Metody Numeryczne, część 2 studia stacjonarne Interpolacja

Krystyna Ziętak 14 października 2018

Spis treści

- 1 Literatura
- 2 Motywacja
- 3 Istnienie i jednoznaczność wielomianu interpolującego
- 4 Metody wyznaczania wielomianu interpolacyjnego
- 5 Błąd (reszta) interpolacji wielomianowej
- 6 Szacowanie reszty interpolacji
- Wielomiany Czebyszewa (materiał dodatkowy)

Literatura:

- D. Kincaid, W. Cheney, Analiza numeryczna, WNT 2006.
- J. i M. Jankowscy, Przegląd metod i algorytmów numerycznych, WNT 1981.
- A. Grabarski, I. Musiał-Walczak, W. Sadkowski, A. Smoktunowicz, J. Wąsowski, Ćwiczenia laboratoryjne z metod numerycznych, Oficyna Wyd. Politech. Warszawskiej 2002.
- materiały internetowe: http://wazniak.mimuw.edu.pl

Motywacja

 Efektem eksperymentów (fizycznych, chemicznych, itp.) mogą być następujące dane

$$\frac{x_0 | x_1 | \cdots | x_n}{y_0 | y_1 | \cdots | y_n},$$

gdzie liczby x_0, \ldots, x_n są różne i mogą być interpretowane jako argumenty, dla których dokonano pomiarów wartości y_0, \ldots, y_n jakiejś funkcji y = f(x) opisującej dane zjawisko (proces). Na podstawie tych pomiarów chcemy wyznaczyć wartość (przybliżoną) tej funkcji dla jakiegoś innego argumentu z przedziału zawierającego x_0, \ldots, x_n .

Funkcja f(x) może nie być znana explicite, a jej wartości dla argumentów x_j mogą być wyznaczone niedokładnie.

Motywacja

 W drugim problemie funkcja f(x) jest znana, ale na przykład jest określona kosztownym wzorem lub obliczenie jej wartości jest trudne i skomplikowane.
 Wówczas zamiast obliczać wartości funkcji f obliczamy wartości jakiejś prostszej funkcji, która funkcję f przybliża w sensowny sposób.

Jako funkcję przybliżającą funkcję f(x) możemy wybrać wielomian odpowiedniego stopnia.

Wielomiany

$$w_n(x) = a_0 x^n + a_1 x^{n-1} + \cdots + a_{n-1} x + a_n$$

$$u(x) = 2x^3 - 2x + 3$$

 $a_0 = 2$, $a_1 = 0$, $a_2 = -2$, $a_3 = 3$

Schemat Hornera - przypomnienie

Wartość wielomianu dla konkretnej wartości x obliczamy za pomocą schematu Hornera.

Interpolacja wielomianowa

Zadanie

• Dane: liczba naturalna n oraz n+1 różnych liczb

$$x_0, \ldots, x_n$$

oraz n+1 liczb

$$y_0, \ldots, y_n$$

• Wynik: wielomian $w_n(x)$ stopnia $\leq n$ taki, że

$$w_n(x_i) = y_i$$
 dla $j = 0, \ldots, n$

- liczby x_0, \ldots, x_n nazywamy węzałami interpolacji
- Wielomian $w_n(x)$ spełniający powyższe warunki nazywamy wielomianem interpolacyjnym (interpolującym).



Wielomian interpolujący funkcję

Liczby y_0, \ldots, y_n mogą być wartościami jakiejś funkcji f(x), czyli

$$w_n(x_i) = y_i = f(x_i) \quad j = 0, ..., n.$$

Wówczas mówimy, że wielomian $w_n(x)$ interpoluje funkcję f.

Geometryczna interpretacja

Para liczb x_k , y_k może być interpretowana jako punkt na płaszczyźnie o współrzędnych (x_k, y_k) . Wobec tego wykres wielomianu $w_n(x)$ interpolującego funkcję f przecina wykres funkcji f w punktach $(x_0, y_0) \dots , (x_n, y_n)$. Dla n = 1 wielomian interpolacyjny jest sieczną! Jak to uzasadnić?

Dane:

punkt P_0 o współrzędnych (x_0, y_0) punkt P_1 o współrzędnych (x_1, y_1) ,

gdzie
$$y_0 = f(x_0), y_1 = f(x_1)$$

Zakładamy, że $x_0 \neq x_1$

Równanie siecznej

$$y = y_0 + (x - x_0) \frac{y_1 - y_0}{x_1 - x_0} \equiv w_1(x)$$

Wyznacz współczynniki A, B

$$y = Ax + B = y_0 + (x - x_0)\frac{y_1 - y_0}{x_1 - x_0}$$

Twierdzenie

Niech dane liczby x_0, \ldots, x_n będą parami różne i niech dane będą liczby y_0, \ldots, y_n . Wówczas istnieje jednoznaczny wielomian $w_n(x)$ stopnia $\leq n$ taki, że

$$w_n(x_j) = y_j$$
 $j = 0, \ldots, n$.

Pomocnicze oznaczenia

Suma n liczb

$$\sum_{j=1}^n a_j = a_1 + \cdots + a_n$$

Iloczyn n liczb

$$\prod_{j=1}^n a_j = a_1 \cdots a_n$$

Szczególny przypadek (pomijamy czynnik dla j=k)

$$\prod_{j=1, j\neq k}^{n} a_{k,j} = a_{k,1} \cdots a_{k,k-1} a_{k,k+1} \cdots a_{k,n}$$

Jak reprezentować wielomian interpolacyjny?

 Standardowa postać $W_n(x) = a_0 x^n + a_1 x^{n-1} + \cdots + a_{n-1} x + a_n$

Wzór interpolacyjny Lagrange'a

$$w_n(x) = \sum_{k=0}^n y_k \prod_{j=0, j \neq k}^n \frac{x - x_j}{x_k - x_j}$$

Wzór interpolacyjny Newtona

$$w_n(x) = c_0 + c_1(x - x_0) + c_2(x - x_0)(x - x_1) + \dots$$
$$+c_n(x - x_0)(x - x_1) \cdots (x - x_{n-1})$$

Jak wyznacza się współczynniki a_i, c_i?

Pierwszy sposób wyznaczania wielomianu interpolacyjnego

Przykład.
$$\begin{array}{c|cc|c} x_0 = 1 & x_1 = -1 & x_2 = 2 \\ \hline y_0 = 0 & y_1 = -3 & y_2 = 4 \end{array}$$

Uwaga. Węzły interpolacji nie są uporządkowane. Szukamy wielomianu

$$w_2(x) = a_0x^2 + a_1x + a_2$$

takiego, że $w_2(1) = 0$, $w_2(-1) = -3$, $w_2(2) = 4$. Wobec tego muszą być spełnione warunki:

$$a_0 + a_1 + a_2 = 0$$
, $a_0 - a_1 + a_2 = -3$, $4a_0 + 2a_1 + a_2 = 4$.

To jest układ trzech równań liniowych.

Macierza tego układu jest macierz Vandermonda.

$$\det(V_n(x_1,\ldots,x_n)) = \begin{vmatrix} 1 & x_1 & x_1^2 & \cdots & x_1^{n-1} \\ 1 & x_2 & x_2^2 & \cdots & x_2^{n-1} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \ddots & \vdots \\ 1 & x_n & x_n^2 & \cdots & x_n^{n-1} \end{vmatrix}$$

$$= \prod_{k,\ell=1,k>\ell}^n (x_k - x_\ell)$$

Niewiadome:
$$z_1 = a_0$$
, $z_2 = a_1$, $z_3 = a_2$
Wektor niewiadomych $z = [z_1, z_2, z_3]^T$.
Układ $Az = b$

Macierz układu A i wektor prawych stron b:

$$A = \begin{bmatrix} x_0^2 & x_0 & 1 \\ x_1^2 & x_1 & 1 \\ x_2^2 & x_2 & 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 1 & -1 & 1 \\ 4 & 2 & 1 \end{bmatrix}, \quad b = [0, -3, 4]^T.$$

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 1 & -1 & 1 \\ 4 & 2 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} z_1 \\ z_2 \\ z_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0 \\ -3 \\ 4 \end{bmatrix}.$$

Odpowiedź:
$$w_2(x) = \frac{1}{6} (5x^2 + 9x - 14)$$

Inna kolejność niewiadomych $z_1 = a_2$, $z_2 = a_1$, $z_3 = a_0$ Jak zmieni się wtedy macierz układu i wektor prawych stron?

Drugi sposób wyznaczania wielomianu interpolacyjnego

Wzór interpolacyjny Lagrange'a

$$w_n(x) = \sum_{k=0}^{n} y_k \prod_{j=0, j \neq k}^{n} \frac{x - x_j}{x_k - x_j}$$

Oznaczenie pomocniczych wielomianów dla k = 0, 1, ..., n:

$$\ell_k(x) = \prod_{i=0, i \neq k}^n \frac{x - x_j}{x_k - x_j}$$

Dla n=2 mamy

$$\ell_0(x) = \frac{(x - x_1)(x - x_2)}{(x_0 - x_1)(x_0 - x_2)}, \quad \ell_1(x) = \frac{(x - x_0)(x - x_2)}{(x_1 - x_0)(x_1 - x_2)},$$

$$\ell_2(x) = \frac{(x - x_0)(x - x_1)}{(x_2 - x_0)(x_2 - x_1)}.$$

cd. przykładu

$$\ell_0(x) = \frac{(x+1)(x-2)}{(0+1)(0-2)} = -\frac{1}{2}(x+1)(x-2),$$

$$\ell_1(x) = \frac{(x-1)(x-2)}{(-1-1)(-1-2)} = \frac{1}{6}(x-1)(x-2),$$

$$\ell_2(x) = \frac{(x-1)(x+1)}{(2-1)(2+1)} = \frac{1}{3}(x-1)(x+1).$$

$$w_2(x) = 0 \times \ell_0(x) + (-3) \times \ell_1(x) + 4 \times \ell_2(x) =$$

$$-\frac{1}{2}(x-1)(x-2) + \frac{4}{3}(x-1)(x+1) = \frac{5}{6}x^2 + \frac{3}{2}x - \frac{7}{3}$$

Trzeci sposób: wzór interpolacyjny Newtona

Zalety wzoru interpolacyjnego Newtona

$$w_n(x) = c_0 + c_1(x - x_0) + \cdots + c_n(x - x_0)(x - x_1) \cdots (x - x_{n-1})$$

- Współczynniki c_j są pewnymi ilorazami różnicowymi.
- Jest rekurencyjny związek między ilorazami różnicowymi
- Wzór Newtona ma lepsze własności numeryczne niż wzór Lagrangre'a.
- W praktyce powinno się stosować wzór Newtona.
- Wartość wielomianu interpolacyjnego w postaci Newtona można obliczać za pomocą uogólnionego schematu Hornera.

Wyznaczanie współczynników c_k z wzoru Newtona

Niech $w_n(x_i) = f(x_i)$ dla $j = 0, \ldots, n$ (węzły interpolacji x_i są różne). Wówczas

$$c_k = f[x_0, \ldots, x_k],$$

gdzie $f[x_0, \ldots, x_k]$ jest ilorazem różnicowym rzędu k dla funkcji f i powyższych węzłów interpolacii.

Ilorazy różnicowe definiuje się rekurencyjnie.

- Dla k = 0 mamy $f[x_0] = f(x_0)$.
- Dla k=1 mamy

$$f[x_0, x_1] = \frac{f(x_1) - f(x_0)}{x_1 - x_0} = \frac{f[x_1] - f[x_0]}{x_1 - x_0}$$

Ilorazy różnicowe spełniają zależności

$$f[x_0,\ldots,x_k] = \frac{f[x_1,\ldots,x_k] - f[x_0,\ldots,x_{k-1}]}{x_k - x_0}$$

• Iloraz różnicowy nie zależy od kolejności jego argumentów.

•
$$f(t) - w_n(t) = f[x_0, \ldots, x_n, t](t - x_0)(t - x_1) \cdots (t - x_n)$$

Przykład,
$$n = 3$$

$$x_0$$
 $f[x_0]$ $f[x_0, x_1]$ $f[x_0, x_1, x_2]$ $f[x_0, x_1, x_2, x_3]$
 x_1 $f[x_1]$ $f[x_1, x_2]$ $f[x_1, x_2, x_3]$
 x_2 $f[x_2]$ $f[x_2, x_3]$
 x_3 $f[x_3]$

$$n = 2$$
, $x_0 = 1$, $x_1 = -1$, $x_2 = 2$, $f(x_0) = 0$, $f(x_1) = -3$, $f(x_2) = 4$

$$x_0$$
 $f[x_0]$ $f[x_0, x_1]$ $f[x_0, x_1, x_2]$
 x_1 $f[x_1]$ $f[x_1, x_2]$
 x_2 $f[x_2]$

$$f[x_0, x_1] = \frac{f(x_1) - f(x_0)}{x_1 - x_0} = \frac{3}{2}, \quad f[x_1, x_2] = \frac{f(x_2) - f(x_1)}{x_2 - x_1} = \frac{7}{3}$$

$$f[x_0, x_1, x_2] = \frac{f[x_1, x_2] - f[x_0, x_1]}{x_2 - x_0} = \frac{5}{6}$$

$$w_2(x) = 0 + \frac{3}{2}(x-1) + \frac{5}{6}(x-1)(x+1)$$

Niech liczby x_0,\ldots,x_n z przedziału [a,b] będą parami różne. Niech wielomian $w_n(x)$ interpoluje funkcję $f\in\mathbb{C}^{n+1}[a,b]$ w węzłach interpolacji x_0,\ldots,x_n . Wówczas dla każdego $x\in[a,b]$ istnieje takie $\xi_x\in(a,b)$, że

$$f(x) - w_n(x) = \frac{1}{(n+1)!} f^{(n+1)}(\xi_x) \prod_{j=0}^n (x - x_j).$$

Uwagi.

- $f^{(n+1)}(x)$ jest pochodną rzędu n+1 funkcji f.
- Wyrażenie $\frac{1}{(n+1)!}f^{(n+1)}(\xi_x)\prod_{j=0}^n(x-x_j)$ nazywamy błędem (resztą) interpolacji.

Pochodne - przypomnienie

$$(\sin(x))' = \cos(x), \quad (\cos(x))' = -\sin(x)$$

 $(x^n)' = nx^{n-1}, \quad (\ln(x))' = \frac{1}{x}$

pochodna iloczynu dwóch funkcji:

$$(fg)' = f'g + fg'$$

pochodna ilorazu dwóch funkcji

$$\left(\frac{f}{g}\right)' = \frac{f'g - fg'}{g^2}$$

Przypomnienie - błąd interpolacji

Niech liczby x_0, \ldots, x_n z przedziału [a, b] będą parami różne.

Niech wielomian $w_n(x)$ interpoluje funkcję $f \in \mathbb{C}^{n+1}[a,b]$ w wezłach x_0, \ldots, x_n .

Wówczas dla każdego $x \in [a, b]$ istnieje takie $\xi_x \in (a, b)$, że

$$f(x) - w_n(x) = \frac{1}{(n+1)!} f^{(n+1)}(\xi_x) \prod_{i=0}^n (x - x_i).$$

Szacowanie reszty interpolacji

Niech węzły interpolacji x_0, \ldots, x_n leżą w przedziale [a, b].

$$M_n = \max_{t \in [a,b]} \left| \prod_{j=0}^n (t - x_j) \right|$$

$$K_n = \max_{t \in [a,b]} \left| f^{(n+1)}(t) \right|$$

Dla dowolnych węzłów interpolacji $x_0, \ldots, x_n \in [a, b]$ oraz dla wszystkich $x \in [a, b]$ mamy następujące oszacowanie błędu interpolacji

$$|f(x)-w_n(x)|\leq \frac{1}{(n+1)!}K_nM_n$$

Dla ustalonego $x \in [a, b]$ mamy

$$|f(x) - w_n(x)| \le \frac{1}{(n+1)!} K_n \left| \prod_{j=1}^n (x - x_j) \right|$$

Przykład. Niech $f(x) = \sin(x)$.

- Niech $w_1(x)$ interpoluje funkcję f(x) w węzłach $x_0 = 0, x_1 = \pi/3$.
- Oszacuj z góry błąd $|f(x) w_1(x)|$ dla dowolnego $x \in [0, \frac{\pi}{3}].$

Odpowiedź

•
$$w_1(x) = \frac{3\sqrt{3}}{2\pi}x$$

•

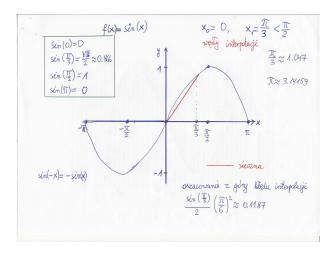
$$|f(x) - w_1(x)| = \frac{1}{2}|f''(\xi_x)| |x(x - x_1)| \le \frac{\sin(\frac{\pi}{3})}{2}(\frac{\pi}{6})^2$$

Uwaga.
$$f'(x) = \cos x$$
, $f''(x) = -\sin x$

$$\max_{x \in [0,\pi/3]} |f''(x)| = \sin(\pi/3)$$

$$\max_{x \in [0, \pi/3]} \left| x \left(x - \frac{\pi}{3} \right) \right| = \left(\frac{\pi}{6} \right)^2$$

Ilustracja graficzna przykładu



Przykład

Niech

$$f(x) = \sin(x)$$

Chcemy obliczyć przybliżoną wartość sin $(\frac{\pi}{36})$.

 Niech w₃(x) będzie wielomianem interpolacyjnym z węzłami interpolacyjnymi

$$x_0 = 0$$
, $x_1 = \frac{\pi}{6}$, $x_2 = \frac{\pi}{4}$, $x_3 = \frac{\pi}{3}$.

- Wartość tego wielomianu dla $x=\pi/36$ przyjmujemy jako przybliżoną wartość funkcji sinus dla $x=\frac{\pi}{36}$.
- Oceń błąd

$$\left|\sin\left(\frac{\pi}{36}\right)-w_3\left(\frac{\pi}{36}\right)\right|$$
.

W tym celu można zastosować twierdzenie o błędzie interpolacji (szczegóły na wykładzie).

Węzły Czebyszewa są równe

$$x_j = \cos\left(\frac{(2j+1)\pi}{2(n+1)}\right) \qquad j = 0, 1, \dots, n$$

Dla n+1 węzłów Czebyszewa x_i mamy

$$\max_{x \in [-1,1]} \left| \prod_{j=0}^{n} (x - x_j) \right| = \frac{1}{2^n}.$$

Dla innych węzłów interpolacji x_0, \ldots, x_n z przedziału [-1, 1] mamy

$$\max_{x \in [-1,1]} \left| \prod_{j=0}^{n} (x - x_j) \right| > \frac{1}{2^n}$$

$$f(x) = \frac{1}{1 + 25x^2}, \quad x \in [-1, 1]$$

węzły Czebyszewa

$$x_j = \cos\left(\frac{(2j+1)\pi}{2(n+1)}\right) \qquad j = 0, 1, \dots, n$$

ullet węzły równoodległe (przedział [-1,1] dzielimy na równe podprzedziały)

$$x_j = -1 + \frac{2j}{n}$$
 dla $j = 0, \dots, n$

błąd interpolacji

$$E = \max_{x \in [-1,1]} |f(x) - w_n(x)|$$

Maksymalny moduł błędu interpolacji na przedziale [-1,1]

n	2	6	10	14	18	20
E dla rownoodl.	0.65	0.62	1.9	7.2	29	60
E dla Czebysz.	0.60	0.26	0.11	0.047	0.022	0.015

Wnioski dla tego przykładu

- Wielomian interpolacyjny z węzłami Czebyszewa lepiej przybliża funkcję $f(x) = 1/(1+25x^2)$ na przedziale [-1,1] niż węzły równoodległe.
- Dla węzłów równoodległych zwiększenie stopnia wielomianu nie powoduje zmniejszenia błędu.

Materiał dodatkowy

Wielomiany Czebyszewa $T_n(x)$

Można je wyznaczać za pomocą związku rekurencyjnego

$$T_0(x) = 1, \quad T_1(x) = x$$

 $T_n(x) = 2xT_{n-1}(x) - T_{n-2}(x), \quad n = 2, 3, \dots,$

Wszystkie **pierwiastki** r_k wielomianu $T_n(x)$ są rzeczywiste, leżą w przedziale [-1, 1] i są równe:

$$r_k = \cos \frac{(2k-1)\pi}{2n}, \qquad k = 1, 2, \dots, n.$$

pierwiastki wielomianu T_2 (n=2)

$$T_2(x) = 2xT_1(x) - T_0(x) = 2x^2 - 1$$
 $T_2(x) = 0 \Rightarrow 2x^2 = 1, \quad x^2 = \frac{1}{2}$
 $r_1 = \frac{1}{\sqrt{2}}, \quad r_2 = -\frac{1}{\sqrt{2}}$

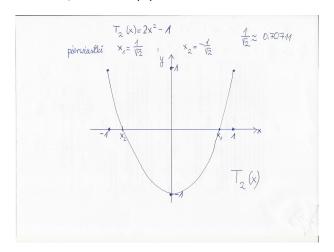
podstawienie do wzoru na pierwiastki

$$r_1 = \cos\left(\frac{\pi}{4}\right) = \cos\left(45^\circ\right) = \frac{1}{\sqrt{2}}$$

$$r_2 = \cos\left(\frac{3\pi}{4}\right) = \cos\left(\pi - \frac{\pi}{4}\right) = -\cos\left(\frac{\pi}{4}\right) = -\cos\left(45^\circ\right) = -\frac{1}{\sqrt{2}}$$

Narysuj wykres wielomianu Czebyszewa $T_2(x)$

Wielomian Czebyszewa $T_2(x)$



$$T_3(x) = 2xT_2(x) - T_1(x) = 2x(2x^2 - 1) - x = 4x^3 - 3x = x(4x^2 - 3)$$

pierwiastki wielomianu T_3

$$T_3(x) = 0 \Rightarrow x = 0, \quad 4x^2 - 3 = 0$$

0, $\frac{\sqrt{3}}{2}, \quad -\frac{\sqrt{3}}{2}$

podstawienie do wzoru na pierwiastki

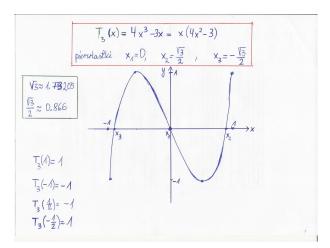
$$r_1 = \cos\left(\frac{\pi}{6}\right) = \cos(30^\circ) = \frac{\sqrt{3}}{2}$$

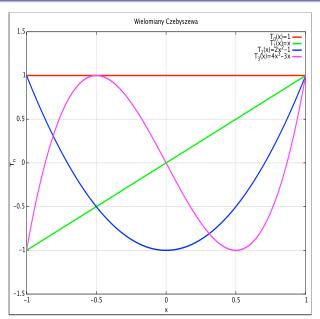
$$r_2 = \cos\left(\frac{\pi}{2}\right) = \cos(90^\circ) = 0$$

$$r_3 = \cos\left(\frac{5\pi}{6}\right) = -\cos(30^\circ) = -\frac{\sqrt{3}}{2}$$

Narysuj wykres wielomianu Czebyszewa $T_3(x)$

Wielomian Czebyszewa $T_3(x)$





$$|T_n(x)| \leq 1$$
 dla $x \in [-1, 1]$

Punkty ekstremalne wielomianów Czebyszewa

$$T_n\left(\cos\frac{j\pi}{n}\right)=(-1)^j$$
 $j=0,1,\ldots n$

Węzły Czebyszewa

Węzłami Czebyszewa x_0, \ldots, x_n są pierwiastki wielomianu Czebyszewa $T_{n+1}(x)$, czyli

$$x_j = \cos\left(\frac{(2j+1)\pi}{2(n+1)}\right) \qquad j = 0, 1, \dots, n$$

Twierdzenie

Niech funkcja f(x) ma n+1-szą pochodną ciągłą na przedziale [-1,1]. Niech węzałami interpolacji x_0,\ldots,x_n będą węzły Czebyszewa, czyli

$$x_j = \cos\left(\frac{(2j+1)\pi}{2(n+1)}\right)$$
 $j = 0, 1, \dots, n$

Wówczas dla $x \in [-1,1]$ błąd interpolacji ma następujące oszacownie z góry

$$|f(x) - w_n(x)| \le \frac{1}{2^n(n+1)!} \max_{t \in [-1,1]} |f^{(n+1)}(t)|$$

• Węzły Czebyszewa $x_j = \cos\left(\frac{2j+1}{2n+2}\pi\right)$ minimalizują wyrażenie M_n

$$M_n = \max_{t \in [-1,1]} \left| \prod_{j=0}^n (t - x_j) \right|$$

na przedziale [-1,1]

• Dla dowolnego przedziału [a, b] wyrażenie

$$M_n = \max_{t \in [a,b]} \left| \prod_{j=0}^n (t - x_j) \right|$$

jest minimalne dla węzłów interpolacji

$$x_j = \frac{a+b}{2} + \frac{b-a}{2} \cos\left(\frac{2j+1}{2n+2}\pi\right)$$

(Liniowa zamiana zmiennej ...)

