

ECN 6338 Cours 6

Approximation de fonctions

William McCausland

2022-02-17

Survol du cours 5

Approximations locales

- ▶ Approximation de Taylor
- ▶ Approximation de Padé

Expansions avec coefficients simples

- ▶ Approximation linéaire par morceaux
- ▶ Approximation de Bernstein
- ▶ Approximation spline cubique d'Hermite

Expansions et projections

- ▶ Suites de polynômes orthogonaux

L'approximation de Taylor

- ▶ L'approximation de Taylor utilise l'information locale suivante à un point x_0 :
 - ▶ la valeur $f(x_0)$ de la fonction à approximer,
 - ▶ ses n premières dérivées $f'(x_0), f''(x_0), \dots, f^{(n)}(x_0)$.
- ▶ L'approximation est

$$\hat{f}(x) = f(x_0) + \sum_{i=1}^n \frac{(x - x_0)^i}{i!} f^{(i)}(x_0).$$

- ▶ La valeur de \hat{f} et de ses n premières dérivées concordent avec celles de f au point x_0 .
- ▶ L'expansion a $n + 1$ paramètres libres à spécifier.
- ▶ Peu importe l'ordre n , l'approximation est locale.

L'approximation Padé

- ▶ Comme l'approximation de Taylor, une approximation Padé
 - ▶ utilise la valeur de f et de ses premières n dérivées à x_0 ,
 - ▶ concorde avec f sur ces valeurs à x_0 ,
 - ▶ a $n + 1$ paramètres libres à spécifier.
- ▶ L'approximation est une fonction rationnelle, un ratio de polynômes :

$$f(x) \approx r(x) \equiv \frac{p(x)}{q(x)} = \frac{p_0 + p_1(x - x_0) + \dots + p_m(x - x_0)^m}{1 + q_1(x - x_0) + \dots + q_d(x - x_0)^d},$$

où $m + d = n$ et souvent $m = d$ ou $m = d + 1$.

- ▶ La condition $f^i(x_0) = r^i(x_0)$, $i = 0, 1, \dots, m + n$ s'exprime aussi comme

$$p^i(x) - (f \cdot q)^i(x) = 0, \quad i = 0, 1, \dots, m + d,$$

$n + 1$ équations pour trouver $n + 1 = (m + 1) + d$ coefficients.

Calcul de l'approximation Padé (2,1) de e^x autour de $x = 0$

- L'approximation $r(x)$ est

$$r(x) = \frac{p_0 + p_1x + p_2x^2}{1 + q_1x}.$$

- Les coefficients p_0 , p_1 , p_2 et q_1 sont donnés par

$$(p_0 + p_1x + p_2x^2) - e^x(1 + q_1x)\Big|_{x=0} = p_0 - 1 = 0,$$

$$(p_1 + 2p_2x) - e^x(1 + q_1x) - e^x q_1\Big|_{x=0} = p_1 - 1 - q_1 = 0,$$

$$2p_2 - e^x(1 + q_1x) - 2e^x q_1\Big|_{x=0} = 2p_2 - 1 - 2q_1 = 0,$$

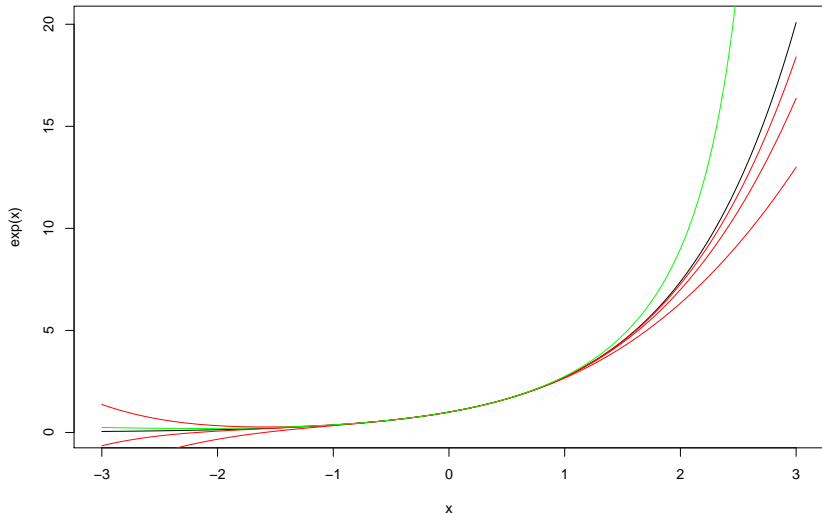
$$-e^x(1 + q_1x) - 3e^x q_1\Big|_{x=0} = -1 - 3q_1 = 0.$$

- La première équation donne $p_0 = 1$; la dernière, $q_1 = -\frac{1}{3}$.
- Ensuite, la deuxième équation donne $p_1 = 1 + q_1 = \frac{2}{3}$; la troisième, $p_2 = \frac{1}{2} + q_1 = \frac{1}{6}$.

Exemple I, Taylor et Padé, $f(x) = e^x$, $x_0 = 0$.

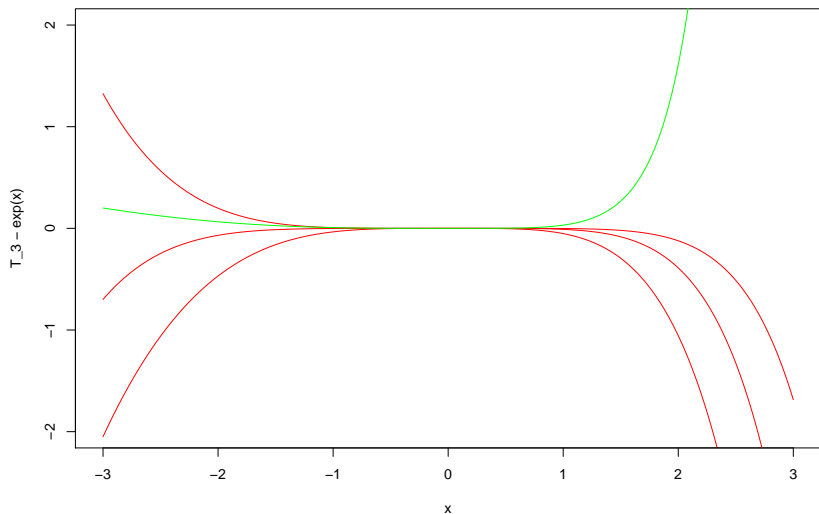
Approx. de Taylor (ordres 3, 4, 5, rouge), de Padé ((2,1), vert) :

```
source('Taylor_Pade_exp.R')
```



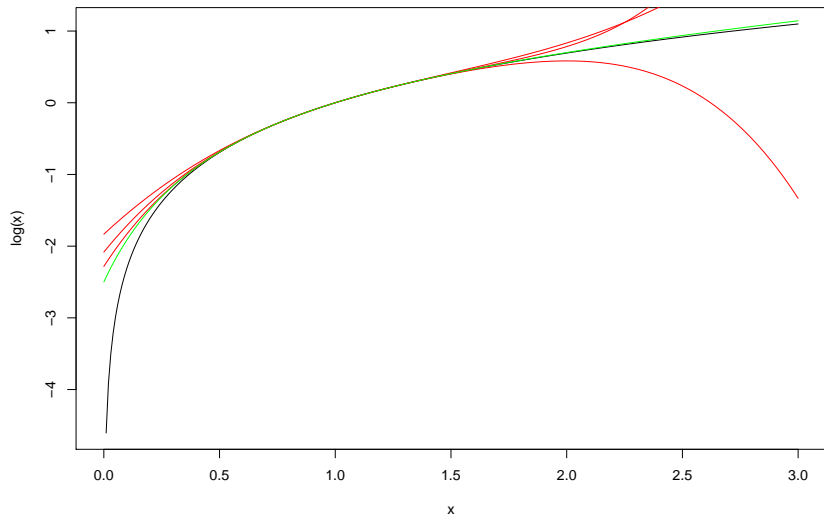
Exemple I, erreurs d'approximation

```
source('Taylor_Pade_exp_error.R')
```



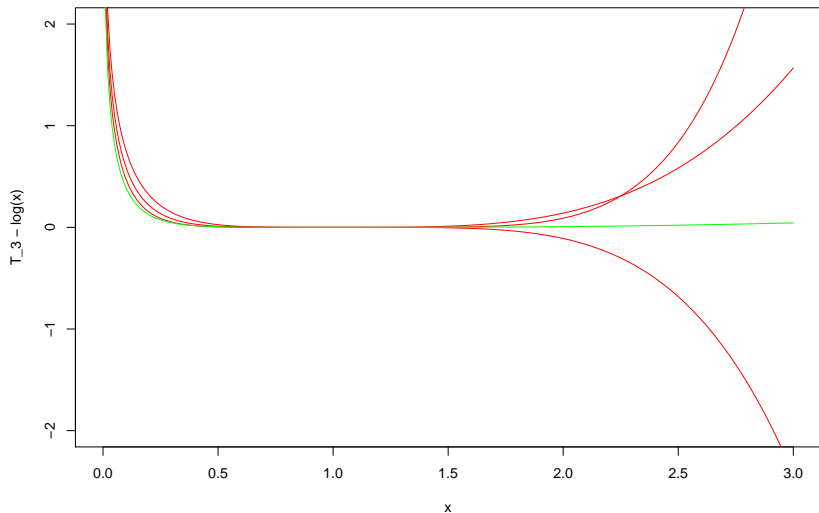
Exemple II, Taylor et Padé, $f(x) = \log x$, $x_0 = 1$.

```
source('Taylor_Pade_log.R')
```



Exemple II, erreurs d'approximation

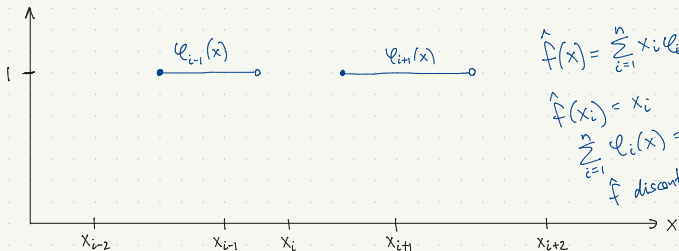
```
source('Taylor_Pade_log_error.R')
```



Les approximations suivantes

- ▶ Nous passons maintenant aux expansions avec coefficients simples :
 - ▶ Approximation constante par morceaux
 - ▶ Approximation linéaire par morceaux
 - ▶ Approximation par spline cubique d'hermite (cubic Hermite spline, Hermite interpolation polynomials)
 - ▶ Approximation de Bernstein (pas une interpolation)

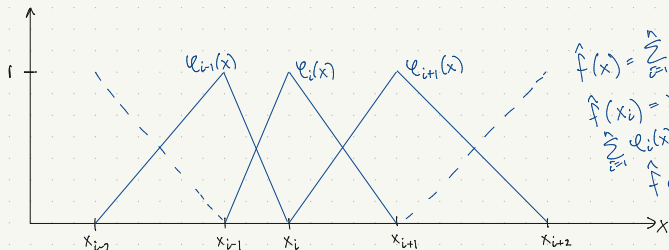
Approx. constante par morceaux et linéaire par morceaux



$$\hat{f}(x) = \sum_{i=1}^n x_i \varphi_i(x)$$

$$\hat{f}(x_i) = x_i$$
$$\sum_{i=1}^n \varphi_i(x) = 1 \text{ sur } [x_1, x_n]$$

\hat{f} discontinue



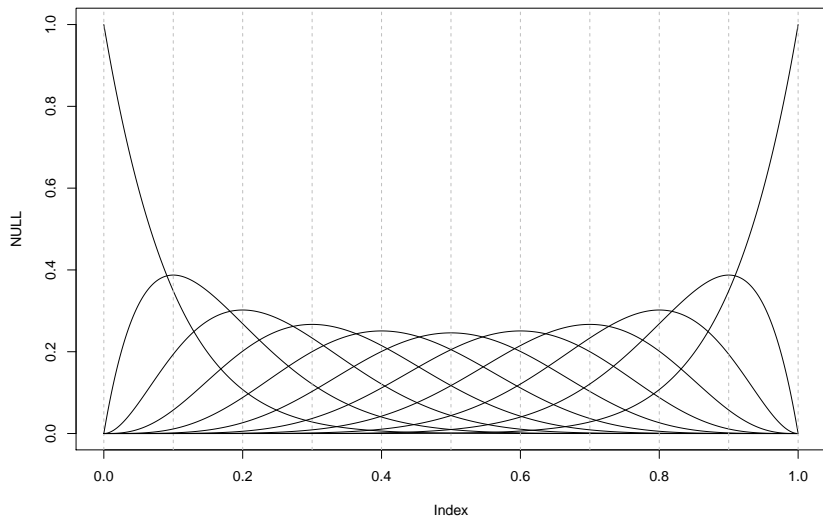
$$\hat{f}(x) = \sum_{i=1}^n x_i \varphi_i(x)$$

$$\hat{f}(x_i) = x_i$$
$$\sum_{i=1}^n \varphi_i(x) = 1 \text{ sur } [x_1, x_n]$$

$\hat{f} \in C^0$

Polynômes de Bernstein d'ordre $n = 10$

```
source('Bernstein.R')
```



Approximation de Bernstein

- ▶ Approximation d'une fonction $g: [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$.
- ▶ On normalise à $f: [0, 1]$ avec $f(x) \equiv g(a + x(b - a))$.
- ▶ L'approximation d'ordre n utilise les évaluations de f sur une grille $(0, \frac{1}{n}, \dots, \frac{n-1}{n})$.
- ▶ L'approximation est

$$\hat{f}_n(x) = \sum_{i=0}^n f\left(\frac{i}{n}\right) b_{i,n}(x),$$

où $b_{i,n}$ est le i -ième polynôme de Bernstein de degré n :

$$b_{i,n}(x) = \binom{n}{i} x^i (1-x)^{n-i}.$$

- ▶ Convergence uniforme : $\lim_{n \rightarrow \infty} \sup_{x \in [0,1]} |f(x) - \hat{f}_n(x)| = 0$.
- ▶ \hat{f} n'est pas une interpolation de f : $\hat{f}(\frac{i}{n}) \neq f(\frac{i}{n})$ en général.

Autres notes sur l'approximation de Bernstein

- ▶ La convergence est lente, mais les dérivées qui existent convergent aussi en même temps.
- ▶ $b_{i,n}(x)$ est la densité Beta($i + 1, n - i + 1$) sur $[0, 1]$.
- ▶ Pour $\pi_i \geq 0, i = 0, 1, \dots, n, \sum_{i=0}^n \pi_i = 1$, la fonction suivante est une densité, un mélange de densités Beta :

$$g(x) = \sum_{i=0}^n \pi_i b_{i,n}(x).$$

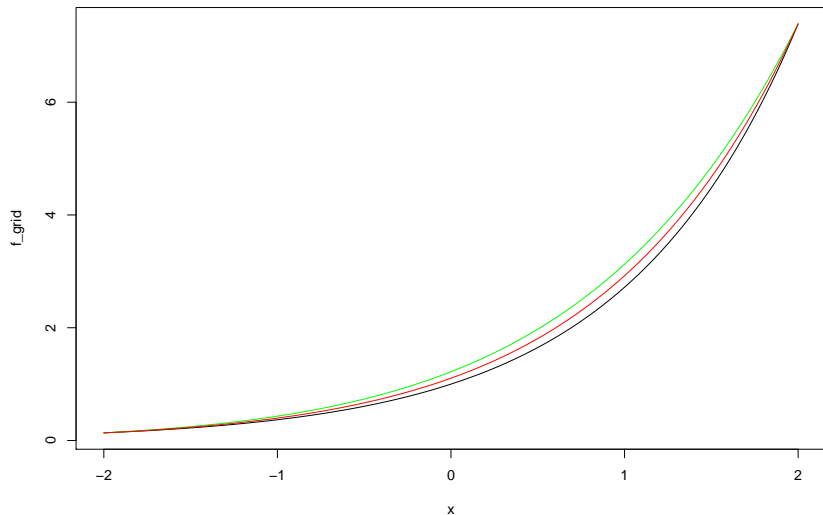
- ▶ Soit $G(x) = \int_0^x g(t) dt$, la fonction de répartition, un polynôme d'ordre $n + 1$.
- ▶ Pour une fonction de répartition paramétrique $F(x)$ sur $(-\infty, \infty)$, $H(x) = G(F(x))$ est une autre fonction de répartition sur $(-\infty, \infty)$.
- ▶ La densité est $h(x) = g(F(x))f(x)$.
- ▶ Spécifier F et G est une façon de spécifier une loi non-paramétrique, comme une perturbation de $F(x)$.

Approximation de $g(x) = e^x$ sur l'intervalle $[-2, 2]$

```
# On normalise la fonction g:[-2,2] -> R, où g(x) = exp(x).  
# à la fonction f:[0,1] -> R, où f(t) = g(-2 + 4*t)  
f <- function(t) {exp(-2 + 4*t)}  
  
# Grille de points t in [0,1]  
t <- seq(0, 1, by=0.01)  
  
# Grille de points x in [-2,2]  
x <- -2 + 4*t  
  
# Valeurs de f et de g sur la grille  
f_grid <- f(t)
```

Approximation de Bernstein de $g(x) = e^x$ pour $n = 10, 20$

```
plot(x, f_grid, type='l')  
lines(x, bernstein(f, 10, t), col='green')  
lines(x, bernstein(f, 20, t), col='red')
```



Splines cubiques d'hermite

Quatre fonctions cubiques sur l'intervalle $[0, 1]$:

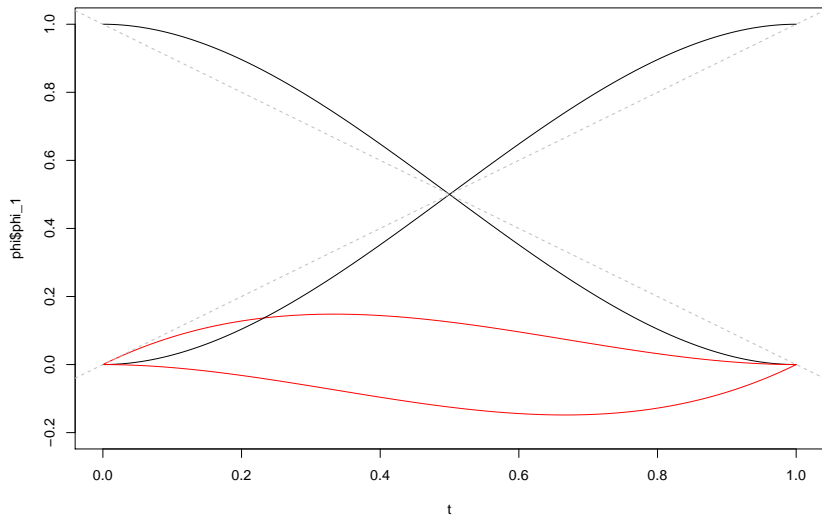
$$\varphi_1(t) = 2t^3 - 3t^2 + 1, \quad \varphi_2(t) = t^3 - 2t^2 + t,$$

$$\varphi_3(t) = -2t^3 + 3t^2, \quad \varphi_4(t) = t^3 - t^2.$$

Fonction f	$f(0)$	$f'(0)$	$f(1)$	$f'(1)$
φ_1	1	0	0	0
φ_2	0	1	0	0
φ_3	0	0	1	0
φ_4	0	0	0	1
$a_1\varphi_1 + a_2\varphi_2 + a_3\varphi_3 + a_4\varphi_4$	a_1	a_2	a_3	a_4

Graphique, spline cubiques d'hermite

```
source('Hermite_piece.R')
```



Notes, splines cubiques d'hermite

- ▶ Problème : interpoler une fonction dont la valeur et la dérivée sont spécifiées à quelques points.
- ▶ Les intrants :
 - ▶ des points $x_1 < x_2 < \dots < x_n$,
 - ▶ des valeurs $f(x_1), \dots, f(x_n)$,
 - ▶ et les dérivées $f'(x_1), \dots, f'(x_n)$.
- ▶ Le résultat : une fonction
 - ▶ cubique par morceaux $[x_i, x_{i+1}]$, (piecewise cubic function)
 - ▶ C^1 dans l'intervalle $[x_1, x_n]$,
 - ▶ ayant une deuxième dérivée discontinue à chaque x_i .
- ▶ Il faut transformer les fonctions $\varphi_j: [0, 1] \rightarrow \mathbb{R}$, $j = 1, 2, 3, 4$, pour avoir les fonctions $\varphi_j: [x_i, x_{i+1}] \rightarrow \mathbb{R}$.
- ▶ Il y a une version (rarement utilisée) avec six fonctions quintiques d'hermite qui donne une fonction C^2 à partir des valeurs, des premières dérivées et des deuxième dérivées à un ensemble de points.

Evaluation des splines cubiques d'hermite

```
spline_cub_eval <- function(x, x_g, f_g, fp_g)
{
  i = findInterval(x, x_g)
  t = (x - x_g[i]) / (x_g[i+1] - x_g[i])
  fch = x_g[i] * (2*t^3 - 1)
}
```

Aparté sur MCO

- ▶ Moindres carrés ordinaire (MCO), rappel :
 - ▶ Soit X une matrice $n \times K$ de rang K , y un vecteur $n \times 1$.
 - ▶ Le problème MCO est de choisir β qui minimise $\|y - X\beta\|^2 = (y - X\beta)^\top (y - X\beta)$.
 - ▶ La solution est $b = (X^\top X)^{-1}(X^\top y)$.
 - ▶ Le vecteur $\hat{y} \equiv Xb = (X(X^\top X)^{-1}X^\top)y$ est la combinaison linéaire des colonnes de X le plus près de y .
- ▶ La matrice $M = X(X^\top X)^{-1}X^\top$ de "projection"
 - ▶ Prenons une combinaison linéaire Xa des colonnes de X .
 - ▶ Multiplication par M ne change pas Xa :

$$M(Xa) = X(X^\top X)^{-1}X^\top Xa = Xa.$$

- ▶ Prenons u , $n \times 1$, perpendiculaire à toutes les colonnes de X .

$$X(X^\top X)^{-1}X^\top u = X(X^\top X)^{-1}0 = 0.$$

- ▶ M projette un vecteur $n \times 1$ sur l'espace engendré par les colonnes de X .
- ▶ $\hat{y} = My$ est la projection de y sur cet espace.

X avec colonnes orthogonales

- ▶ Supposons que les colonnes de X sont mutuellement orthogonales (un cas très spécial, inhabituel)
- ▶ Alors,

$$X^{\top}X = \begin{bmatrix} x_1^{\top}x_1 & 0 & \cdots & 0 \\ 0 & x_2^{\top}x_2 & \ddots & \vdots \\ \vdots & \ddots & \ddots & 0 \\ 0 & \cdots & 0 & x_K^{\top}x_K \end{bmatrix}, \quad X^{\top}y = \begin{bmatrix} x_1^{\top}y \\ x_2^{\top}y \\ \vdots \\ x_K^{\top}y \end{bmatrix}.$$

$$b_k = \frac{x_k^{\top}y}{x_k^{\top}x_k}, \quad k = 1, \dots, K; \quad \hat{y} = Xb = \sum_{k=1}^K \frac{x_k^{\top}y}{x_k^{\top}x_k} x_k.$$

- ▶ Remarquez les produits intérieurs.

Familles de polynômes orthogonaux : produits intérieurs

- Il y a plusieurs produits intérieurs possibles pour les espace des fonctions, y compris

$$\int_a^b f(x)g(x)w(x) dx,$$

pour plusieurs choix de (a, b) et $w: [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$.

- Trois cas classiques

Nom	(a, b)	$w(x)$
Jacobi	$(-1, 1)$	$(1-x)^\alpha(1+x)^\beta, \alpha, \beta > -1$
Laguerre	$(0, \infty)$	e^{-x}
Hermite	$(-\infty, \infty)$	e^{-x^2}

- Pour quelles valeurs de α, β est-ce que les fonctions $w(x)$ des cas Legendre et Chebyshev sont des cas spécial de $w(x) = (1-x)^\alpha(1+x)^\beta$?

Importance de l'orthogonalité

- Un problème de moindres carré : choisir un polynôme d'ordre n pour minimiser la distance (selon le produit intérieur spécifié par (a, b) et $w(\cdot)$) entre le polynôme et une fonction $f: (a, b) \rightarrow \mathbb{R}$ donnée :

$$\min_{p \in \mathcal{P}_n} \int_a^b (f(x) - p(x))^2 w(x) dx.$$

- Si on a une famille $\{\varphi_k(x)\}_{k=0}^{\infty}$ de polynômes orthogonaux (toujours par rapport à (a, b) et $w(\cdot)$) la solution du problème de moindres carrés est

$$p(x) = \sum_{k=0}^n \frac{\langle f, \varphi_k \rangle}{\langle \varphi_k, \varphi_k \rangle} \varphi_k(x).$$

- Cependant, selon chacun des produits intérieurs classiques, les monômes, $1, x, x^2, \dots$, ne sont pas orthogonaux.

L'orthogonalisation de polynômes

- ▶ Pour un ensemble de vecteurs d'un espace pré-hilbertien (inner product space), l'algorithme de Gram-Schmidt crée un ensemble de vecteurs orthogonaux engendrant le même espace.
- ▶ L'application de l'algorithme à l'ensemble des monômes donne les formules de récursion relativement simples.
- ▶ Par exemple, les polynômes de Tchebyshev $((a, b) = (-1, 1), w(x) = (1 - x^2)^{-1/2})$ sont définie par $T_0 = 1$, $T_1 = x$, $T_n(x) = 2xT_{n-1}(x) - T_{n-2}(x)$, alors

$$T_2(x) = 2xT_1(x) - T_0(x) = 2x^2 - 1,$$

$$T_3(x) = 2xT_2(x) - T_1(x) = 4x^3 - 2x - x = 4x^3 - 3x.$$

- ▶ Pour n pair (impair), $T_n(x)$ est une fonction pair (impair).
- ▶ La solution, en forme réduite, est $T_n(x) = \cos(n \cos^{-1} x)$.
- ▶ Pour évaluer une expansion $\sum_{k=1}^n a_k T_k(x)$ à un point, on peut évaluer dans un premier temps, les $T_k(x)$ avec la récursion.

Notes sur les polynômes

- ▶ Le théorème de Weierstrass démontre la force potentielle des polynômes pour l'approximation des fonctions sur les intervalles bornés.

- ▶ Pour $f \in C^k[a, b]$, il existe une suite de polynômes p_n , où chaque p_n est un polynôme de degré n , telle que

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \max_{x \in [a, b]} |f^{(l)}(x) - p_n^{(l)}(x)| = 0.$$

- ▶ Trouvez $p_n(x)$ qui minimise $\max_{x \in [a, b]} |f^{(l)}(x) - p_n^{(l)}(x)|$ est difficile, mais une solution moindres carrés est souvent près du minimum.
- ▶ Trouvez $p_n(x)$ qui minimise $\langle f - p_n, f - p_n \rangle$ est facile en principe, mais
 - ▶ les produits intérieurs sont rarement faisable de façon analytique
 - ▶ les intégrales numériques sont coûteux

Approximation moindres carrés de x^3

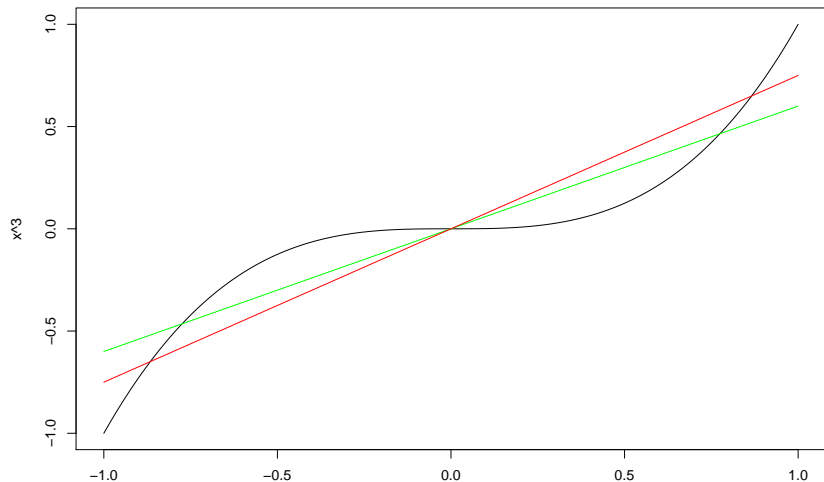
- Problème : approximer $f(x) = x^3$ sur l'intervalle $[-1, 1]$.
- Utilisons le produit intérieur avec $(a, b) = (-1, 1)$ et $w(x) = 1$.
- Problème moindres carrés : minimiser $\|f - p_2\|^2 = \langle f - p_2, f - p_2 \rangle$ pour un polynôme p_2 d'ordre 2 ou moins.
- La solution est

$$\begin{aligned}\hat{f}(x) &= \frac{\langle f, P_0 \rangle}{\langle P_0, P_0 \rangle} P_0(x) + \frac{\langle f, P_1 \rangle}{\langle P_1, P_1 \rangle} P_1(x) + \frac{\langle f, P_2 \rangle}{\langle P_2, P_2 \rangle} P_2(x) \\ &= \frac{2/5}{2/3} P_1(x) = \frac{3}{5} x.\end{aligned}$$

- Le polynôme d'ordre 2 ou moins qui minimise $\max_{x \in (-1, 1)} |f(x) - p_2(x)|$ est $\frac{3}{4} x$.

Meilleures approximations de x^3

```
x = seq(-1, 1, by=0.001)
plot(x, x^3, type='l')           # Fonction à approximer
lines(x, 0.6*x, col='green')    # Meilleur approx. MC
lines(x, 0.75*x, col='red')     # Meilleur approx. uniforme
```



Meilleures approximations de x^3 , cont.

```
x = seq(-1, 1, by=0.001)
plot(x, x^3 - 0.6*x, type='l', col='green') # Meilleur approx.
lines(x, x^3 - 0.75*x, col='red') # Meilleur approx. unif.
abline(h=-0.25, lty='dashed', col='grey')
```

