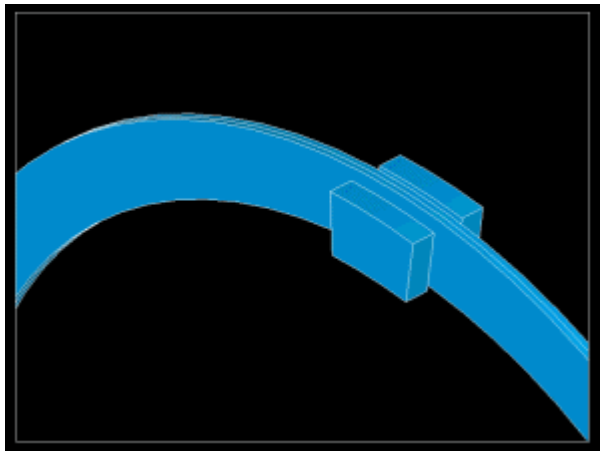
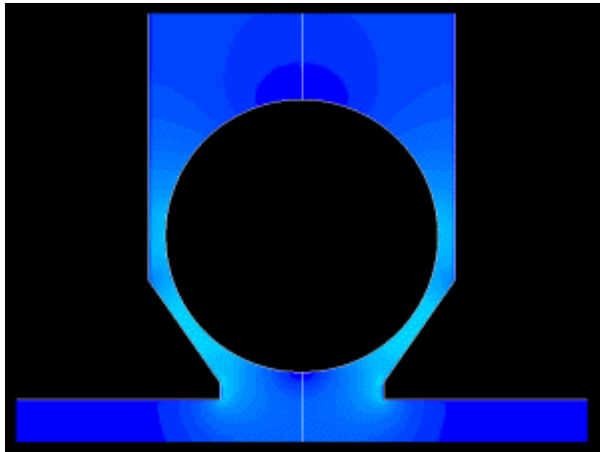


数值解析

2019年度前期 第7週 [2019年5月30日]



静岡大学

工学研究科機械工学専攻

計測情報講座

創造科学技術大学院

情報科学専攻

三浦 憲二郎



講義アウトライン [5月30日]

- 数値積分
 - ニュートン・コーツ公式
 - 台形公式
 - シンプソン公式
 - 重積分

数値積分の必要性 p.135

•初等関数（しょとうかんすう）とは、複素数を変数とする多項式関数・指数関数・対数関数主値の四則演算・合成によって表示できる関数である。三角関数や双曲線関数、そして両者の逆関数主値も初等関数と考えられる。

•微分

•初等関数の導関数は必ず初等関数になる

•積分

•初等関数の積分は初等関数であらわされるとは限らない

例 フレネル積分

$$f(t) = \int_0^t \cos \frac{\pi t^2}{2} dt$$

$$g(t) = \int_0^t \sin \frac{\pi t^2}{2} dt$$

数値的に積分する以外方法がない！

ニュートン・コーツ公式 p.135

•定積分 $I = \int_a^b f(x)dx$

を求めるために、分点 $a=x_0 < x_1 < x_2 < \dots < x_n=b$ をとり、 $f_k=f(x_k)$ を通るラグランジュ補間多項式 $P_n(x)$ を考える。ただし、それぞれの分点は等間隔 $h=(b-a)/n$ で並んでいるとする。 $P_n(x)$ は多項式なので以下の I_n を計算することができる。

$$I_n = \int_a^b P_n(x)dx$$

$$P_n = \sum_{k=0}^n f_k l_k(x)$$

$$\int_a^b f(x)dx \approx \int_a^b P_n(x)dx = \sum_{k=0}^n f_k \int_a^b l_k(x)dx = \sum_{k=0}^n \alpha_k f_k$$

$$\text{where } \alpha_k = \int_a^b l_k(x)dx$$

この近似積分公式を $n+1$ 点のニュートン・コーツ公式(Newton-Cotes)と呼ぶ。

台形公式 p.135

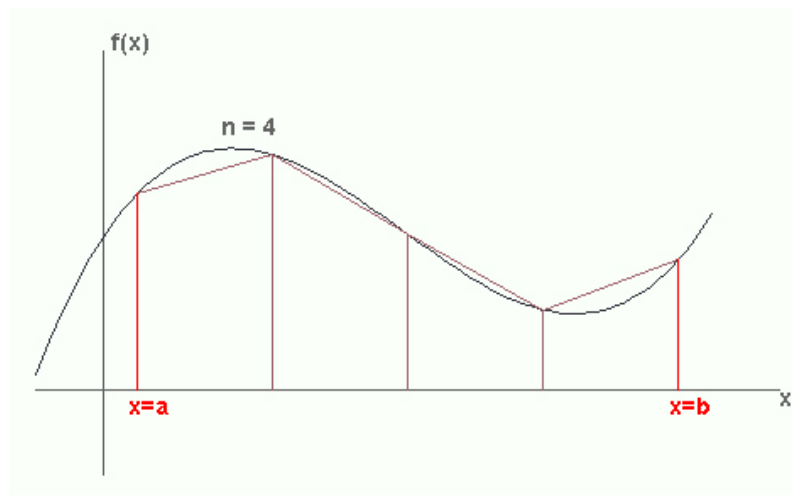
•ニュートン・コーツ公式 $n=1$ とする. $h=b-a$, $x_0=a$, $x_1=b$, $x=a+sh$

$$\alpha_0 = \int_a^b l_0(x) dx = \int_a^b \frac{x - x_1}{x_0 - x_1} dx = -\frac{1}{h} \int_0^1 h(s-1) h ds = \frac{h}{2}$$

$$\alpha_1 = \int_a^b l_1(x) dx = \int_a^b \frac{x - x_0}{x_1 - x_0} dx = \frac{1}{h} \int_0^1 sh \cdot h ds = \frac{h}{2}$$

Hence
$$\int_a^b f(x) dx \approx \frac{h}{2}(f_0 + f_1)$$

これを台形公式(Trapezoidal rule)という.

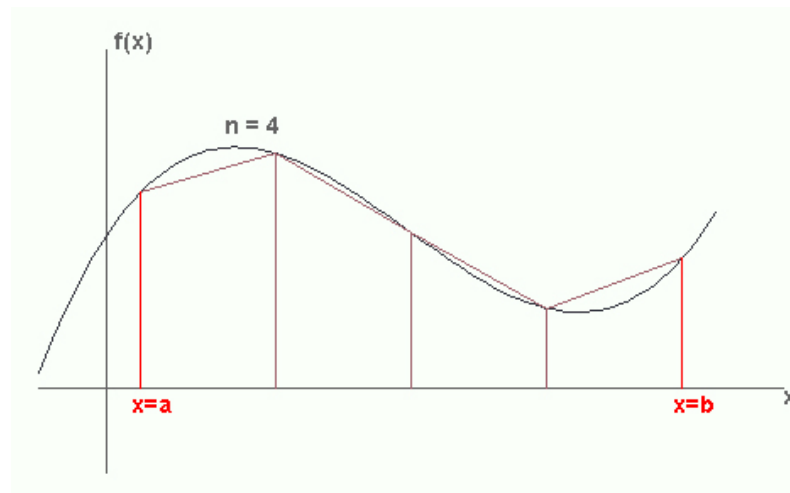


台形公式 p.136

•実際の計算 区間 $[a,b]$ を n 等分. その分点 x_k , 各小区間 $[x_k, x_{k+1}]$ に適用

$$\begin{aligned}\int_a^b f(x)dx &= \sum_{k=0}^{n-1} \int_{x_k}^{x_{k+1}} f(x)dx \approx \sum_{k=0}^{n-1} \frac{h}{2}(f_k + f_{k+1}) \\ &= \frac{h}{2}\{f_0 + f_n + 2(f_1 + f_2 + \cdots + f_{n-1})\}, \quad h = \frac{b-a}{n}\end{aligned}$$

これを複合台形公式, あるいは台形公式という.



台形公式: プログラム p.137

```
#include <stdio.h>

/* 関数の定義 */
double func1(double x);
double func2(double x);
/* 台形公式 */
double trapezoidal( double a, double b, int n, double (*f)(double) );

int main(void)
{
    int n=100;

    printf("2.0/(x*x)を[1,2]で積分します。分割数は%dです\n", n);
    printf("結果は%20.15fです\n",trapezoidal(1.0, 2.0, n, func1) );

    printf("4.0/(1+x*x)を[0,1]で積分します。分割数は%dです\n", n);
    printf("結果は%20.15fです\n",trapezoidal(0.0, 1.0, n, func2) );

    return 0;
}

/* 台形公式 */
double trapezoidal( double a, double b, int n, double (*f)(double) )
{
    double T, h;
    int i;

    h = ( b - a ) / n ; /* 刻み幅の指定 */

    /* 台形公式 */
    T = ( (*f)(a) + (*f)(b) ) / 2.0;
    for ( i = 1; i < n; i++ ) T += (*f)( a + i*h );
    T *= h;

    return T;
}
```

```
/* 関数の定義 */
double func1(double x)
{
    return( 2.0/(x*x) );
}

double func2(double x)
{
    return( 4.0 / (1.0+x*x) );
}
```

実行結果

2.0/(x*x)を[1,2]で積分します。分割数は100です

結果は 1.000029166020881

4.0/(1+x*x)を[0,1]で積分します。分割数は100です。

結果は 3.141575986923129

シンプソン公式 p.139

•ニュートン・コーツ公式 $n=2$ とする.

$$h=(b-a)/2, x_0=a, x_1=a+h, x_2=a+2h=b$$

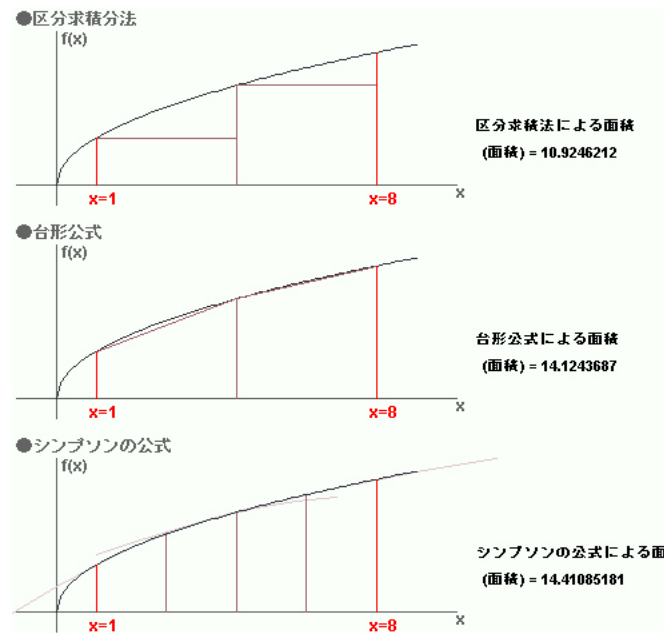
$$\alpha_0 = \frac{1}{(x_0 - x_1)(x_0 - x_2)} \int_a^b (x - x_1)(x - x_2) dx = \frac{1}{2h^2} \int_0^2 (s - 1)(s - 2) h^3 ds = \frac{h}{3}$$

$$\alpha_1 = \frac{1}{(x_1 - x_0)(x_1 - x_2)} \int_a^b (x - x_0)(x - x_2) dx = \frac{4}{3}h$$

$$\alpha_2 = \frac{1}{(x_2 - x_0)(x_2 - x_1)} \int_a^b (x - x_0)(x - x_1) dx = \frac{h}{3}$$

Hence
$$\int_a^b f(x) dx \approx \frac{h}{3}(f_0 + 4f_1 + f_2)$$

これをシンプソン公式(Simpson's rule)
という.

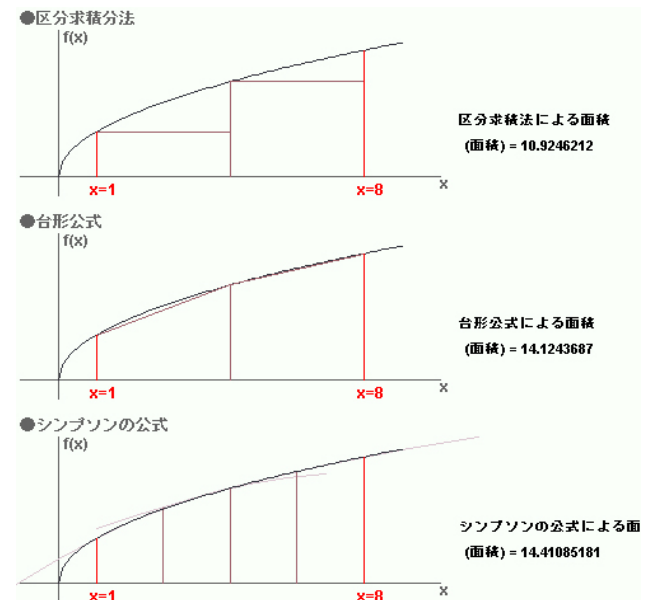


シンプソン公式 p.140

•実際の計算 区間[a,b]を 2n 等分. その分点 x_k , 各小区間 $[x_{2k}, x_{2k+2}]$ に適用

$$\begin{aligned}\int_a^b f(x)dx &= \sum_{k=0}^{n-1} \int_{x_{2k}}^{x_{2k+2}} f(x)dx \approx \sum_{k=0}^{n-1} \frac{h}{3}(f_{2k} + 4f_{2k+1} + f_{2k+2}) \\ &= \frac{h}{3}\{f_0 + f_{2n} + 4(f_1 + f_3 + \cdots + f_{2n-1}) \\ &\quad + 2(f_2 + f_4 + \cdots + f_{2n-2})\}, h = \frac{b-a}{n}\end{aligned}$$

これを複合シンプソン公式,
あるいはシンプソン公式という.



シンプソン公式: プログラム p.140

```
#include <stdio.h>

/* 関数の定義 */
double func1(double x);
double func2(double x);
/* シンプソン公式 */
double simpson( double a, double b, int n, double (*f)(double) );

int main(void)
{
    int n=50;
    printf("2.0/(x*x)を[1,2]で積分します。分割数は%dです\n", 2*n);
    printf("結果は%20.15fです\n",simpson(1.0, 2.0, n, func1) );

    printf("4.0/(1+x*x)を[0,1]で積分します。分割数は%dです\n", 2*n);
    printf("結果は%20.15fです\n",simpson(0.0, 1.0, n, func2) );

    return 0;
}

/* シンプソン公式 */
double simpson( double a, double b, int n, double (*f)(double) )
{
    double S, h;
    int i;

    h = ( b - a ) / ( 2.0*n ) ; /* 刻み幅の指定 */

    /* シンプソン公式 */
    S = ( (*f)(a) + (*f)(b) ) ;
    for ( i = 1; i < n; i++ ) {
        S += 4.0*(*f)( a + (2.0*i-1.0)*h ) + 2.0*(*f)( a + 2.0*i*h );
    }
    S += 4.0*(*f)( a + (2.0*n-1.0)*h );
    S *= h/3.0;

    return S;
}
```

```
/* 関数の定義 */
double func1(double x)
{
    return( 2.0/(x*x) );
}

double func2(double x)
{
    return( 4.0 / (1.0+x*x) );
}
```

実行結果

2.0/(x*x)を[1,2]で積分します。分割数は100です

結果は 1.000000002582389

4.0/(1+x*x)を[0,1]で積分します。分割数は100です。

結果は 3.141592653589754

重積分 p.144

•重積分

$$I = \int_a^b \left\{ \int_{\phi(x)}^{\psi(x)} f(x, y) dy \right\} dx$$

$$F(x) = \int_{\phi(x)}^{\psi(x)} f(x, y) dy$$

$$I = \int_a^b F(x) dx$$

•台形公式

$$I \approx T_n = \frac{h}{2} \{F_0 + F_n + 2(F_1 + F_2 + \cdots + F_{n-1})\}, \quad h = \frac{b-a}{n}$$

•シンプソン公式

$$I \approx S_{2n} = \frac{h}{3} \{F_0 + F_{2n} + 4(F_1 + F_3 + \cdots + F_{2n-1}) + 2(F_2 + F_4 + \cdots + F_{2n-2})\}, \quad h = \frac{b-a}{2n}$$

$$F(x_i) = \int_{\phi(x_i)}^{\psi(x_i)} f(x_i, y) dy$$

重積分 p.144

•台形公式 $[\phi(x_i), \Psi(x_i)]$, $\phi(x_i)=y_0 < y_1 < \dots < y_m = \Psi(x_i)$ と m 等分, $k=(y_m - y_0)/m$

$$F(x_i) = \frac{k}{2} \{g_0 + g_n + 2(g_1 + g_2 + \dots + g_{n-1})\}, \quad g_i = f(x_i, y_j)$$

•シンプソン公式

$[\phi(x_i), \Psi(x_i)]$, $\phi(x_i)=y_0 < y_1 < \dots < y_{2m} = \Psi(x_i)$ と $2m$ 等分, $k=(y_{2m} - y_0)/2m$

$$F(x_i) = \frac{k}{3} \{g_0 + g_{2m} + 4(g_1 + g_3 + \dots + g_{2m-1}) + 2(g_2 + g_4 + \dots + g_{2m-2})\}, \quad k = \frac{y_{2m} - y_0}{2m}$$

重積分: プログラム p.145

```
#include <stdio.h>
#include <stdlib.h>

/* 被積分関数の定義 */
double func(double x, double y);

/* yの積分区間 */
double phi(double x);
double psi(double x);

/* ベクトル領域の確保 */
double *dvector(int i, int j);
/* ベクトル領域の解放 */
void free_dvector(double *a, int i);

/* 重積分用の台形公式 */
double trapezoidal2( double a, double b, int m, int n, double (*p)(double),
                    double (*q)(double), double (*f)(double,double) );

int main(void){
    int n=20, m=20;
    printf("8x^2+4y を x=[1,2], y=[2-x,x^2] で積分します ¥n");
    printf("xの分割数は%d, yの分割数%d, 結果は%15.10f¥n", m, n,
          trapezoidal2( 1.0, 2.0, m, n, phi, psi, func ) );
    return 0;
}

/* 重積分用の台形公式 */
double trapezoidal2( double a, double b, int m, int n, double (*p)(double),
                    double (*q)(double), double (*f)(double,double) )
{
    double T, h, k, *F, x, y1, y2;
    int i, j;

    F = dvector( 0, n );
    h = ( b - a ) / n ;    /* 刻み幅の指定(x方向) */

    /* F_i の計算 */
    for ( i = 0; i <= n; i++ ) {
        x = a + i*h;
        y1 = (*p)(x); y2 = (*q)(x);
        k = ( y2 - y1 )/m;    /* 刻み幅の指定(y方向) */
        F[i] = ( (*f)(x, y1) + (*f)(x, y2) ) / 2.0;
        for ( j = 1; j < m; j++ ) F[i] += (*f)(x, y1+j*k);
        F[i] *= k;
    }
    /* 積分の計算 */
    T = ( F[0] + F[n] ) / 2.0;
    for ( i = 1; i < n; i++ ) T += F[i];
    T *= h;
    free_dvector( F, 0 );
    return T;
}

/* 被積分関数の定義 */
double func(double x, double y) {
    return( 8.0*x*x + 4.0*y );
}

/* yの積分区間 */
double phi(double x) {
    return( 2.0-x );
}
double psi(double x){
    return( x*x );
}

double *dvector(int i, int j) /* a[i]~a[i+j]の領域を確保 */ {
    double *a;
    if ( (a=(double *)malloc( ((j-i+1)*sizeof(double)))) == NULL ) {
        printf("メモリが確保できません(from dvector)¥n");
        exit(1);
    }
    return(a-i);
}

void free_dvector(double *a, int i)
{
    free( (void *) (a + i) ); /* (void *)型へのキャストが必要 */
}-
```



まとめ

- 数値積分
 - ニュートン・コーツ公式
 - 台形公式
 - シンプソン公式
 - 重積分