

Задача 1.1 Построить для ур-ия $y'(x) = f(x)$ разн. сх. с наименьшим порядком аппр. на реш-ии.

$$\frac{y_k - y_{k-2}}{2h} = a_1 f_k + a_0 f_{k-1} + a_{-1} f_{k-2}.$$

Реш-ие:

Рассм. разн. схему:

$$\begin{cases} \frac{y_k - y_{k-2}}{2h} = a_1 f_k + a_0 f_{k-1} + a_{-1} f_{k-2}, & k=2, \dots, N, & f_k := f(x_k) \\ y_0 = y^0 & x_k = kh, & h = \frac{1}{N} \\ y_1 = y^1 \end{cases}$$

Определим опер-ру преобразования:

$$[y]_{y_h} := \begin{pmatrix} y(0) \\ y(x_k) \\ y(1) \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{N+1}, \quad [f]_{F_h} := \begin{pmatrix} f(h) \\ \vdots \\ f(1-h) \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{N-1}$$

$\|y\|_h = \max_k |y_k|$ - норма в пр-вах y_h, F_h, Φ_h

Опр. Разн. сх. $\begin{cases} L_h y_h = f_h \\ \Phi_h y_h = \varphi_h \end{cases}$ аппр-ет задачу $\begin{cases} y' = f & \text{на реш-ии,} \\ y = \varphi \end{cases}$ (4)

если $\exists c_1, c_2, p_1, p_2, h_0: \forall h \leq h_0$ выполн-но

$$\|L_h [y]_{y_h} - f_h\|_{F_h} \leq c_1 h^{p_1}, \quad \|\Phi_h [y]_{y_h} - \varphi_h\|_{\Phi_h} \leq c_2 h^{p_2}, \quad \text{где } y \text{ - реш-ие г. (4)}$$

и выполн-но: $\|[f]_{F_h} - f_h\|_{F_h} \rightarrow 0, \quad \|\varphi_h - \varphi_h\|_{\Phi_h} \rightarrow 0, \quad h \rightarrow 0.$

$$\bullet \| [\varphi]_{\Phi_h} - \varphi_h \|_{\Phi_h} = 0$$

$$\bullet \| [f]_{F_h} - f_h \|_{F_h} = \left\| \begin{pmatrix} f(h) \\ \vdots \\ f(1-h) \end{pmatrix} - \begin{pmatrix} a_1 f(x_k) + a_0 f(x_{k-1}) + a_{-1} f(x_{k-2}) \end{pmatrix} \right\| =$$

$$= \max_{k=2, N} \left| f(x_{k-1}) - (a_1 f(x_k) + a_0 f(x_{k-1}) + a_{-1} f(x_{k-2})) \right| = O(h) \xrightarrow{h \rightarrow 0} 0 \Leftrightarrow (a_1 + a_0 + a_{-1} = 1) \text{ т.е. ур-ие}$$

$$\bullet \| \Phi_h [y]_{y_h} - \varphi_h \|_{\Phi_h} = \left\| \begin{pmatrix} y(0) \\ y(x_k) \\ y(1) \end{pmatrix} - \begin{pmatrix} y^0 \\ y^1 \end{pmatrix} \right\| = 0.$$

$$\bullet \| L_h [y]_{y_h} - f_h \|_{F_h} = \max_{k=2, N} \left| \frac{y(x_k) - y(x_{k-2})}{2h} - a_1 f(x_k) - a_0 f(x_{k-1}) - a_{-1} f(x_{k-2}) \right|$$

$$y(x_k) = y(x_{k-1}) + y'(x_{k-1})h + \frac{y''(x_{k-1})h^2}{2} + \frac{y'''(x_{k-1})h^3}{3!} + \frac{y^{(4)}(x_{k-1})h^4}{4!} + O(h^5)$$

$$y(x_{k-2}) = y(x_{k-1}) - y'(x_{k-1})h + \frac{y''(x_{k-1})h^2}{2} - \frac{y'''(x_{k-1})h^3}{3!} + \frac{y^{(4)}(x_{k-1})h^4}{4!} + O(h^5)$$

$$f(x_k) = f(x_{k-1}) + f'(x_{k-1})h + \frac{f''(x_{k-1})h^2}{2} + \frac{f'''(x_{k-1})h^3}{3!} + O(h^4)$$

$$f(x_{k-2}) = f(x_{k-1}) - f'(x_{k-1})h + \frac{f''(x_{k-1})h^2}{2} - \frac{f'''(x_{k-1})h^3}{3!} + O(h^4)$$

$y'(x_k) = f(x_k)$
т.к. у-реш-ие.

коэф. при $h: a_1 = a_{-1}$, коэф. при $h^2: \frac{y'''(x_{k-1})}{3!} - a_1 f'(x_{k-1}) \frac{h^2}{2} - a_{-1} f'(x_{k-1}) \frac{h^2}{2} = 0$

(1)

\Rightarrow имеем сист. ур-ий:

$$\begin{cases} a_1 + a_0 + a_{-1} = 1 \\ a_1 = a_{-1} \\ \frac{1}{6} - \frac{a_1}{2} - \frac{a_{-1}}{2} = 0 \end{cases}$$

$$\begin{cases} a_1 = a_{-1} \\ \frac{1}{6} - a_1 = 0 \\ a_0 + 2a_1 = 1 \end{cases}$$

$$\begin{cases} a_1 = a_{-1} \\ a_1 = \frac{1}{6} = a_{-1} \\ a_0 = 1 - 2a_1 = 1 - \frac{1}{3} = \frac{2}{3} \end{cases}$$

При этом, кор. ангр. на реш.-м: $\rho = 4$.

Задача 1.2 Иссл. устойчивость разн. схем

$$\theta \frac{y_{k+1} - y_k}{h} + (1-\theta) \frac{y_k - y_{k-1}}{h} = f_k \text{ при } \theta \in [0, 1].$$

Реш.-ие:

Исследует сх. на Δ -уст-ть.

Опр. Разн. сх. $\frac{1}{h} \sum_{n=0}^m a_n y_{k-n} = f_k$ Δ -уст-ва, если все корни хар.-го ур-ия $\sum_{n=0}^m a_n \mu^{k-n} = 0$ удовл.-ют усл. $|\mu| \leq 1$, причем, на границе круга ($|\mu|=1$) нет кратных корней.

$$\text{Хар. ур-ие: } \theta(\mu^2 - \mu) + (1-\theta)(\mu - 1) = 0$$

$$\theta\mu(\mu-1) + (1-\theta)(\mu-1) = 0$$

$$(\mu-1)(\theta\mu + 1 - \theta) = 0$$

$$\mu = 1$$

$$\theta\mu + 1 - \theta = 0$$

$$\bullet \theta = 0$$

$\Rightarrow 1$ корень
ур-ия: $\mu = 1$
 $\rightarrow \Delta$ -уст.

$$\bullet \theta \neq 0$$

$$\mu = \frac{\theta-1}{\theta} = 1 - \frac{1}{\theta}$$

$$\left| 1 - \frac{1}{\theta} \right| \leq 1$$

$$\begin{cases} 1 - \frac{1}{\theta} \leq 1 \\ 1 - \frac{1}{\theta} \geq -1 \end{cases} \Rightarrow \begin{cases} \frac{1}{\theta} \geq 0 \\ \frac{1}{\theta} \leq 2 \end{cases}$$

$$\Rightarrow \frac{1}{\theta} \leq 2$$

$$\theta \geq \frac{1}{2}$$

\Rightarrow проверим, что $1 - \frac{1}{\theta} \neq 1$,
т.е. нет кр. корней на
границе, действ., $1 - \frac{1}{\theta} \neq 0$.

\Rightarrow при $\theta = \{0\} \cup [\frac{1}{2}, 1]$ сх. Δ -уст.

Задача 1.3 Для задачи $y' = y, y(0) = 1$ рассл. схему

$$\frac{y_{k+1} - y_k}{h} = \frac{y_{k+1} + y_k}{2}, y_0 = 1, k \geq 0.$$

В разн. ошибки $y(x_n) - y_n = c_1 h + c_2 h^2 + \dots$ найти наиб.-ую c_1 для $x_n = nh = 1$

Реш.-ие:

$$\frac{y_{k+1}}{h} - \frac{y_k}{h} = \frac{y_{k+1} + y_k}{2}$$

$$y_{k+1} \left(\frac{1}{h} - \frac{1}{2} \right) = y_k \left(\frac{1}{h} + \frac{1}{2} \right) \quad | \cdot h$$

$$y_{k+1} \left(1 - \frac{h}{2} \right) = y_k \left(1 + \frac{h}{2} \right), \quad k \geq 0$$

$$\Rightarrow y_N = y_{N-1} \cdot \frac{1 + \frac{h}{2}}{1 - \frac{h}{2}} = \dots = y_0 \left(\frac{1 + \frac{h}{2}}{1 - \frac{h}{2}} \right)^N = \left(\frac{1 + \frac{h}{2}}{1 - \frac{h}{2}} \right)^N$$

реш-ие задачи $\begin{cases} y' = y \\ y(0) = 1 \end{cases} \rightarrow y(x) = e^x \rightarrow \frac{1}{h} (\ln(1 + \frac{h}{2}) - \ln(1 - \frac{h}{2}))$

$$\Rightarrow y(x_N) - y_N = e - \left(\frac{1 + \frac{h}{2}}{1 - \frac{h}{2}} \right)^{\frac{1}{h} \ln \frac{1 + \frac{h}{2}}{1 - \frac{h}{2}}} = e - e = 0$$

$$\ln(1 + \frac{h}{2}) - \ln(1 - \frac{h}{2}) = \frac{h}{2} - \frac{1}{2} \left(\frac{h}{2} \right)^2 + \frac{1}{3} \left(\frac{h}{2} \right)^3 + \frac{1}{4} \left(\frac{h}{2} \right)^4 + O(h^5) + \frac{1}{2} + \frac{1}{2} \left(\frac{h}{2} \right)^2 +$$

$$+ \frac{1}{3} \left(\frac{h}{2} \right)^3 + \frac{1}{4} \left(\frac{h}{2} \right)^4 + O(h^5) = h + \frac{h^3}{8} + O(h^5) = h + \frac{h^3}{12} + O(h^5)$$

(+) $\Rightarrow y(x_N) - y_N = e - e^{1 + \frac{h^2}{12} + O(h^4)} = e \left(1 - e^{\frac{h^2}{12} + O(h^4)} \right) = -\frac{eh^2}{12} + O(h^4) \Rightarrow c_1 = 0$

Задача 1.4 Две задачи $y' + 5y = \sin 2x$, $y(0) = 2$, построить двухточечную разностную сх. 2-го порядка сходимости.

Реш-ие:

Рассм. разк. схему

$$\frac{y_{k+1} - y_k}{h} + 5 \frac{y_{k+1} + y_k}{2} = f_k := f(x_k + \frac{h}{2}), \quad k = 0, N-1, \quad x_k = kh, \quad h = \frac{1}{N}$$

$$y_0 = 2$$

Определим векр-пространство:

$$[y]_{y_h} = \begin{pmatrix} y(0) \\ y(x_h) \\ \vdots \\ y(1) \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{N+1}, \quad [f]_{F_h} = \begin{pmatrix} f(\frac{h}{2}) \\ \vdots \\ f(1 - \frac{h}{2}) \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^N$$

$$\|g\|_h = \max_k |g_k| \text{ - норма в пр-вах } y_h, F_h, \Phi_h$$

В соотв-ии с опр., приведенным в [2.1.1], исследуем аппр. на реш-ие:

$$\cdot \left\| \frac{[y]_{y_h} - y_h}{2} \right\|_{y_h} = 0$$

$$\cdot \left\| \frac{[f]_{F_h} - f_h}{2} \right\|_{F_h} = \left\| \begin{pmatrix} f(\frac{h}{2}) \\ \vdots \\ f(1 - \frac{h}{2}) \end{pmatrix} - \begin{pmatrix} f(\frac{h}{2}) \\ \vdots \\ f(1 - \frac{h}{2}) \end{pmatrix} \right\| = 0$$

$$\cdot \left\| \frac{[y]_{y_h} - y_h}{2} \right\|_{y_h} = \|y(0) - 2\| = 0$$

$$\|L_h \Sigma y - f_h\|_{F_h} = \max_{k=0, N-1} \left| \frac{y(x_{k+1}) - y(x_k)}{h} + 5 \frac{y(x_{k+1}) + y(x_k)}{2} - f(x_k + \frac{h}{2}) \right| = O(h^3)$$

$y(x_{k+1}) = y(x_k) + y'(x_k)h + \frac{y''(x_k)}{2}h^2 + O(h^3)$
 $y(x_k) = f(x_k) + f'(x_k)\frac{h}{2} + O(h^2)$
 $y'(x_k) = f'(x_k) + O(h)$
 $f(x_k + \frac{h}{2}) = f(x_k) + f'(x_k)\frac{h}{2} + O(h^2)$

\Rightarrow пор. аппр. на реш-ии : $p=2$.

Th. (Рункина)

$$\begin{cases} L_h y_h = f_h & (3) \\ l_h y_h = \varphi_h & (4) \end{cases} \quad \begin{cases} Ly = f & (1) \\ ly = \varphi & (2) \end{cases}$$

Пусть:

1. (1,2), (3,4) - левые задачи

2. $\exists!$ реш-ие z . (1,2)

3. Разн. схема аппр-ей τ z . (1,2) на реш-ии с пор. p .

4. Разн. сх. уст-ва.

Тогда реш-ие $z(3,4)$ сх-ой к реш-ию z . (1,2) с пор. не менее p .

Т.е. сх-та = аппр. + уст-ва, но мы будем исследовать лишь α -уст-ва.

Т.е. сх-та = аппр. + уст-ва, но мы будем исследовать лишь α -уст-ва.

По опр.: $\mu-1=0 \Rightarrow$ схема α -уст. \Rightarrow сх. сх-ой с пор. не менее $p=2$.

Задача 1.5 Построить аппр. на реш-ии 2-го порядка по точкам

$x_0=0$ и $x_1=h$ крайние условия $u'(0)-u(0)=0$ для ур-ия $u''-2u = \sin x - 1$

Реш-ие:

Будем искать аппр. в виде: $\frac{u(h)-u(0)}{h} - u(0) = f$, т.е. $\left| \frac{u(h)-u(0)}{h} - u(0) - f \right| = O(h^3)$

$\Leftrightarrow \left| u'(0) + u''(0)\frac{h}{2} + O(h^2) - u(0) - f \right| = O(h^2)$

$\Leftrightarrow |u''(0)\frac{h}{2} - f + O(h^2)| = O(h^2)$

$\rightarrow \int f = u''(0)\frac{h}{2} = \left(\sin 0 - 1 + 2u(0) \right) \frac{h}{2} = (2u_0 - 1)\frac{h}{2} = (u_0 - \frac{1}{2})h$

$\Rightarrow \frac{u_1 - u_0}{h} - u_0 = (u_0 - \frac{1}{2})h$ - аппр. на реш-ии 2-го пор.

Задача 1.6 Для задачи

$-u''(x) + ru(x) = f(x)$, $r = \text{const} > 0$, $u(0) = a$, $u'(1) = b$ построить на нестесн. сетке разн. сх. 2-го пор. сх-ты, т.е. док-ть аппр., уст-ва по правой части, сформ-ть геор. Рункина.

Реш-ие:

Рассм. схему

$$\begin{cases} -\frac{u_{k+1} - 2u_k + u_{k-1}}{h^2} + pu_k = f_k := f(x_k), & k = \overline{1, N-1} \\ u_0 = a \\ \frac{u_N - u_{N-1}}{h} = b \end{cases} \quad x_k = kh, \quad h = \frac{1}{N-0.5}$$

Расс! но сетку проинтерполируем

Опр. сред-поп. проев.:

$$[u]_{Y_h} := \begin{pmatrix} u(0) \\ \vdots \\ u(1) \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{N+1}, \quad [f]_{F_h} := \begin{pmatrix} f(h) \\ \vdots \\ f(1-h) \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{N-1}, \quad \|g\|_h = \max_k |g_k| - \text{норма в } \text{sp-} \text{box } Y_h, F_h, \Phi_h$$

По По опр. По Th. Рим., сформулир.-ой в [г. 1.4], ок-тв = аппр. + уес-тв.

Иссу-ем аппр. на реш-ии:

$$\| [u]_{Y_h} - \varphi_h \|_{\Phi_h} = 0, \quad \| [f]_{F_h} - f_h \|_{F_h} = 0$$

$$\| L_h [u]_{Y_h} - f_h \|_{F_h} = \max_{k=\overline{1, N-1}} \left| -\frac{u(x_{k+1}) - 2u(x_k) + u(x_{k-1}))}{h^2} + pu(x_k) - f(x_k) \right| = O(h^2)$$

$u(x_k) + u''(x_k)h^2 + \frac{u^{(4)}(x_k)h^4}{24} + O(h^4)$

$$\| L_h [u]_{Y_h} - \varphi_h \|_{\Phi_h} = \max \left\{ |u(0) - a|, \left| \frac{u(1) - u(1-h)}{h} - b \right| \right\} = O(h) \rightarrow 0$$

$u(1) - u(1-h) = u'(1)h + O(h^2)$

Док-ем уес-тв по прав. раси:

Перенесем з. (#) в матр. биде: $Au = f$

$$\begin{pmatrix} \frac{2}{h^2} + p & -\frac{1}{h^2} & 0 & \dots & 0 \\ -\frac{1}{h^2} & \frac{2}{h^2} + p & -\frac{1}{h^2} & \dots & 0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & \dots & 0 & -\frac{1}{h^2} & \frac{2}{h^2} + p - \frac{1}{h^2} \\ 0 & \dots & 0 & -\frac{1}{h^2} & \frac{2}{h^2} + p \end{pmatrix} \begin{pmatrix} u_1 \\ \vdots \\ u_{N-2} \\ u_{N-1} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} f_1 + \frac{a}{h^2} \\ f_2 \\ \vdots \\ f_{N-2} \\ f_{N-1} + \frac{b}{h} \end{pmatrix}$$

A-симм-на \Rightarrow её соед. век. орт, а скал. произв. $(u, v) = \sum_{i=1}^{N-1} u_i v_i h$ орт. то

$$A \|u\|_{L_{2,h}} = \left(\sum_{i=1}^{N-1} u_i^2 h \right)^{\frac{1}{2}} - \text{норма в } L_{2,h}$$

$$Au = f \Rightarrow \|u\|_{L_{2,h}} \leq \|A^{-1}\|_{L_{2,h}} \|f\|_{L_{2,h}}$$

Пок-ем, что $\|A^{-1}\|_{L_{2,h}} \leq \text{const} \Rightarrow$ сх. уес-тв.

Опр. Разн. сх. $\begin{cases} L_h y_h = f_h \\ \ell_h y_h = \varphi_h \end{cases}$ наз. устойчивой, если (в смысле мин. задачи)

$$\exists \varepsilon_1, \varepsilon_2, \text{ т.о. } \forall y_h^{(i)}, f_h^{(i)}, \varphi_h^{(i)}, \text{ т.ч. } \begin{cases} L_h y_h^{(i)} = f_h^{(i)}, & i = 1, 2, \text{ т.ч.} \\ \ell_h y_h^{(i)} = \varphi_h^{(i)} \end{cases}$$

Задача 1.7 Исследовать методом анр. оценки уст-во разн. схем

$$\begin{cases} \frac{u_{i+1} - 2u_i + u_{i-1}}{h^2} + p_i u_i = f_i, & 1 \leq i \leq N-1, \quad p_i \geq 0 \\ u_0 = 0, u_N = u_{N-1}, & (N - \frac{1}{2})h = 1 \end{cases}$$

Реш-ие:

Рассм.

$$-\frac{1}{h^2} \sum_{k=1}^{N-1} (u_{k+1} - u_k - u_k + u_{k-1}) u_k + \sum_{k=1}^{N-1} p_k u_k^2 = \sum_{k=1}^{N-1} f_k u_k$$

$$\begin{aligned} & \sum_{k=1}^{N-1} (u_{k+1} - u_k) u_k - \sum_{k=1}^{N-1} (u_k - u_{k-1}) u_k \\ & \quad \text{т.к. } u_0 = 0 \quad \text{т.к. } u_N = u_{N-1} \\ & \sum_{k=1}^N (u_k - u_{k-1}) u_{k-1} - \sum_{k=1}^N (u_k - u_{k-1}) u_k \\ & = - \sum_{k=1}^N (u_k - u_{k-1})^2 \end{aligned}$$

$$\Rightarrow \frac{1}{h^2} \sum_{k=1}^N (u_k - u_{k-1})^2 + \sum_{k=1}^{N-1} p_k u_k^2 = \sum_{k=1}^{N-1} f_k u_k \quad (1)$$

$$\begin{aligned} u_k &= \sum_{i=1}^k (u_i - u_{i-1}) \Rightarrow u_k^2 \leq \sum_{i=1}^k (u_i - u_{i-1})^2 \cdot \sum_{i=1}^k 1^2 \leq N \sum_{i=1}^k (u_i - u_{i-1})^2 \\ \Rightarrow \sum_{k=1}^N u_k^2 &\leq N^2 \sum_{i=1}^N (u_i - u_{i-1})^2 = \frac{1}{h^2} \sum_{i=1}^N (u_i - u_{i-1})^2 \leq \sum_{k=1}^{N-1} f_k u_k \end{aligned} \quad (2)$$

(6)

зад.

$\Rightarrow \|u_h\|_{L_{2,h}}^2 \leq \|f_h\|_{L_{2,h}}^2$ (форма та же, что определялась в [з. 1.6])
 \Rightarrow имеем устойчивость по правой части в $L_{2,h}$. $\left(\sum_{i=1}^{n-1} u_i \sigma_i h \right)^2$