谱元法笔记

flag

2020年1月22日

1 问题和离散

求解区域 $\Omega = [0,1]^d$, 维数 d = 1,2,3。

Robin 边界特征值问题

$$-\Delta u(\mathbf{x}) + V(\mathbf{x})u(\mathbf{x}) = \lambda u(\mathbf{x}) \qquad \mathbf{x} \in \Omega$$
 (1)

$$\frac{\partial u}{\partial n}(\mathbf{x}) + h_0 u(\mathbf{x}) = 0 \qquad \mathbf{x} \in \partial \Omega$$
 (2)

Robin 边界源项问题

$$-\Delta u(\mathbf{x}) + V(\mathbf{x})u(\mathbf{x}) = f(\mathbf{x}) \qquad \mathbf{x} \in \Omega$$
(3)

$$\frac{\partial u}{\partial n}(\mathbf{x}) + h_0 u(\mathbf{x}) = g_0(\mathbf{x}) \qquad \mathbf{x} \in \partial\Omega$$
 (4)

Dirichlet 边界特征值问题

$$-\Delta u(\mathbf{x}) + V(\mathbf{x})u(\mathbf{x}) = \lambda u(\mathbf{x}) \qquad \mathbf{x} \in \Omega$$
 (5)

$$u(\mathbf{x}) = 0 \qquad \mathbf{x} \in \partial\Omega \tag{6}$$

Dirichlet 边界源项问题

$$-\Delta u(\mathbf{x}) + V(\mathbf{x})u(\mathbf{x}) = f(\mathbf{x}) \qquad \mathbf{x} \in \Omega$$
 (7)

$$u(\mathbf{x}) = 0 \qquad \mathbf{x} \in \partial\Omega \tag{8}$$

一维的情况时,区域 $\Omega = [0,1]$ 被均匀分成 M 个方格 $\Omega^{(m)}(m=0,1,\cdots,M-1)$,二维时,V(x) 区域 $\Omega = [0,1] \times [0,1]$ 被均匀分成 $M_1 \times M_2$ 个方格 $\Omega^{(m_1,m_2)}(m_1,m_2=0,1,\cdots,M-1)$ 。在每个方格上 $V(\mathbf{x})$ 是分片常数,而且大于 0。

Robin 边界特征值问题对应变分形式

find
$$\lambda, u \in \mathbb{C} \times H^1(\Omega)$$
 $(\nabla u, \nabla v) + (Vu, v) + (h_0 u, v)_{\partial\Omega} = \lambda(u, v)$ $\forall v \in H^1(\Omega)$ (9)

Robin 边界源项问题对应变分形式

find
$$u \in H^1(\Omega)$$
 $(\nabla u, \nabla v) + (Vu, v) + (h_0u, v)_{\partial\Omega} = (f, v) + (g_0, v)_{\partial\Omega} \quad \forall v \in H^1(\Omega)$ (10)

Dirichlet 边界特征值问题对应变分形式

find
$$\lambda, u \in \mathbb{C} \times H_0^1(\Omega)$$
 $(\nabla u, \nabla v) + (Vu, v) = \lambda(u, v)$ $\forall v \in H_0^1(\Omega)$ (11)

Dirichlet 边界源项问题对应变分形式

find
$$u \in H_0^1(\Omega)$$
 $(\nabla u, \nabla v) + (Vu, v) = (f, v)$ $\forall v \in H_0^1(\Omega)$ (12)

其中区域内部和边界上的内积定义为

$$(u,v) = \int_{\Omega} u(x)v(x) dx$$
 $(u,v)_{\partial\Omega} = \int_{\partial\Omega} u(x)v(x) dx$

区域被分成的方格就是天然的剖分。选取 V_N 是分片 N 次多项式,而且整体连续的函数空间。 V_N^0 是在 V_N 中,且边界为 0 的函数空间。

问题离散形式就是在变分形式中把空间选取为 V_N 和 V_N^0 。

设 $\phi_1(\mathbf{x}), \phi_2(\mathbf{x}), \cdots \phi_N(\mathbf{x})$ 是函数空间的一组基,数值解 $u_N(\mathbf{x})$ 可以表示为

$$u_N(\mathbf{x}) = \sum_{i=1}^N U_i \phi_i(x)$$

系数向量 $U=(U_1,U_2,\cdots,U_N)^T$ 。 离散问题可以写成矩阵形式

$$AU = F$$
 and $AU = \lambda BU$ (13)

其中矩阵元素为

$$A_{i,j} = (\nabla \phi_i, \nabla \phi_j) + (V \phi_i, \phi_j) + (h_0 \phi_i, \phi_j)_{\partial \Omega}$$
$$B_{i,j} = (\phi_i, \phi_j) \qquad F_i = (f, \phi_i) + (g_0, \phi_i)_{\partial \Omega}$$

内积中的积分可以表示为

$$(u,v) = \sum_{m=0}^{M} \int_{\Omega^{(m)}} u(x)v(x) dx$$

边界上的内积也类似。所以只需要求出单元上的矩阵 $A^{(m)}, B^{(m)}, F^{(m)}$ 然后按照一定规则拼合起来,就可以得到全局的矩阵。

2 单元基函数

2.1 一维的情况

一维的参考单元 $\hat{\Omega} = [-1,1]$,选取参考单元上的一组基函数为

$$\phi_k(x) = \begin{cases} (1-x)/2 = (L_0(x) - L_1(x))/2 & k = 0\\ (L_{k+1}(x) - L_{k-1}(x))/\sqrt{4k+2} & 1 \le k \le N-1\\ (1+x)/2 = (L_0(x) + L_1(x))/2 & k = N \end{cases}$$
(14)

共 N+1 个,编号从 0 开始。其中 L(x) 是勒让德多项式。

近似解就是由这组基张成的函数

$$u_N(x) = U_0\phi_0(x) + U_1\phi_1(x) + \dots + U_N\phi_N(x)$$

此时 ϕ_0 的系数就是函数在左端点的函数值, ϕ_N 的系数就是函数在右端点的函数值。在很多块区域拼起来时,这两个就是边界上的自由度。

根据公式 $(2k+1)L_k(x) = L'_{k+1}(x) - L'_{k-1}(x)$ 得到

$$\phi_k'(x) = \begin{cases} -\frac{1}{2} & k = 0\\ \frac{\sqrt{4k+2}}{2} L_k(x) & 1 \le k \le N-1\\ \frac{1}{2} & k = N \end{cases}$$
 (15)

所以在参考单元上, $(\phi_j(x),\phi_k'(x))$ 形成的矩阵是

$$\hat{A} = \begin{bmatrix} \frac{1}{2} & & & -\frac{1}{2} \\ & 1 & & \\ & & \ddots & \\ & & 1 & \\ -\frac{1}{2} & & & \frac{1}{2} \end{bmatrix}$$
 (16)

共 3N+5 个非零元,矩阵编号从 0 开始。矩阵中只有第一行和最后一行,第一列和最后一列特殊。其它满足

$$(\phi_k',\phi_k')=1 \quad 其中 \quad (k=1,2,\cdots,N-1)$$

同样得到,在参考单元上, $(\phi_i(x),\phi_k(x))$ 形成的矩阵是

$$\hat{B} = \begin{bmatrix}
\frac{2}{3} & -\frac{1}{\sqrt{6}} & \frac{1}{3\sqrt{10}} & & & \frac{1}{3} \\
-\frac{1}{\sqrt{6}} & \frac{2}{5} & 0 & -\frac{1}{5\sqrt{21}} & & -\frac{1}{\sqrt{6}} \\
\frac{1}{3\sqrt{10}} & 0 & \frac{2}{21} & 0 & * & -\frac{1}{3\sqrt{10}} \\
& -\frac{1}{5\sqrt{21}} & 0 & * & 0 & * \\
& & * & 0 & * & 0 & * \\
& & & * & 0 & * & 0 \\
& & & * & 0 & * & 0 \\
& & & & * & 0 & * & 0 \\
& & & & * & 0 & * & 0 \\
& & & & & 0 & \frac{2}{3}
\end{bmatrix} \tag{17}$$

共 3N+5 个非零元,矩阵编号从 0 开始。矩阵中只有第一行和最后一行,第一列和最后一列特殊。其它满足

$$(\phi_k, \phi_k) = \frac{2}{(2k+3)(2k-1)}$$
 其中 $(k=1, 2, \dots, N-1)$

和

$$(\phi_k, \phi_{k+2}) = (\phi_{k+2}, \phi_k) = -\frac{1}{(2k+3)\sqrt{(2k+5)(2k+1)}} \quad \sharp \Phi \quad (k=1, 2, \dots, N-3)$$

一维的情况下,对 f(x) = 1 的情况,由于高次的勒让德多项式都和零次多项式正交,所以

$$(1, \phi_j) = \begin{cases} 1 & j = 0 \text{ or } j = N \\ -\frac{2}{\sqrt{6}} & j = 1 \\ 0 & \text{ortherwise} \end{cases}$$
 (18)

对应向量为

$$\hat{F} = \begin{bmatrix} 1 \\ -\frac{2}{\sqrt{6}} \\ 0 \\ \vdots \\ 1 \end{bmatrix} \tag{19}$$

下面考虑边界上的情况。一维的情况下,边界上的内积就是 $(\phi_i,\phi_j)_{\partial\hat{\Omega}} = \phi_i(0)\phi_j(0) + \phi_i(1)\phi_j(1)$ 。对应只有两个矩阵元素不为 0,矩阵为

$$\hat{H} = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & \ddots & 0 \\ & 0 & 1 \end{bmatrix}_{(N+1)\times(N+1)}$$
(20)

同样有 $(1,\phi_i)_{\partial\hat{\Omega}} = \phi_i(0) + \phi_i(1)$ 。对应右端向量为

$$\hat{G} = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \\ \vdots \\ 1 \end{bmatrix} \tag{21}$$

此时,对于数值解

$$u_N(x) = \sum_{n=0}^{N} U_n \phi_n(x)$$

对应的系数向量 $U = (U_0, U_1, \cdots, U_N)$, 双线性型表示为

$$(\nabla u_N, \nabla v_N) = U^T \hat{A} V \qquad (u_N, v_N) = U^T \hat{B} V \qquad (1, v_N) = \hat{F}^T V$$
$$(u_N, v_N)_{\partial \hat{\Omega}} = U^T \hat{H} V \qquad (1, v_N)_{\partial \hat{\Omega}} = \hat{G}^T V$$

如果不对区域分割,V(x) 是整体常数,直接在参考单元上求解,就相当于直接使用谱方法求解。要求解的方程组是

$$(\hat{A} + V\hat{B} + h_0\hat{H})U = \hat{F} + g_0\hat{G} \quad \text{and} \quad (\hat{A} + V\hat{B} + h_0\hat{H})U = \lambda \hat{B}U$$
 (22)

下面我们考虑如何把空间分割,并把不同的区域拼合起来。

对于长度为 h_m 的一般单元 $\Omega^{(m)} = [x_m, x_{m+1}]$,设 χ_m 是参考单元到当前单元的仿射变换,就得到当前单元上的基函数为 $\{\phi_k(\chi_m^{-1}(x))\}$

因为一维的变换就是区间伸缩和平移,所以

$$\chi_m(x) = \frac{h_m}{2}x + b_m \qquad \chi'_m(x) = \frac{h_m}{2}$$

当前单元上的内积为

$$(\phi_i^{(m)}, \phi_j^{(m)}) = \int_{x_m}^{x_{m+1}} \phi_i(\chi_m^{-1}(x)) \phi_j(\chi_m^{-1}(x)) dx$$

积分变换的过程省略,在小区间上的矩阵是

$$A^{(m)} = \frac{2}{h_m} \hat{A}$$
 $B^{(m)} = \frac{h_m}{2} \hat{B}$ $F^{(m)} = \frac{h_m}{2} \hat{F}$

边界不用管,拼合之后的边界就变了。

下面要把小区间上的自由度对应到整体的自由度,在这个过程中要保证整体的函数是连续的,就是 $\Omega^{(m)}$ 上的自由度 $U_N^{(m)}$ 和 $\Omega^{(m+1)}$ 上的自由度 $U_0^{(m+1)}$ 必须是同一个。这样,局部编号 $U_n^{(m)}$ 的自由度对应总体自由度为 mN+n (所有的编号都是从 0 开始的)。

(此处应该有图)

对于边界,只要考虑 $\Omega^{(0)}$ 上的 $U_0^{(0)}$ 和 $\Omega^{(M-1)}$ 上的自由度 $U_N^{(M-1)}$,在最后的矩阵里把它们分别加上 h_0 就可以了。就是相当于加上

$$\tilde{H} = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & \ddots & 0 \\ & 0 & 1 \end{bmatrix}_{(MN+1)\times(MN+1)}$$
(23)

右端项同样也要加上

$$\hat{G} = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \\ \vdots \\ 1 \end{bmatrix}_{MN+1} \tag{24}$$

2.2 二维的情况

二维的参考单元是 $\hat{\Omega} = [-1,1] \times [-1,1]$,二维的基函数是张量形式的

$$u_N(x,y) = \sum_{n_1,n_2=0}^{N_1,N_2} U_{n_1,n_2} \phi_{n_1}(x) \phi_{n_2}(y)$$

在参考单元上 $(\nabla \phi_i(x)\phi_i(y), \nabla \phi_k(x)\phi_l(y))$ 就是

$$\begin{split} &\int_{[-1,1]\times[-1,1]} \phi_i'(x)\phi_j(y)\phi_k'(x)\phi_l(y) \ dxdy + \int_{[-1,1]\times[-1,1]} \phi_i(x)\phi_j'(y)\phi_k(x)\phi_l'(y) \ dxdy \\ &= \int_{-1}^1 \phi_i'(x)\phi_k'(x) \ dx \int_{-1}^1 \phi_j(y)\phi_l(y) \ dy + \int_{-1}^1 \phi_i(x)\phi_k(x) \ dx \int_{-1}^1 \phi_j'(y)\phi_l'(y) \ dy \\ &= \hat{A}_{i,k}\hat{B}_{j,l} + \hat{B}_{i,k}\hat{A}_{j,l} \end{split}$$

在参考单元上 $(\phi_i(x)\phi_j(y),\phi_k(x)\phi_l(y))$ 就是

$$\int_{[-1,1]\times[-1,1]} \phi_i(x)\phi_j(y)\phi_k(x)\phi_l(y) \ dxdy$$

$$= \int_{-1}^1 \phi_i(x)\phi_k(x) \ dx \int_{-1}^1 \phi_j(y)\phi_l(y) \ dy$$

$$= \hat{B}_{i,k}\hat{B}_{j,l}$$

在参考单元上 $(1,\phi_i(x)\phi_j(y))$ 就是

$$\int_{[-1,1]\times[-1,1]} \phi_i(x)\phi_j(y) \ dxdy = \int_{-1}^1 \phi_i(x) \ dx \int_{-1}^1 \phi_j(y) \ dy = \hat{F}_i \hat{F}_j$$

在参考单元边界上 $(\phi_i(x)\phi_j(y),\phi_k(x)\phi_l(y))_{\partial\hat{\Omega}}$ 就是

$$\int_{-1}^{1} \phi_{i}(1)\phi_{j}(y)\phi_{k}(1)\phi_{l}(y) dy + \int_{-1}^{1} \phi_{i}(-1)\phi_{j}(y)\phi_{k}(-1)\phi_{l}(y) dy
+ \int_{-1}^{1} \phi_{i}(x)\phi_{j}(1)\phi_{k}(x)\phi_{l}(1) dx + \int_{-1}^{1} \phi_{i}(x)\phi_{j}(-1)\phi_{k}(x)\phi_{l}(-1) dx
= (\phi_{j}(-1)\phi_{l}(-1) + \phi_{j}(1)\phi_{l}(1)) \int_{-1}^{1} \phi_{i}(x)\phi_{k}(x) dx
+ (\phi_{i}(-1)\phi_{k}(-1) + \phi_{i}(1)\phi_{k}(1)) \int_{-1}^{1} \phi_{j}(y)\phi_{l}(y) dy
= \hat{H}_{i,k}\hat{B}_{j,l} + \hat{B}_{i,k}\hat{H}_{j,l}$$

在参考单元边界上 $(1, \phi_k(x)\phi_l(y))_{\partial \hat{\Omega}}$ 就是

$$\int_{-1}^{1} \phi_{k}(1)\phi_{l}(y) dy + \int_{-1}^{1} \phi_{k}(-1)\phi_{l}(y) dy + \int_{-1}^{1} \phi_{k}(x)\phi_{l}(1) dx + \int_{-1}^{1} \phi_{k}(x)\phi_{l}(-1) dx
= (\phi_{l}(-1) + \phi_{l}(1)) \int_{-1}^{1} \phi_{k}(x) dx + (\phi_{k}(-1) + \phi_{k}(1)) \int_{-1}^{1} \phi_{l}(y) dy
= \hat{G}_{k}\hat{F}_{l} + \hat{F}_{k}\hat{G}_{l}$$

此时,对于

$$u_N(x,y) = \sum_{i,j=0}^{N_x,N_y} U_{i,j}\phi_i(x)\phi_j(y)$$

双线性型表示为

$$(\nabla u_{N}, \nabla v_{N}) = \sum_{i,j,k,l} U_{i,j} (\hat{A}_{i,k} \hat{B}_{j,l} + \hat{B}_{i,k} \hat{A}_{j,l}) V_{k,l}$$

$$(u_{N}, v_{N}) = \sum_{i,j,k,l} U_{i,j} \hat{B}_{i,k} \hat{B}_{j,l} V_{k,l}$$

$$(u_{N}, v_{N})_{\partial \hat{\Omega}} = \sum_{i,j,k,l} U_{i,j} (\hat{H}_{i,k} \hat{B}_{j,l} + \hat{B}_{i,k} \hat{H}_{j,l}) V_{k,l}$$

$$(1, v_{N}) = \sum_{i,j} \hat{F}_{i} V_{i,j} \hat{F}_{j}$$

$$(1, v_{N})_{\partial \hat{\Omega}} = \sum_{i,j} \sum_{i,j} V_{i,j} (\hat{G}_{i} \hat{F}_{j} + \hat{F}_{i} \hat{G}_{j})$$

对应的系数向量拉直成一维的

$$U = (U_{0,0}, U_{0,1}, \cdots, U_{0,N_2}, U_{1,0}, U_{1,1}, \cdots, U_{N_1,N_2})$$

此时 U_{n_1,n_2} 对应的一维下标是 $n_1(N_1+1)+n_2$ 。 双线性型表示为

$$(\nabla u_N, \nabla v_N) = U^T (\hat{A} \otimes \hat{B} + \hat{B} \otimes \hat{A}) V \qquad (u_N, v_N) = U^T (\hat{B} \otimes \hat{B}) V \qquad (1, v_N) = (\hat{F} \otimes \hat{F})^T V$$
$$(u_N, v_N)_{\partial \hat{\Omega}} = U^T (\hat{B} \otimes \hat{H} + \hat{H} \otimes \hat{B}) V \qquad (1, v_N)_{\partial \hat{\Omega}} = (\hat{F} \otimes \hat{G} + \hat{G} \otimes \hat{F})^T V$$

如果不对区域分割,V(x) 是整体常数,直接在参考单元上求解,就相当于直接使用谱方法求解。要求解的方程组是

$$[(\hat{A} \otimes \hat{B} + \hat{B} \otimes \hat{A}) + V(\hat{B} \otimes \hat{B}) + h_0(\hat{B} \otimes \hat{H} + \hat{H} \otimes \hat{B})]U = (\hat{F} \otimes \hat{F}) + g_0(\hat{F} \otimes \hat{G} + \hat{G} \otimes \hat{F})$$
(25)

$$[(\hat{A} \otimes \hat{B} + \hat{B} \otimes \hat{A}) + V(\hat{B} \otimes \hat{B}) + h_0(\hat{B} \otimes \hat{H} + \hat{H} \otimes \hat{B})]U = \lambda(\hat{B} \otimes \hat{B})U$$
 (26)

下面我们考虑如何把空间分割,并把不同的区域拼合起来。

对于长度为 $h_{m_1} \times h_{m_2}$ 的一般单元 $\Omega^{(m_1,m_2)} = [x_{m_1},x_{m_1+1}] \times [y_{m_2},y_{m_2+1}]$, 设 χ 是参考单元到当前单元的仿射变换,就得到当前单元上的基函数为 $\{\phi_{n_1}(\chi^{-1}(x,y))\phi_{n_2}(\chi^{-1}(x,y))\}$ 。

因为只考虑矩形分割,所以二维的仿射变换也可以看成分别在每个维度上伸缩和平移。积 分变换的部分省略,在小区间上的矩阵是

$$A^{(m)} = \hat{A}$$
 $B^{(m)} = \frac{4}{h_{m_1} h_{m_2}} \hat{B}$ $F^{(m)} = \frac{h_{m_1} h_{m_2}}{2} \hat{F}$

边界不用管,拼合之后的边界就变了。

下面要把小区域上的自由度对应到整体的自由度,在这个过程中要保证整体的函数是连续的。

小区域 $\Omega^{(m_1,m_2)}$ 的右边界为

$$\sum_{n_1,n_2=0}^{N_1,N_2} U_{n_1,n_2}^{(m_1,m_2)} \phi_{n_1}(1) \phi_{n_2}(y) = \sum_{n_2=0}^{N_2} U_{N_1,n_2}^{(m_1,m_2)} \phi_{n_2}(y)$$

小区域 $\Omega^{(m_1+1,m_2)}$ 的左边界为

$$\sum_{n_1, n_2=0}^{N_1, N_2} U_{n_1, n_2}^{(m_1+1, m_2)} \phi_{n_1}(-1) \phi_{n_2}(y) = \sum_{n_2=0}^{N_2} U_{0, n_2}^{(m_1+1, m_2)} \phi_{n_2}(y)$$

想要让函数整体连续,必须在边界上基函数的系数相同,就是 $U_{0,n_2}^{(m_1+1,m_2)}$ 和 $U_{N_1,n_2}^{(m_1,m_2)}$ 必须是同一个。

对上下左右四条边界的要求都是一样的。最后得到单元自由度 $U_{n_1,n_2}^{(m_1,m_2)}$ 对应的总体二维下标是 $(m_1N_1+n_1,+m_2N_2+n_2)$,再拉直成一维坐标就是 $(m_1N_1+n_1)(M_1N_1+1)+m_2N_2+n_2$ 所有的编号都是从 0 开始的。

(此处也应该有图)

注: 程序里面只有 $N_1 = N_2$ 且 $M_1 = M_2$ 的情况。

下面考虑边界, 边界分为上下左右四部分考虑。

左边界是由 $\Omega^{(0,0)},\Omega^{(0,1)},\cdots,\Omega^{(0,M_2-1)}$ 的左边界拼接成的。在 $\Omega^{(0,m_2)}$ 的左边界上, (u_N,v_N) 表示为

$$\sum_{i,j,k,l} U_{i,j}^{(0,m_2)} V_{k,l}^{(0,m_2)} \int_{-1}^{1} \phi_i(-1) \phi_j(y) \phi_k(-1) \phi_l(y) \ dy = \sum_{j,l} U_{0,j}^{(0,m_2)} V_{0,l}^{(0,m_2)} \hat{B}_{j,l}$$

对于左边界,系数矩阵拉直成一维之后的单元刚度矩阵是 $\hat{B}\otimes\hat{H}^0$ 。同理,右边界的是 $\hat{B}\otimes\hat{H}^1$,上边界的是 $\hat{H}^1\otimes\hat{B}$,下边界的是 $\hat{H}^0\otimes\hat{B}$ 。

$$\hat{H}^{0} = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & \ddots & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{bmatrix}_{(N+1)\times(N+1)} \qquad \hat{H}^{1} = \begin{bmatrix} 0 & 0 \\ 0 & \ddots & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix}_{(N+1)\times(N+1)}$$
(27)

对于右端项,同样的。左边界是 $\hat{F}\otimes\hat{G}^0$ 。同理,右边界的是 $\hat{F}\otimes\hat{G}^1$,上边界的是 $\hat{G}^1\otimes\hat{F}$,下边界的是 $\hat{G}^0\otimes\hat{F}$ 。

$$\hat{G}^{0} = \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \\ \vdots \\ 0 \end{bmatrix}_{N+1} \qquad \hat{G}^{1} = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \\ \vdots \\ 1 \end{bmatrix}_{N+1}$$
(28)

边界上的尺度变换系数是 $h_m/2$

3 目标问题