W(n) = 2W(n/2) + n-1$$

 $a = 2, b = 2, d(n) = O(n),$
 $W(n) = O(n\log n)$