

Интегрирование с использованием формул Гаусса (квадратуры Гаусса - Лежандра)

До настоящего времени мы рассматривали формулы для численного интегрирования только на равномерных сетках. Это сильно упрощает формулы, но и порождает существенный недостаток этих методов — за счет того, что точки выбираются эквидистантно, происходит быстрое накопление погрешностей аппроксимации. Бороться с этим можно, конечно, уменьшая шаг сетки и, таким образом, увеличивая время расчета интеграла. Это не существенно, если мы вычисляем простые интегралы, однако может стать принципиальным препятствием при вычислении многомерных интегралов. В этом случае возможно также существенно снизить вычислительные затраты, не уменьшая при этом точности расчетов. Делается это при помощи т.н. квадратур высокой точности, к которым относится и квадратура Гаусса–Лежандра.

В *квадратурах Гаусса–Лежандра* изначально рассматривается задача вычисления интеграла на отрезке $[-1, 1]$:

$$I = \int_{-1}^1 f(x) dx \approx I_G = \sum_{i=0}^{n-1} w_i f(x_i), \quad (2.7)$$

где w_i — веса с которыми берутся значения функции в точках x_i . Положения точек и веса функций вычисляются точно для квадратур любого порядка [7]. На практике, однако, редко используются квадратуры выше 10-го порядка. В табл. 2.4 приведены значения аргумента и соответствующие веса для нескольких первых квадратур.

Как перейти от квадратуры (2.7) для интервала интегрирования $[-1, 1]$ к вычислению интеграла в произвольном интервале? Ответ прост — надо ввести замену переменных

$$\xi = \frac{1}{2}(b + a) + \frac{1}{2}(b - a)x,$$

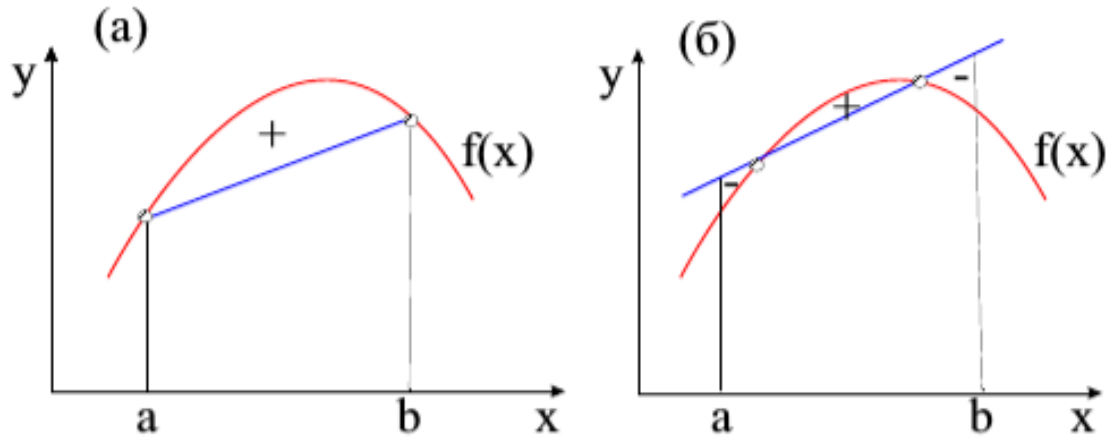


Рис. 2.2: Аппроксимация подынтегральной функции $f(x)$ с помощью (а) кусочно-линейной функции на равномерной сетке (метод трапеций) и (б) полиномиальной интерполирующей функции на неравномерной сетке (метод квадратур). Знаками “+” и “–” отмечены погрешности аппроксимации. Видно, что в методе квадратур погрешности могут быть скомпенсированы за счет выбора оптимальных узлов.

при которой

$$\int_a^b f(\xi) d\xi = \left(\frac{b-a}{2} \right) \int_{-1}^1 f(\xi(x)) dx.$$

Окончательно получаем *квадратуру Гаусса-Лежандра* для произвольного интервала интегрирования:

$$I = \int_a^b f(\xi) d\xi \approx I_G = \left(\frac{b-a}{2} \right) \sum_{i=0}^{n-1} w_i f(\xi_i), \quad (2.8)$$

где

$$\xi_i = \left(\frac{b+a}{2} \right) + \left(\frac{b-a}{2} \right) x_i.$$

Квадратуры Гаусса-Лежандра требуют минимум вычислений для достижения заданной точности интегрирования.

Пример. Вычислим интеграл

$$I = \int_0^\pi 4x^3 dx = x^4 \Big|_0^\pi = \pi^4 = 97,409091.$$

Используя 2-х точечную квадратуру Гаусса-Лежандра, мы получим численный ответ

$$I \approx I_G = \frac{(\pi-0)}{2} \left[4 \left(\frac{\pi+0}{2} - \frac{\pi-0}{2\sqrt{3}} \right)^3 + 4 \left(\frac{\pi+0}{2} + \frac{\pi-0}{2\sqrt{3}} \right)^3 \right] = 97,409091.$$

Результат получается таким же, как и аналитический ответ, с точностью 6 значащих цифр всего за два вычисления функции! (Это не всегда так, к сожалению, см. упражнения к разделу) \square

Таблица 2.2: Весовые коэффициенты и значения аргумента.

Число точек n в квадратуре	Весовые коэффициенты	Значения аргумента	Погрешность аппроксимации
2	$w_0 = 1,000000000$	$x_0 = -0,577350269$	$\sim f^{(4)}(x)$
	$w_1 = 1,000000000$	$x_1 = +0,577350269$	
3	$w_0 = 0,555555556$	$x_0 = -0,774596669$	$\sim f^{(6)}(x)$
	$w_1 = 0,888888889$	$x_1 = +0,000000000$	
	$w_2 = 0,555555556$	$x_2 = +0,774596669$	
4	$w_0 = 0,347854845$	$x_0 = -0,861136312$	$\sim f^{(8)}(x)$
	$w_1 = 0,652145155$	$x_1 = -0,339981044$	
	$w_2 = 0,652145155$	$x_2 = +0,339981044$	
	$w_3 = 0,347854845$	$x_3 = +0,861136312$	
5	$w_0 = 0,236926885$	$x_0 = -0,906179846$	$\sim f^{(10)}(x)$
	$w_1 = 0,478628670$	$x_1 = -0,538469310$	
	$w_2 = 0,568888889$	$x_2 = +0,000000000$	
	$w_3 = 0,478628670$	$x_3 = +0,538469310$	
	$w_4 = 0,236926885$	$x_4 = +0,906179846$	
6	$w_0 = 0,171324492$	$x_0 = -0,932469514$	$\sim f^{(12)}(x)$
	$w_1 = 0,360761573$	$x_1 = -0,661209386$	
	$w_2 = 0,467913935$	$x_2 = -0,238619186$	
	$w_3 = 0,467913935$	$x_3 = +0,238619186$	
	$w_4 = 0,360761573$	$x_4 = +0,661209386$	
	$w_5 = 0,171324492$	$x_5 = +0,932469514$	