



# Universidade Federal do Rio Grande do Norte DIMAP

# Cálculo Numérico U6 – Integração Numérica

Antonio Carlos Gay Thomé

# Cálculo Numérico

# Introdução

Na disciplina de Cálculo Diferencial e Integral é visto que se f(x) é uma função contínua em um intervalo [a, b], então ela tem uma primitiva F(x) neste intervalo. Ou seja:

$$\exists F(x) \Rightarrow F'(x) = f(x)$$

Assim, temos que:

$$\int_{a}^{b} f(x)dx = F(b) - F(a)$$

Achar F(x) dado um determinado f(x) nem sempre é fácil.

# Introdução

A *integração numérica* é aplicada quando a primitiva da função não é conhecida ou quando só conhecemos a função f(x) num conjunto discreto de pontos.

*O objetivo nesta unidade* é estudar esquemas numéricos que aproximem a integral definida de uma função f(x) num intervalo [a, b].

Curso de Cálculo Numérico - 2015

#### Cálculo Numérico

# Introdução

A ideia básica da integração numérica consiste na substituição da função f(x) por um polinômio que a aproxime razoavelmente bem no intervalo [a, b].

Desta forma, o problema se converte na integração dos termos do polinômio sobre os pontos do intervalo, o que é trivial de ser feito

$$\int_{a}^{b} f(x)dx \approx A_{0}f(x_{0}) + A_{1}f(x_{1}) + ... + A_{n}f(x_{n}), \quad x_{i} \in [a,b], i = 0,1,...,n$$

Esta abordagem é conhecida como Fórmulas de Côtes

#### Fórmulas de Newton Côtes

As fórmulas de Newton-Côtes são baseadas na estratégia de aproximar a função f(x) por um *polinômio interpolador* e, então, aproximar a integral pela integral do polinômio.

As aproximações são do tipo:

$$\int_{a}^{b} f(x)dx \approx A_{0} f(x_{0}) + A_{1} f(x_{1}) + \dots + A_{n} f(x_{n}) = \sum_{i=0}^{n} A_{i} f(x_{i})$$

onde os pontos são igualmente espaçados, isto é  $x_k = x_0 + kh$ , com h = (b - a)/n, e os coeficientes  $A_i$  são determinados pelo polinômio escolhido para aproximar a função f(x).

Existem fórmulas fechadas  $x \in [a, b]$  e abertas  $x \in (a, b)$ 

Curso de Cálculo Numérico - 2015

#### Cálculo Numérico

# Fórmulas de Newton Côtes Regra do Trapézio

A Regra do Trapézio é a fórmula de Newton-Côtes que aproxima a função f(x) pelo *polinômio interpolador de grau 1* sobre os pontos  $x_0 = a$  e  $x_1 = b$ .

O polinômio interpolador de grau um, na *forma de Newton* (*diferenças divididas*) é dado por:

$$p_1(x) = f(x_0) + f[x_0, x_1](x - x_0)$$

Desta forma vamos aproximar a integral da função f(x) pela integral do polinômio, obtendo:

$$\int_{a}^{b} f(x)dx \approx \int_{x_{0}}^{x_{1}} p_{1}(x)dx$$

# Fórmulas de Newton Côtes Regra do Trapézio

$$\int_{a}^{b} f(x)dx \approx \int_{x_{0}}^{x_{1}} p_{1}(x)dx$$

$$= \int_{x_{0}}^{x_{1}} f(x_{0}) + f[x_{0}, x_{1}](x - x_{0})dx$$

$$= f(x_{0})(x_{1} - x_{0}) + f[x_{0}, x_{1}] \left(\frac{x_{1}^{2}}{2} - \frac{x_{0}^{2}}{2} - x_{0}(x_{1} - x_{0})\right)$$

$$= f(x_{0})(x_{1} - x_{0}) + \frac{f(x_{1}) - f(x_{0})}{x_{1} - x_{0}} \times \frac{(x_{1} - x_{0})^{2}}{2}$$

$$= \frac{(x_{1} - x_{0})}{2} (f(x_{0}) + f(x_{1}))$$

$$= \frac{h}{2} (f(x_{0}) + f(x_{1})),$$

onde  $h = x_1 - x_0$ .

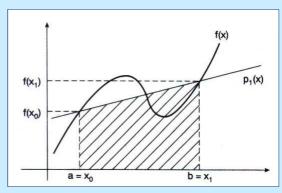
Curso de Cálculo Numérico - 2015

# Cálculo Numérico

# Fórmulas de Newton Côtes Regra do Trapézio

A fórmula:  $\frac{h}{2}(f(x_0) + f(x_1))$ 

representa a *área de um trapézio* que tem  $f(x_1)$  e  $f(x_0)$  como os valores das bases e h como o valor da altura.



# Fórmulas de Newton Côtes Regra do Trapézio

Se usarmos a *fórmula de Lagrange* ao invés da fórmula de Newton para interpolar, teremos:

$$\int_{a}^{b} f(x) dx = \int_{a=x_{0}}^{b=x_{1}} p_{1}(x) dx = \int_{x_{0}}^{x_{1}} \left[ \frac{(x-x_{1})}{-h} f(x_{0}) + \frac{(x-x_{0})}{h} f(x_{1}) \right] dx = I_{T}.$$

onde 
$$I_T = (h/2) * [f(x_0) + f(x_1)]$$
 onde  $I_T = (h/2) * [f(x_0) + f(x_1)]$  anterior!

Que representa a área de um trapézio de altura  $h = x_1 - x_0 e$ bases  $f(x_0)$  e  $f(x_1)$ .

Curso de Cálculo Numérico - 2015

# Cálculo Numérico

# Fórmulas de Newton Côtes Regra do Trapézio

#### Cálculo do Erro

Na unidade de interpolação foi visto que uma função f(x) pode ser representada por:

$$f(x) = p_n(x) + E_n(x)$$

onde  $p_n(x)$  é o polinômio interpolador e  $E_n(x)$  o erro na interpolação

Calculando a integral da função f(x) no intervalo [a, b] temos:

$$\int_{a}^{b} f(x)dx = \int_{a}^{b} p_{n}(x)dx + \int_{a}^{b} E_{n}(x)dx.$$

Fórmulas de Newton Côtes Regra do Trapézio

#### Cálculo do Erro

No caso da Regra do Trapézio, o erro é dado por:

$$E_T = \int_a^b E_1(x)dx = \int_{x_0}^{x_1} (x - x_0)(x - x_1) \frac{f''(\xi)}{2} dx = -\frac{h^3}{12} f''(\xi), \quad \xi \in [a, b]$$

Como o erro depende do ponto  $\xi$ , que é desconhecido, usa-se na prática a estimativa onde:

$$|E_T| \le \frac{h^3}{12} \max_{\xi \in [a,b]} |f''(\xi)|$$

Curso de Cálculo Numérico - 2015

Cálculo Numérico

Fórmulas de Newton Côtes Regra do Trapézio

# **Exemplo:**

Integrar a função  $f(x) = e^{-x^2}$  (cuja primitiva é uma função Gaussiana) usando a *Regra do Trapézio* no intervalo [0, 1].

$$\int_{0}^{1} e^{-x^{2}} dx \approx I_{T} = \frac{h}{2} (f(x_{0}) + f(x_{1})) =$$

$$= \frac{1}{2} (e^{-0} + e^{-1^{2}}) = 0.6839$$

**Para estimar o erro** cometido temos que limitar a segunda derivada da função no intervalo [0, 1].

# Fórmulas de Newton Côtes Regra do Trapézio

**Exemplo:** 

$$|E_T| \le \frac{h^3}{12} \max_{\xi \in [a,b]} |f''(\xi)|$$

$$f''(e^{-x^2}) = f'(-2xe^{-x^2}) = -(2e^{-x^2} - 4x^2e^{-x^2}) = (4x^2 - 2)e^{-x^2}$$

nos extremos do intervalo vale |f''(0)| = 2 e |f''(1)| = 0.735759

Para calcular os pontos críticos da f"(x), devemos derivar f''(x) e igualar a zero

$$f'''(x) = (12x - 8x^3)e^{-x^2} = 0 \Leftrightarrow x = 0 \text{ ou } x = \pm\sqrt{\frac{3}{2}}$$

Curso de Cálculo Numérico - 2015

# Cálculo Numérico

Fórmulas de Newton Côtes Regra do Trapézio

**Exemplo:** 

$$|E_T| \le \frac{h^3}{12} \max_{\xi \in [a,b]} |f''(\xi)|$$

Como o único ponto crítico pertencente ao intervalo é x = 0

$$\max_{\xi \in [a,b]} |f''(\xi)| = 2$$

E assim: 
$$E_T \le \frac{h^3}{12} \max_{\xi \in [a,b]} |f''(\xi)| = \frac{1}{6} = 0.166667$$

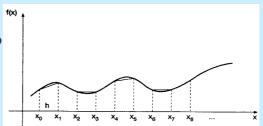
Note que a estimativa do erro informa que a aproximação obtida não garante a primeira casa decimal como exata, pois a solução exata da integral está entre os valores 0.6839397±0.166667.

# Fórmulas de Newton Côtes Regra do Trapézio Repetida

A Regra do Trapézio aproxima bem funções suaves onde (|f'(x)| << 1) e/ou em intervalos de integração de *amplitude pequena*.

Para intervalos grandes pode-se fazer uma subdivisão do intervalo [a, b] em n subintervalos de mesma amplitude e

aplicar a Regra do Trapézio em cada subintervalo



Curso de Cálculo Numérico - 2015

# Cálculo Numérico

# Fórmulas de Newton Côtes Regra do Trapézio Repetida

Assim, com a regra do trapézio repetida temos que:

$$h = \frac{b-a}{n}$$
 e  $x_k = x_0 + kh$  com  $k = 0, 1, ..., n$ 

Aplicando a Regra do Trapézio em cada subintervalo  $[x_k, x_{k+1}]$ :

$$\int_{a}^{b} f(x)dx \approx \frac{h}{2}(f_{0} + f_{1}) + \frac{h}{2}(f_{1} + f_{2}) + \frac{h}{2}(f_{2} + f_{3}) + \dots + \frac{h}{2}(f_{n-2} + f_{n-1}) + \frac{h}{2}(f_{n-1} + f_{n})$$

$$= \frac{h}{2}[f_{0} + 2(f_{1} + f_{2} + \dots + f_{n-1}) + f_{n}]$$

E o erro cometido é igual a soma dos erros de cada subintervalo:

$$|E_{TG}| \le n \frac{h^3}{12} \max_{\xi \in [a,b]} |f''(\xi)|$$

# Fórmulas de Newton Côtes Regra do Trapézio Repetida

# **Exemplo:**

Considerando a função do exemplo anterior  $f(x) = e^{-x^2}$  em [0, 1]

Determinar o **número de subintervalos** necessários para que a Regra do Trapézio Repetida forneça uma aproximação com **pelo menos 3 casas decimais exatas**.

$$|E_{TG}| \le 10^{-4}$$
  $\rightarrow$   $n\frac{h^3}{12} \max_{\xi \in [0,1]} |f''(\xi)| \le 10^{-4}$ 

onde 
$$h = (b - a)/n$$

Curso de Cálculo Numérico - 2015

# Cálculo Numérico

# Fórmulas de Newton Côtes Regra do Trapézio Repetida

**Exemplo:** 

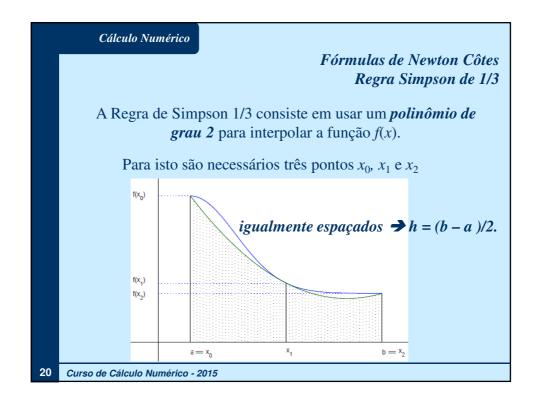
$$n\frac{h^3}{12} \max_{\xi \in [0,1]} |f''(\xi)| \le 10^{-4}$$

com h = 1/n e max f"(x) = 2, temos:

$$n \frac{h^3}{12} \max_{\xi \in [0,1]} |f''(\xi)| \le 10^{-4} \iff n \frac{1}{n^3} \frac{1}{12} \ 2 \le 10^{-4}$$
$$\Leftrightarrow \frac{1}{n^2} \le 6 \times 10^{-4}$$
$$\Leftrightarrow n^2 \ge 1666.666$$
$$\Leftrightarrow n \ge 40.824$$

Ou seja, precisamos de, no mínimo, n = 41 subintervalos para atingir a precisão desejada.

```
Cálculo Numérico
                                          Fórmulas de Newton Côtes
                                          Regra do Trapézio Repetida
   Exemplo:
    Usando a função trapz.m do MatLab, com 41 subintervalos
                    obtemos a seguinte resposta:
 % Exemplo do uso da função trapz(x,y)
 % Calcula a integral usando a regra do trapézio
 \% x = [x_0, x_1, ..., x_n]
 % f = [f_0, f_1, ..., f_n]
                               It = 0.746787657
 h=1/41;
 x=0:h:1;
 f=exp(-x.^2);
                                         Resultado anterior: 0.6839
 It=trapz(x, f);
Curso de Cálculo Numérico - 2015
```



# Fórmulas de Newton Côtes Regra Simpson de 1/3

Para obter a aproximação da integral através de um polinômio interpolador *na forma de Newton* temos:

$$p_2(x) = f(x_0) + (x - x_0)f[x_0, x_1] + (x - x_0)(x - x_1)f[x_0, x_1, x_2].$$

Assim, a integral da função f(x) será aproximada por:

$$\int_{a}^{b} f(x)dx \approx \int_{x_{0}}^{x_{2}} p_{2}(x)dx$$

$$= \frac{h}{3}(f(x_{0}) + 4f(x_{1}) + f(x_{2}))$$

Curso de Cálculo Numérico - 2015

Cálculo Numérico

# Fórmulas de Newton Côtes Regra Simpson de 1/3

De forma análoga a Regra do Trapézio, obtemos a fórmula do erro, integrando o erro cometido na interpolação.

$$E_S = \int_a^b E_2(x)dx = \int_a^b (x - x_0)(x - x_1)(x - x_2) \frac{f'''(\xi)}{3!} dx = -\frac{h^5}{90} f^{(iv)}(\xi), \quad \xi \in [a, b]$$

Na prática a estimativa para o erro é dada por:

$$|E_S| \le \frac{h^5}{90} \max_{\xi \in [a,b]} |f^{(iv)}(\xi)|$$

Fórmulas de Newton Côtes Regra Simpson de 1/3

It = 0.746787657

**Exemplo:** 

Resultado anterior: 0.6839

*Seja a função do exemplo anterior f* (x) =  $e^{-x^2}$ *no intervalo* [0, 1].

Para usar a Regra de Simpson temos que ter três pontos.

$$h = \frac{b-a}{2} = \frac{1-0}{2} = \frac{1}{2}$$

E a aproximação é dada por:

Trapézio Simples: 0.6839
Repetido: 0.74678

$$\int_{a}^{b} f(x)dx \approx \frac{1}{6}(f(0) + 4f(1/2) + f(1)) = 0.74718$$

Curso de Cálculo Numérico - 2015

Cálculo Numérico

Fórmulas de Newton Côtes Regra Simpson de 1/3

**Exemplo:** 

A limitação do erro da aproximação fica em:

$$|E_S| \le \frac{h^5}{90} \max_{\xi \in [a,b]} |f^{(iv)}(\xi)|$$

$$f^{(iv)}(x) = f^{(iv)}(e^{-x^2}) = (12 - 48x^2 + 16x^4)e^{-x^2}$$

Calculando a 4ª derivada nos extremos do intervalo e nos pontos críticos temos:

# Fórmulas de Newton Côtes Regra Simpson de 1/3

# **Exemplo:**

Nos pontos extremos:

$$|f^{(iv)}(0)| = 12 \quad e \quad |f^{(iv)}(1)| = 0.735759$$

Nos pontos críticos da 4ª derivada:

$$f^{(v)}(x) = (-32x^5 + 160x^3 - 120x)e^{-x^2} = 0$$

$$\Rightarrow \begin{cases} x = 0 \text{ ou} \\ x = \pm 0.958572 \text{ ou} \\ x = \pm 2.02018 \end{cases}$$

Como somente o 0 e 0.958572 pertencem [0, 1], temos:

$$|f^{(iv)}(0.958572)| = 7.41948$$
 e 
$$\max_{\xi \in [a,b]} |f^{(iv)}(\xi)| = 12$$

5 Curso de Cálculo Numérico - 2015

# Cálculo Numérico

# Fórmulas de Newton Côtes Regra Simpson de 1/3

# **Exemplo:**

Finalmente:

$$E_S = \le \frac{h^5}{90} \max_{\xi \in [a,b]} |f^{(iv)}(\xi)| = 0.00416667$$

Conclusão: Garante-se que valor da integral aproximada

$$\int_{a}^{b} f(x)dx \approx \frac{1}{6}(f(0) + 4f(1/2) + f(1)) = 0.74718$$

No intervalo [0, 1] **está correto** com uma **precisão de duas casas decimais**.

# Fórmulas de Newton Côtes Regra Simpson Repetida

Da mesma forma que na Regra do Trapézio, a Regra de Simpson pode fornecer resultados mais precisos sendo aplicada repetidas vezes.

A Regra de Simpson necessita de três pontos, logo a regra se aplica a cada dois subintervalos da forma  $[x_s, x_{s+2}]$ , o que implica que *n* deve ser um número par.

$$h = \frac{b-a}{n} \ \text{e} \ x_s = x_0 + sh, \ \text{para} \ s = 0, 1, \dots, n$$

Curso de Cálculo Numérico - 2015

# Cálculo Numérico

# Fórmulas de Newton Côtes Regra Simpson Repetida

Aplicando a Regra de Simpson em cada subintervalo  $[x_s, x_{s+2}]$ 

$$\int_{a}^{b} f(x)dx \approx \frac{h}{3}(f_0 + 4f_1 + f_2) + \frac{h}{3}(f_2 + 4f_3 + f_4) + \cdots$$

$$\cdots + \frac{h}{3}(f_{n-4} + 4f_{n-3} + f_{n-2}) + \frac{h}{3}(f_{n-2} + 4f_{n-1} + f_n)$$

$$= \frac{h}{3} [f_0 + 4(f_1 + f_3 + \dots + f_{n-1}) + 2(f_2 + f_4 + \dots + f_{n-2}) + f_n]$$
*impares pares*

E o erro é a soma dos erros em cada um dos n/2 subintervalos  $[x_s, x_{s+2}]$ ,  $|E_{SR}| \le n \frac{h^5}{180} \max_{\xi \in [a,b]} |f^{(iv)}(\xi)|$ .

$$|E_{SR}| \le n \frac{h^5}{180} \max_{\xi \in [a,b]} |f^{(iv)}(\xi)|.$$

# Fórmulas de Newton Côtes Regra Simpson Repetida

#### **Exemplo:**

Usando a mesma função  $f(x) = e^{-x^2}$ , no intervalo [0, 1], determinar o número de subintervalos necessários para obter uma aproximação com três casas decimais exatas.

# Para isto assume-se:

$$|E_{SR}| \le 10^{-4}$$

#### tem-se que:

$$h = (b-a)/n$$
  $\max_{\xi \in [0,1]} |f^{(iv)}(\xi)| = 12$ 

O menor valor de **n** que garante a precisão é **n** = **6**. Note que a Regra de Simpson necessita de bem menos subintervalos que a Regra do Trapézio (**n** = **41**).

Curso de Cálculo Numérico - 2015

#### Cálculo Numérico

# Fórmulas de Newton Côtes Observações

- 1. As fórmulas de Newton-Côtes são obtidas aproximando a função por um polinômio interpolador.
- 2. Na interpolação polinomial, quanto maior o grau do polinômio, maiores são os erros nos extremos.
- 3. Logo, deve-se evitar usar polinômios de grau muito alto para aproximar as funções.
- 4. Assim, a melhor estratégia é usar as fórmulas repetidas, que permitem obter aproximação com uma precisão desejada, e polinômios de baixo grau.

# Fórmulas de Newton Côtes Segunda Regra de Simpson

A função a ser integrada é aproximada por um polinômio interpolador de *grau 3*.

São necessários, portanto, 4 pontos para interpolação.

$$p_3(x) = f(x_0) + (x - x_0)f[x_0, x_1] + (x - x_0)(x - x_1)f[x_0, x_1, x_2] + (x - x_0)(x - x_1)(x - x_2)f[x_0, x_1, x_2, x_3]$$

$$\int_{a}^{b} f(x)dx \approx \int_{x_{0}}^{x_{3}} p_{3}(x)dx$$

$$= \frac{3h}{8} (f(x_{0}) + 3f(x_{1}) + 3f(x_{2}) + f(x_{3}))$$

Curso de Cálculo Numérico - 2015

# Cálculo Numérico

# Fórmulas de Newton Côtes Segunda Regra de Simpson

De forma análoga, obtemos a fórmula do erro integrando o erro cometido na interpolação.

$$E_{s_2} = \int_a^b E_3(x) dx = \int_{x_0}^{x_3} (x - x_0)(x - x_1)(x - x_2)(x - x_3) \frac{f^{iv}(\xi)}{4!} dx$$
$$= -\frac{3h^5}{80} f^{iv}(\xi) \quad \xi \in [x_0, x_3]$$

Na prática a estimativa para o erro é dada por:

$$|E_{s_2}| \le \frac{3h^5}{80} \max_{x \in [x_0, x_3]} |f^{iv}(x)|$$

# Fórmulas de Newton Côtes Segunda Regra de Simpson Repetida

$$\int_{a}^{b} f(x)dx \approx \int_{x_{0}}^{x_{3}} p_{3}(x)dx + \int_{x_{3}}^{x_{6}} p_{3}(x)dx + \dots + \int_{x_{k-3}}^{x_{k}} p_{3}(x)dx \quad (x_{0} = a, x_{k} = b)$$

$$= \frac{3h}{8} (f(x_{0}) + 3f(x_{1}) + 3f(x_{2}) + f(x_{3})) + \dots$$

$$\frac{3h}{8} (f(x_{3}) + 3f(x_{4}) + 3f(x_{5}) + f(x_{6})) + \dots$$

E o erro é a soma dos erros em cada um dos n/3 subintervalos  $[x_s, x_{s+3}]$ , ficando limitado em:

$$\left| E_{s_2} \right| \le \frac{nh^5}{80} \max_{x \in [x_0, x_3]} f^{iv}(x)$$

Curso de Cálculo Numérico - 2015

# Cálculo Numérico

# Fórmulas de Newton Côtes Para Integração Dupla

Seja a integral dupla tabelada nos intervalos  $[x_0,x_m]$  e  $[y_0,y_n]$ 

$$I = \int_{x_0}^{x_m} \int_{y_0}^{y_n} f(x, y) dy dx$$

$$I = \int_{x_0}^{x_m} \int_{y_0}^{y_n} f(x, y) dy$$

$$G(x) = \int_{y_0}^{y_0} f(x, y) dy$$

Curso de Cálculo Numérico - 2015

34

Fórmulas de Newton Côtes
Para Integração Dupla
$$I = \int_{x_0}^{x_m} G(x) dx$$

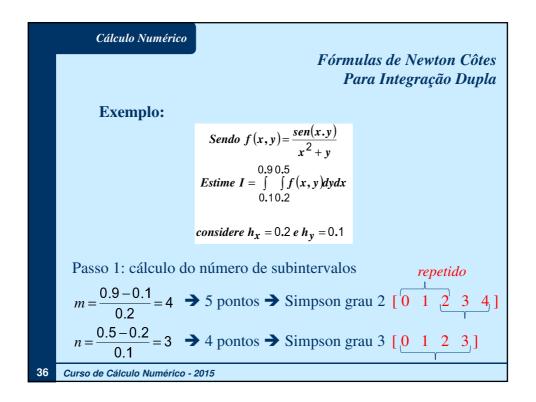
$$I = c_x \sum_{i=0}^m a_i G(x_i)$$

$$G(x) = \int_{y_0}^{y_n} f(x, y) dy$$

$$G(x_i) = c_y \sum_{j=0}^n b_j f(x_i, y_j)$$

Finalmente temos:

$$I = c_x \cdot c_y \sum_{j=0}^{n} \sum_{i=0}^{m} a_i b_j f(x_i, y_j)$$



	Cálculo Numérico $I = c_x . c_y \sum_{j=0}^{n} \sum_{i=0}^{m} a_i$	Fórmulas de Newton Côtes Para Integração Dupla ai x bj $f(x_i, y_j)$							
				j	0	1	2	3	
	Exemplo: Construção da Tabela			y(j)	0.2	0.3	0.4	0.5	
		i	x(i)	ai \ bj	1	\ 3	3	1	
		0	0.1	1	<sup>1</sup> (1)	(3)	(3)	(1)	
					0.0952	0.0968	0.0975	0.0980	
		1	0.3	4	(4)	(12)	(12)	(4)	
					0.2068	0.2305	0.2443	0.2533	
	$m = \frac{0.9 - 0.1}{0.2} = 4$ $n = \frac{0.5 - 0.2}{0.1} = 3$	2	0.5	2	(2)	(6)	(6)	(2)	
					0.2219	0.2717	0.3056	0.3299	
		3		4	(4)	(12)	(12)	(4)	
					0.2022	0.2639	0.3105	0.3464	
	0.1			1	(1)	(3)	(3)	(1)	
		4	0.9		0.1773	0.2403	0.2911	0.3322	
		Soma: 24.0722							
37	37 Curso de Cálculo Numérico - 2015								

#