

Оценка погрешности интерполяционной функции

Прокшин Артем
Санкт-Петербургский государственный электротехнический
университет "ЛЭТИ"

1 разделённые разности

В ссылке [3] дается понятие разделённых разностей.

функция f задана на множестве попарно различных точек $x_0, \dots, x_n \in X$.

Тогда разделённой разностью нулевого порядка функции f в точке x_j называют значение $f(x_j)$, а разделённую разность порядка k для системы точек $(x_j, x_{j+1}, \dots, x_{j+k})$ определяют через разделённые разности порядка $(k-1)$ по формуле

$$f(x_j; x_{j+1}; \dots; x_{j+k-1}; x_{j+k}) = \frac{f(x_{j+1}; \dots; x_{j+k-1}; x_{j+k}) - f(x_j; x_{j+1}; \dots; x_{j+k-1})}{x_{j+k} - x_j}$$

в частности,

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

$$f(x_0; x_1; x_2) = \frac{f(x_1; x_2) - f(x_0; x_1)}{x_2 - x_0} = \frac{\frac{f(x_2) - f(x_1)}{x_2 - x_1} - \frac{f(x_1) - f(x_0)}{x_1 - x_0}}{x_2 - x_0},$$

$$f(x_0; x_1; \dots; x_{n-1}; x_n) = \frac{f(x_1; \dots; x_{n-1}; x_n) - f(x_0; x_1; \dots; x_{n-1})}{x_n - x_0}.$$

Для разделённой разности верна формула

$$f(x_0; x_1; \dots; x_n) = \sum_{j=0}^n \frac{f(x_j)}{\prod_{\substack{i=0 \\ i \neq j}}^n (x_j - x_i)},$$

в частности,

$$f(x_0; x_1) = \frac{f(x_1)}{x_1 - x_0} + \frac{f(x_0)}{x_0 - x_1},$$

$$f(x_0; x_1; x_2) = \frac{f(x_2)}{(x_2 - x_1)(x_2 - x_0)} + \frac{f(x_1)}{(x_1 - x_2)(x_1 - x_0)} + \frac{f(x_0)}{(x_0 - x_2)(x_0 - x_1)}.$$

2 интерполяционный полином Лагранжа

Лагранж, Жозеф Луи предложил для интерполяции использовать многочлен вида:

$$L(x) = \sum_{i=0}^n y_i l_i(x)$$

где базисные полиномы определяются по формуле:

$$l_i(x) = \prod_{j=0, j \neq i}^n \frac{x - x_j}{x_i - x_j} = \frac{x - x_0}{x_i - x_0} \dots \frac{x - x_{i-1}}{x_i - x_{i-1}} \cdot \frac{x - x_{i+1}}{x_i - x_{i+1}} \dots \frac{x - x_n}{x_i - x_n}$$

где $l_i(x)$ обладают следующими свойствами:

- являются многочленами степени n
- $l_i(x_i) = 1$
- $l_i(x_j) = 0$ при $j \neq i$

3 оценка погрешности при интерполяции полиномом Лагранжа

В работе [2] (стр.32) дается строгая оценка погрешности при интерполяции полиномом Лагранжа.

Погрешность удобно представить в следующем виде ¹ :

$$y(x) - \mathcal{P}_n(x) = \omega_n(x)r(x), \quad \omega_n(x) = \prod_{i=0}^n (x - x_i) \quad (1)$$

ибо эта погрешность заведомо равна нулю во всех узлах интерполяции. Введем вспомогательную функцию $q(\xi) = y(\xi) - \mathcal{P}_n(x) - \omega_n(x)r(x)$, где x играет роль параметра и принимает любое фиксированное значение. Очевидно, $q(\xi) = 0$ при $\xi = x_0, x_1, \dots, x_n$ и при $\xi = x$, т.е. обращается в нуль в $n + 2$ точках.

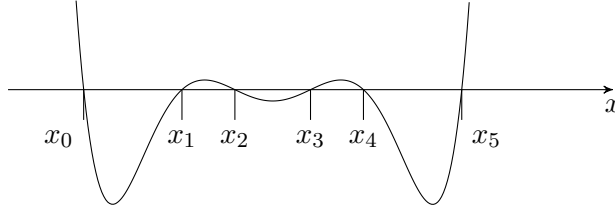
¹ $\mathcal{P}_n(x)$ – интерполяционный полином Лагранже

Предположим, что $y(x)$ имеет в $n+1$ непрерывную производную; тогда то же справедливо для $q(\xi)$. Между двумя нулями гладкой функции лежит нуль её производной. Последовательно применяя это правило, получим, что между крайними из $n+2$ нулей функции лежит $n+1$ нуль производной. Но $q^{(n+1)}(\xi) = y^{(n+1)}(\xi) - (n+1)!r(x)$,² и если в какой-то точке ξ^* , лежащей между указанными выше нулями, она обращается в нуль, то $r(x) = y^{(n+1)}(\xi^*)/(n+1)!$. Заменяя погрешность (1) максимально возможной, получаем оценку погрешности:

$$|y(x) - \mathcal{R}_n(x)| \leq \frac{M_{n+1}}{(n+1)!} |\omega_n(x)|, \quad M_{n+1} = \max |y^{(n+1)}(\xi)|$$

Обратим внимание, что x не обязательно должно лежать в интервале $[x_0, x_n]$, а может лежать и вне интервала.

Примерный график $\omega_n(x)$ при $n=5$



4 теорема о среднем(вариант)

Для непрерывных функций если $f(x) \in C[a, b]$ и величины α и β имеют одинаковые знаки, то

$$\alpha f(a) + \beta f(b) = (\alpha + \beta)f(\xi), \quad a \leq \xi \leq b$$

При $f(a) = f(b)$ это очевидно. Если $f(a) \neq f(b)$, то функция $\psi(x) = \alpha f(a) + \beta f(b) - (\alpha + \beta)f(x)$ принимает на концах отрезка $[a, b]$ значения разных знаков и, следовательно, существует точка $\xi \in [a, b]$, в которой $\psi(x) = 0$.

5 разложение по формуле Тейлора

Будем рассматривать класс $C_k[a, b]$ функций, имеющих на $[a, b]$ непрерывную производную k -го порядка. Такие функции разложимы по формуле Тейлора с остаточным членом в форме Лагранжа

$$f(x) = f(a) + \frac{f'(a)(x-a)}{1!} + \dots + \frac{f^{(k-1)}(a)(x-a)^{k-1}}{(k-1)!} + \frac{f^{(k)}(\xi)(x-a)^k}{k!}$$

где ξ — некоторая точка из промежутка $[a, x]$.

²выражение $y^{(n)}(x)$ означает n -ую производную функции $y(x)$

6 линейная аппроксимация

вопрос: для чего мы находили полином Лагранжа.

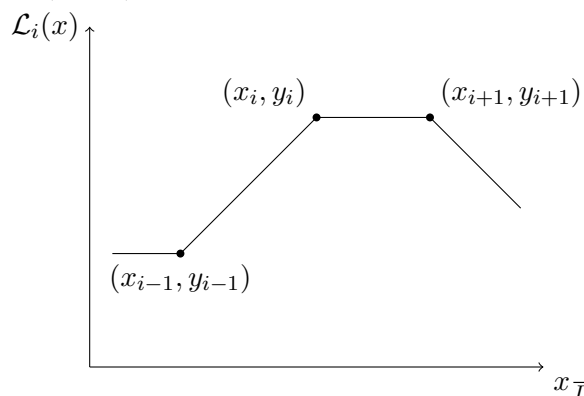
ответ: для оценки погрешности при интерполяции полиномом n -ой степени, где полином проходит через все точки (x_i, y_i) , $i \in 1, \dots, n + 1$. В случае сплайн-интерполяции интерполяция проводится полиномом третьей степени, и есть отличие: на каждом отрезке $[x_i, x_{i+1}]$ полином проходит только через две точки (x_i, y_i) и (x_{i+1}, y_{i+1})

Функция \mathcal{L} - кусочно-линейная функция, со значениями f_i в точках с координатами x_i , иначе эта функция называется *интерполяционный сплайн первой степени*

Интерполяционный сплайн определяется условиями

$$\mathcal{L}(x_i) = f_i, \quad i = 0, \dots, N \quad (2)$$

Геометрически он представляет собой ломанную, проходящую через точки (x_i, y_i) , где $y_i = f_i$



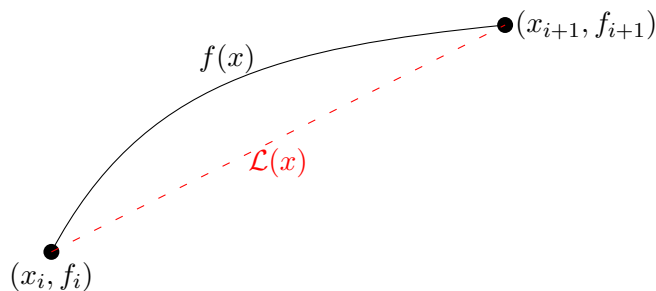
Если обозначить $h_i = x_{i+1} - x_i$, то при $x \in [x_i, x_{i+1}]$ уравнение сплайна первой степени будет иметь вид

$$\mathcal{L}(x) = f_i \frac{x_{i+1} - x}{h_i} + f_{i+1} \frac{x - x_i}{h_i} \quad (3)$$

или

$$\mathcal{L}(x) = f_i + \frac{x - x_i}{h_i} (f_{i+1} - f_i) \quad (4)$$

вернемся к предпоследнему рисунку на доске:



Получим оценку разности $\mathcal{R}(x) = |\mathcal{L}(x) - f(x)|$.
Взяв для \mathcal{L} представление при $x \in [x_i, x_{i+1}]$

$$\mathcal{L}(x) = (1-t)f_i + tf_{i+1}, \quad \text{где } t = (x - x_i)/h_i$$

$$\mathcal{R}(x) = \mathcal{L}(x) - f(x) = (1-t)f_i + tf_{i+1} - f(x) \quad (5)$$

Пусть $f(x) \in C[a, b]$ непрерывна.
применяя к выражению $(1-t)f_i + tf_{i+1}$ теорему о среднем, получаем

$$\mathcal{R}(x) = f(\xi) - f(x), \quad \xi \in [x_i, x_{i+1}].$$

Следовательно,

$$|\mathcal{R}(x)| \leq \omega(f),$$

где $\omega(f) = \max_{0 \leq i \leq N-1} \omega_i f$, и $\omega_i(f) = \max_{x', x'' \in [x_i, x_{i+1}]} |f(x') - f(x'')|$

Пусть $f(x)$ достаточно гладкая (производные нужных нам порядков непрерывны). По формуле Тейлора с остаточным членом в форме Лагранжа

$$f_i = f(x) - th_i f'(\xi), \quad f_{i+1} = f(x) + (1-t)h_i f'(\eta)$$

где $\xi, \eta \in [x_i, x_{i+1}]$ и $t = (x - x_i)/h_i$

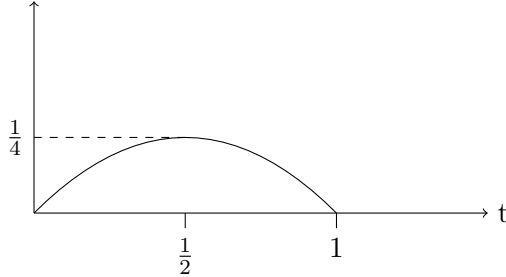
Подставив эти выражения в (5), получаем

$$\mathcal{R}(x) = t(1-t)h_i [f'(\eta) - f'(\xi)]$$

Следовательно,

$$|\mathcal{R}(x)| \leq t(1-t)h_i \omega_i(f') \leq \frac{1}{4} \bar{h} \omega(f')$$

последнюю оценку можно пояснить видом графика $t(1-t)$:



Наконец, если функция имеет вторую непрерывную производную на отрезке $[a, b]$. По формуле Тейлора

$$f_i = f(x) - th_i f'(x) + \frac{t^2 x_i^2}{f}''(\xi),$$

$$f_{i+1} = f(x) + (1-t)h_i f'(x) + \frac{(1-t)^2 x_i^2}{f} (\eta),$$

Из формулы (5) следует, что

$$\mathcal{R}(x) = (1-t) \frac{t^2 h_i^2}{2} f''(\xi) + t \frac{(1-t)^2 x_i^2}{f} (\eta)$$

по теореме о среднем

$$| \mathcal{R}(x) | \leq \frac{1}{2} h_i^2 t (1-t) | f''(\xi) | \leq \frac{1}{8} \bar{h}^2 | f''(\xi) |$$

7 Оценки погрешности интерполяции эрмитовыми кубическими сплайнами

В работе [1] приводятся оценки для функций разных классов. Если $S_3(x)$ эрмитов кубический сплайн интерполирует на сетке функцию $f(x)$ то имеют место оценки

$$| S_3^{(r)}(x) - f^{(r)}(x) | \leq \mathcal{R}_r, r = 0, 1, 2, 3$$

Если функция достаточно гладкая, то

$$| S_3^{(r)}(x) - f^{(r)}(x) | \leq \frac{1}{384} \bar{h}^4 | f^{IV}(x) |$$

$$\text{где, } \bar{h} = \left| x_{\text{точка, в которой вычисляется погрешность}} - x_{\text{ближайшее } i} \right|$$

Список литературы

- [1] Ю.С. Завьялов. *Методы сплайн-функций*. М.Наука, 1980.
- [2] Калиткин. *Численные методы*. М.,Мир, 1980.
- [3] *Разделённая разность*. 2015. URL: https://ru.wikipedia.org/wiki/%C3%90%C2%A0%C3%90%C2%B0%C3%90%C2%B7%C3%90%C2%B4%C3%90%C2%B5%C3%90%C2%BB%C3%91%C2%91%C3%90%C2%BD%C3%90%C2%BD%C3%90%C2%B0%C3%91%C2%8F_%C3%91%C2%80%C3%90%C2%B0%C3%90%C2%B7%C3%90%C2%BD%C3%90%C2%BE%C3%91%C2%81%C3%91%C2%82%C3%91%C2%8C.