

《数值分析》之

函数逼近

徐岩

中国科学技术大学数学系

yxu@ustc.edu.cn

<http://staff.ustc.edu.cn/~yxu/>



中国科学技术大学

周期函数的插值

- 多项式函数不适合插值周期函数
- 如果函数的周期是 2π , 那么 $1, \cos x, \sin x, \cos 2x, \sin 2x, \dots$ 的线性组合是比较适当的插值函数
- Fourier分析: 若 f 是周期为 2π 的函数, 具有连续的一阶导数, 那么

$$\frac{a_0}{2} + \sum_{k=1}^{\infty} (a_k \cos kx + b_k \sin kx)$$

一致收敛于 f , 其中

$$a_k = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(t) \cos ktdt$$

$$b_k = \frac{1}{\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(t) \sin ktdt$$



中国科学技术大学

内积与伪内积

- 复Hilbert空间 $L_2[-\pi, \pi]$ 中的内积定义为

$$\langle f, g \rangle = \frac{1}{2\pi} \int_{-\pi}^{\pi} f(x) \overline{g(x)} dx$$

$\{E_k(x) = e^{ikx}\}$ 构成它的一组标准正交基

- 定义

$$\langle f, g \rangle_N = \frac{1}{N} \sum_{j=0}^{N-1} f(2\pi j/N) \overline{g(2\pi j/N)}$$

此时由 $\langle f, f \rangle_N = 0$ 无法得出 $f = 0$, 但它满足内积定义的其它性质, 如: 非负性, 共扼对称性, 线性性, 因此称为伪内积

- 伪范数

$$\|f\|_N = \sqrt{\langle f, f \rangle_N}$$

- $\|f\|_N = 0$ 当且仅当 $f(2\pi j/N) = 0, j = 0, \dots, N-1$

伪内积定理

Theorem

对任意 $N \geq 1$,

$$\langle E_k, E_m \rangle_N = \begin{cases} 1 & N|k-m \\ 0 & \text{其它} \end{cases}$$

证明:

$$\langle E_k, E_m \rangle_N = \frac{1}{N} \sum_{j=0}^{N-1} E_k\left(\frac{2\pi j}{N}\right) \overline{E_m\left(\frac{2\pi j}{N}\right)} = \frac{1}{N} \sum_{j=0}^{N-1} (e^{2\pi i(k-m)/N})^j$$

如果 $N|k-m$, 则 $e^{2\pi i(k-m)/N} = 1$, 因此得证。若 $N \nmid k-m$, 则可以应用几何数列求和公式:

$$\langle E_k, E_m \rangle_N = \frac{e^{2\pi i(k-m)} - 1}{e^{2\pi i(k-m)/N} - 1} = 0$$

- 一个次数至多是 n 次的指数多项式指的是下列形式的函数

$$P(x) = \sum_{k=0}^n c_k e^{ikx} = \sum_{k=0}^n c_k (e^{ix})^k$$

Theorem

基函数 $\{E_0, E_1, \dots, E_{N-1}\}$ 关于伪内积是标准正交的

指数多项式插值

Theorem

在等距结点 $x_j = 2\pi j/N$ 上插值给定函数 f 的次数不超过 $N-1$ 的指数多项式由下式唯一确定：

$$P = \sum_{k=0}^{N-1} c_k E_k, \quad c_k = \langle f, E_k \rangle_N$$

证明：存在性验证

$$\begin{aligned} \sum_{k=0}^{N-1} c_k E_k(x_v) &= \sum_{k=0}^{N-1} \langle f, E_k \rangle_N E_k(x_v) = \sum_{k=0}^{N-1} \frac{1}{N} \sum_{j=0}^{N-1} f(x_j) \overline{E_k(x_j)} E_k(x_v) \\ &= \sum_{j=0}^{N-1} f(x_j) \frac{1}{N} \sum_{k=0}^{N-1} \overline{E_j(x_k)} E_v(x_k) = \sum_{j=0}^{N-1} f(x_j) \langle E_v, E_j \rangle_N \\ &= f(x_v) \quad (E_k(x_v) = E_v(x_k)) \end{aligned}$$

唯一性证明

设 $\sum_{k=0}^{N-1} a_k E_k$ 是在 $x_j = 2\pi j/N, j = 0, 1, \dots, N-1$ 上插值 f 的指数多项式, 则

$$\sum_{k=0}^{N-1} a_k E_k(x_j) = f(x_j), \quad j = 0, \dots, N-1$$

两边同乘以 $\overline{E_n(x_j)}$, 再对 j 求和, 则有

$$\sum_{k=0}^{N-1} a_k \sum_{j=0}^{N-1} E_k(x_j) \overline{E_n(x_j)} = \sum_{j=0}^{N-1} f(x_j) \overline{E_n(x_j)}$$

此即

$$\sum_{k=0}^{N-1} a_k \langle E_k, E_n \rangle_N = \langle f, E_n \rangle_N$$

从而有 $a_n = \langle f, E_n \rangle_N = c_n$

指数多项式的计算

- 直接根据 $c_k = \langle f, E_k \rangle_N$ 计算所有的 c_k , 需要 $\mathcal{O}(N^2)$ 次乘法和加法
- 快速Fourier变换(FFT)把这个计算成本降到 $\mathcal{O}(N \log N)$.

N	N^2	$N \log_2 N$
1 024	1 048 576	10 240
4 096	16 777 216	49 152
16 384	268 435 456	229 375

Theorem

设 p 和 q 是次数不超过 $n-1$ 的指数多项式, 使得对点 $x_j = \pi j/n$ 有

$$p(x_{2j}) = f(x_{2j}), \quad q(x_{2j}) = f(x_{2j+1}), \quad j = 0, 1, \dots, n-1$$

则在点 $x_0, x_1, \dots, x_{2n-1}$ 上插值 f 的次数不超过 $2n-1$ 的指数多项式由下式给出:

$$P(x) = \frac{1}{2}(1 + e^{inx})p(x) + \frac{1}{2}(1 - e^{inx})q(x - \pi/n)$$

证明: 由于 e^{inx} 是 n 次的, 所以 $P(x)$ 的次数不超过 $2n-1$. 插值性可以直接验证. □

指数多项式的系数定理

Theorem

对于指数多项式定理中给出的多项式系数设为

$$p = \sum_{j=0}^{n-1} \alpha_j E_j \quad q = \sum_{j=0}^{n-1} \beta_j E_j \quad P = \sum_{j=0}^{2n-1} \gamma_j E_j$$

则对于 $0 \leq j \leq n-1$, 有

$$\begin{aligned} \gamma_j &= \frac{1}{2} \alpha_j + \frac{1}{2} e^{-ij\pi/n} \beta_j \\ \gamma_{j+n} &= \frac{1}{2} \alpha_j - \frac{1}{2} e^{-ij\pi/n} \beta_j \end{aligned}$$

- 设 $R(n)$ 表示计算点集 $\{2\pi j/n : 0 \leq j \leq n-1\}$ 上插值多项式的系数所需的最小乘法运算次数
- $R(2n) \leq 2R(n) + 2n$
 - 分别用 n 次运算计算出 $\frac{1}{2}\alpha_j$ 和 $\frac{1}{2}e^{-ij\pi/n}\beta_j$
- $R(2^m) \leq m2^m$
 - 归纳法: $R(2^{m+1}) = R(2 \cdot 2^m) \leq 2R(2^m) + 2 \cdot 2^m$

指数多项式求值

- 给定指数多项式

$$p(x) = \sum_{j=0}^{n-1} a_j E_j(x)$$

计算它在 $t - 2k\pi/n$, $k = 0, 1, \dots, n-1$ 上的值

- 令 $x_k = 2k\pi/n$,

$$\begin{aligned} p(t - x_k) &= \sum_{j=0}^{n-1} a_j E_j(t - x_k) = \sum_{j=0}^{n-1} a_j e^{ij(t-x_k)} \\ &= \sum_{j=0}^{n-1} a_j E^{ijt} \overline{E_k(x_j)} = n \langle g, E_k \rangle_n \end{aligned}$$

其中 g 是一个满足 $g(x_j) = a_j e^{ijt}$, $j = 0, 1, \dots, n-1$ 的函数。

这样对 g 进行FFT, 得到系数值 $\langle g, E_k \rangle_n$, 乘以 n 以后就得

到 $p(t - x_k)$