

# **Einführung in die Numerik WS2018/19**

Dozent: Prof. Dr. Andreas Fischer

5. November 2018

# Inhaltsverzeichnis

<b>I</b>	<b>Interpolation</b>	<b>2</b>
1	Grundlagen . . . . .	2
2	Interpolation durch Polynome . . . . .	4
2.1	Existenz und Eindeutigkeit . . . . .	4
2.2	NEWTON-Form des Interpolationspolynoms . . . . .	5
2.3	Interpolationsfehler . . . . .	6
3	Interpolation durch Polynomsplines . . . . .	9
3.1	Polynomsplines . . . . .	9
3.2	Interpolation durch kubische Polynomsplines . . . . .	9
3.3	Interpolation mit kubischen $C^2$ -Splines . . . . .	10
3.4	Eine Minimaleigenschaft kubischer $C^2$ -Interpolationssplines . . . . .	13
3.5	Interpolationsfehler bei kubischer $C^2$ -Interpolation . . . . .	14
<b>II</b>	<b>numerische Integration (Quadratur)</b>	<b>15</b>
1	Integration von Interpolationspolynomen . . . . .	15
2	NEWTON-COTES-Formeln . . . . .	16
3	spezielle NEWTON-COTES-Formeln . . . . .	17
4	Zusammengesetzte NEWTON-COTES-Formeln . . . . .	20
5	GAUSS'sche Quadraturformeln . . . . .	21
<b>III</b>	<b>direkte Verfahren für lineare Gleichungssysteme</b>	<b>23</b>
1	GAUSS'scher Algorithmus für quadratische Systeme . . . . .	23
2	Lineare Quadratmittelprobleme . . . . .	24
3	Kondition linearer Gleichungssysteme . . . . .	25
<b>IV</b>	<b>Kondition von Aufgaben und Stabilität von Algorithmen</b>	<b>26</b>
1	Maschinenzahlen und Rundungsfehler . . . . .	26
2	Fehleranalyse . . . . .	27
<b>V</b>	<b>Newton-Verfahren zur Lösung nichtlinearer Gleichungssysteme</b>	<b>28</b>
1	Das NEWTON-Verfahren . . . . .	28
2	Gedämpftes NEWTON-Verfahren . . . . .	29
<b>VI</b>	<b>lineare Optimierung</b>	<b>30</b>
1	Ecken und ihre Charakterisierung . . . . .	30
2	Simplex-Verfahren . . . . .	31
3	Die Tableauform des Simplex-Verfahrens . . . . .	32
4	Revidiertes Simplex-Verfahren . . . . .	33
5	Bestimmung einer ersten zulässigen Basislösung . . . . .	34

<b>Anhang</b>	<b>36</b>
<b>A Listen</b>	<b>36</b>
A.1 Liste der Theoreme . . . . .	36
A.2 Liste der benannten Sätze, Lemmata und Folgerungen . . . . .	37
<b>Index</b>	<b>38</b>

# *Vorwort*

## Kapitel I

# Interpolation

## 1. Grundlagen

### Aufgabe:

Gegeben sind  $n + 1$  Datenpaare  $(x_0, f_0), \dots, (x_n, f_n)$ , alles reelle Zahlen und paarweise verschieden.

Gesucht ist eine Funktion  $F : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ , die die Interpolationsbedingungen

$$F(x_0) = f_0, \dots, F(x_n) = f_n \quad (1)$$

genügt.

### Definition (Stützstellen, Stützwerte)

Die  $x_0$  bis  $x_n$  werden Stützstellen genannt.

Die  $f_0$  bis  $f_n$  werden Stützwerte genannt.

Die oben gestellte Aufgabe wird zum Beispiel durch

$$F(x) = \begin{cases} 0 & x \notin \{x_0, \dots, x_n\} \\ f_i & x = x_i \end{cases}$$

gelöst. Weitere Möglichkeiten sind: Polygonzug, Treppenfunktion, Polynom, ...

- In welcher Menge von Funktionen soll  $F$  liegen?
- Gibt es im gewählten Funktionsraum für beliebige Datenpaare eine Funktion  $F$ , die den Interpolationsbedingungen genügt (eine solche Funktion heißt Interpolierende)?
- Ist die Interpolierende in diesem Raum eindeutig bestimmt?
- Welche weiteren Eigenschaften besitzt die Interpolierende, zum Beispiel hinsichtlich ihrer Krümmung oder der Approximation einer Funktion  $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$  mit  $f_k = f(x_k)$  für  $k = 0, \dots, n$ ?
- Wie sollte man die Stützstellen wählen, falls nicht vorgegeben?
- Wie lässt sich die Interpolierende effizient bestimmen, gegebenenfalls auch unter der Berücksichtigung, dass neue Datenpaare hinzukommen oder dass sich nur die Stützwerte ändern?

### ■ Beispiel 1.1

---

$k$	0	1	2	3	4	5
$x_k$ in s	0	1	2	3	4	5
$f_k$ in °C	80	85,8	86,4	93,6	98,3	99,1

Interpolation im

- Raum der stetigen stückweise affinen Funktionen
- Raum der Polynome höchstens 5. Grades
- Raum der Polynome höchstens 4. Grades (Interpolation im Allgemeinen nicht lösbar, Regression nötig)

## 2. Interpolation durch Polynome

$\Pi_n$  bezeichne den Vektorraum der Polynome von Höchstgrad  $n$  mit der üblichen Addition und Skalarmultiplikation. Für jedes  $p \in \Pi_n$  gibt es  $a_0, \dots, a_n \in \mathbb{R}$ , sodass

$$p(x) = a_n x^n + a_{n-1} x^{n-1} + \dots + a_1 x + a_0 \quad (1)$$

und umgekehrt.

### 2.1. Existenz und Eindeutigkeit

#### Satz 2.1

Zu  $n+1$  Datenpaaren  $(x_0, f_0), \dots, (x_n, f_n)$  mit paarweise verschiedenen Stützstellen existiert genau ein Polynom  $p \in \Pi_n$ , dass die Interpolationsbedingung Gleichung (1) erfüllt.

*Beweis.* • Existenz: Sei  $j \in \{0, \dots, n\}$  und  $L_j : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$  mit

$$L_j(x) := \prod_{\substack{i=0 \\ i \neq j}}^n \frac{x - x_i}{x_j - x_i} = \frac{(x - x_0) \cdots (x - x_{j-1})(x - x_{j+1}) \cdots (x - x_n)}{(x_j - x_0) \cdots (x_j - x_{j-1})(x_j - x_{j+1}) \cdots (x_j - x_n)}$$

das LAGRANGE-Basispolynom vom Grad  $n$ . Offenbar gilt  $L_j \in \Pi_n$  und

$$L_j(x_k) = \begin{cases} 1 & k = j \\ 0 & k \neq j \end{cases} = \delta_{jk} \quad (2)$$

Definiert man  $p : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$  durch

$$p(x) := \sum_{j=0}^n f_j \cdot L_j(x) \quad (3)$$

so ist  $p \in \Pi_n$  und außerdem erfüllt  $p$  wegen Gleichung (2) die Interpolationsbedingung Gleichung (1)

- Eindeutigkeit: Angenommen es gibt Interpolierende  $p, \tilde{p} \in \Pi_n$  mit  $p \neq \tilde{p}$ . Dann folgt  $p - \tilde{p} \in \Pi_n$  und  $(p - \tilde{p})(x_k) = p(x_k) - \tilde{p}(x_k) = 0$  für  $k = 0, \dots, n$ . Also hat  $(p - \tilde{p})$  mindestens  $n + 1$  Nullstellen, hat aber Grad  $n$ . Das heißt, dass  $(p - \tilde{p})$  das Nullpolynom sein muss.  $\square$

#### Definition (Interpolationspolynom)

Das Polynom, dass die Interpolationsbedingung erfüllt, heißt Interpolationspolynom zu  $(x_0, f_0), \dots, (x_n, f_n)$ .

#### ► Bemerkung 2.2

- Die Darstellung Gleichung (3) heißt LAGRANGE-Form des Interpolationspolynoms.
- Um mittels Gleichung (3) einen Funktionswert  $p(x)$  zu berechnen, werden  $\mathcal{O}(n^2)$  Operationen benötigt; bei gleichabständigen Stützstellen kann man diesen Aufwand auf  $\mathcal{O}(n)$  verringern. Ändern sich die Stützwerte, kann man durch Wiederverwendung von den  $L_j(x)$  das  $p(x)$  in  $\mathcal{O}(n)$  Operationen berechnen.
- Man kann zeigen, dass  $L_0$  bis  $L_n$  eine Basis von  $\Pi_n$  bilden.

## 2.2. Newton-Form des Interpolationspolynoms

$$p(x) = c_0 + c_1(x - x_0) + c_2(x - x_0)(x - x_1) + \cdots + c_n(x - x_0) \cdots (x - x_{n-1}) \quad (4)$$

mit Koeffizienten  $c_0, \dots, c_n \in \mathbb{R}$ . Die Berechnung des Koeffizienten  $c_j$  kann rekursiv durch Ausnutzen der Interpolationsbedingung Gleichung (1) erfolgen. Für  $c_0$  erhält man

$$f_0 \stackrel{!}{=} p(x_0) = c_0$$

Seien  $c_0$  bis  $c_{j-1}$  bereits ermittelt. Dann folgt:

$$f_j \stackrel{!}{=} p(x_j) = c_0 + \underbrace{\sum_{k=1}^{j-1} c_k(x_j - x_0) \cdots (x_j - x_{k-1})}_{\text{bekannt}} + c_j \underbrace{(x_j - x_0) \cdots (x_j - x_{j-1})}_{\text{bekannt}}$$

### ► Bemerkung 2.3

- Der Aufwand um die Koeffizienten  $c_0, \dots, c_n$  zu ermitteln ist  $\mathcal{O}(n^2)$ . Kommt ein Datenpaar hinzu, kann man Gleichung (4) um einen Summanden erweitern und mit  $\mathcal{O}(n)$  Operationen  $c_{n+1}$  bestimmen.
- Sind die Koeffizienten  $c_0, \dots, c_n$  in Gleichung (4) bekannt, dann benötigt man zur Berechnung von  $p(x)$   $\mathcal{O}(n)$  Operationen.
- Die Polynome  $N_0, \dots, N_n : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$  mit

$$N_0 = 1 \quad \text{und} \quad N_j = (x - x_0) \cdots (x - x_{j-1})$$

heißen NEWTON-Basispolynome und bilden eine Basis von  $\Pi_n$ .

Die Koeffizienten  $c_0, \dots, c_n$  ergeben sich wegen Gleichung (1) auch als Lösung des folgenden linearen Gleichungssystems:

$$\begin{pmatrix} 1 & & & & \\ 1 & (x_1 - x_0) & & & \\ 1 & (x_2 - x_0) & (x_2 - x_0)(x_2 - x_1) & & \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \\ 1 & (x_n - x_0) & (x_n - x_0)(x_n - x_1) & \cdots & \prod_{i=0}^{n-1} (x_n - x_i) \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} c_0 \\ c_1 \\ c_2 \\ \vdots \\ c_n \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} f_0 \\ f_1 \\ f_2 \\ \vdots \\ f_n \end{pmatrix}$$

Die Systemmatrix dieses linearen Gleichungssystems ist eine reguläre untere Dreiecksmatrix.

Zu effizienten Berechnung eines Funktionswertes  $p(x)$  nach Gleichung (4) mit gegebenen Koeffizienten



$c_0, \dots, c_n$  kann man das HORNER-Schema anwenden. Überlegung für  $n = 3$ .

$$\begin{aligned} p(x) &= c_0 + c_1(x - x_0) + c_2(x - x_0)(x - x_1) + c_3(x - x_0)(x - x_1)(x - x_2) \\ &= c_0 + (x - x_0) \left[ c_1 + (x - x_1) [c_2 + (x - x_2)c_3] \right] \end{aligned}$$

Für beliebiges  $n$  liefert das den folgenden Algorithmus:

■ **Algorithmus 2.4 (Horner-Schema für Newton-Form)**

Input:  $n, x, c_0, \dots, c_n, x_0, \dots, x_n$

```

1  p = c_n
2  do j = n-1, 0, -1
3    p = c_j + (x - x_j) p
4  end do

```

### 2.3. Interpolationsfehler

**Definition (Maximum-Norm)**

Die Norm

$$\|g\|_\infty := \max_{x \in [a, b]} |g(x)| \quad \text{für } g \in C[a, b]$$

definiert die Maximum-Norm in  $C[a, b]$ .

**Satz 2.5**

Sei  $f \in C[a, b]$ . Dann existiert zu jedem  $\varepsilon > 0$  ein Polynom  $p_\varepsilon$  mit  $\|f - p_\varepsilon\| \leq \varepsilon$ .

Also liegt die Menge aller Polynome (beliebig hohen Grades) direkt in  $C[a, b]$ .

**Definition 2.6 (Stützstellensystem)**

Stützstellensystem :  $a \leq x_0^{(n)} < \dots < x_n^{(n)} \leq b$ . Weiterhin bezeichne  $p_n \in \Pi_n$  das zu den Datenpaaren  $(x_k^{(n)}, f(x_k^{(n)}))$  gehörende eindeutig bestimmte Interpolationspolynom.

**Satz 2.7 (Satz von Faber 1914)**

Zu jedem Stützstellensystem gibt es  $f \in C[a, b]$ , sodass  $(p_n)$  nicht gleichmäßig gegen  $f$  konvergiert.  $\|p_n - f\|_\infty \rightarrow 0$  bedeutet, dass  $(p_n)$  gleichmäßig gegen  $f$  konvergiert.

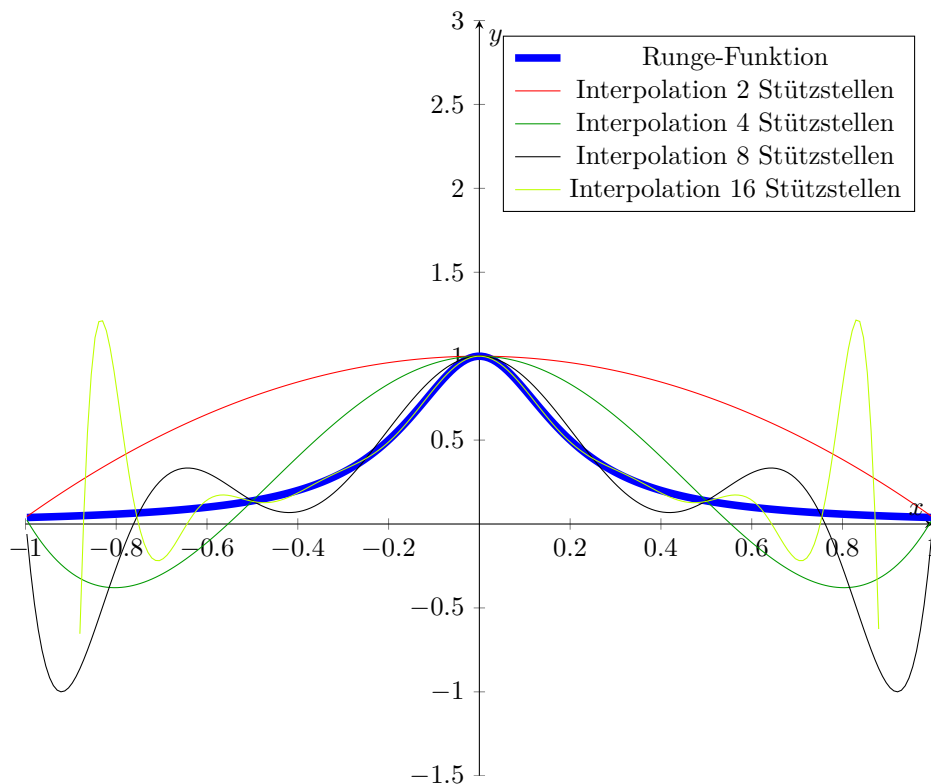
Nach einem Resultat von ERDÖS/VERTESI (1980) gilt sogar, dass  $(p_n(x))$  fast überall divergiert.

■ **Beispiel 2.8 (Runge)**

$$f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}, f(x) = \frac{1}{1+25x^2}$$

äquidistante Stützstellen  $x_0, \dots, x_n, p \in \Pi_n$  als Interpolationspolynom

Stützstellen	interpoliertes Polynom
2	$1 - \frac{25x^2}{26}$
4	$3,31565x^4 - 4,27719x^2 + 1$
8	$53,6893x^8 - 102,815x^6 + 61,3672x^4 - 13,203x^2 + 1$
16	$15403,1x^{16} - 49713,5x^{14} + 63743,8x^{12} - 41870x^{10} + 15206x^8 - 3100,35x^6 + 351,984x^4 - 22,7759x^2 + 1$



### Anmerkung

Wer mit Mathematica selber diese Polynome berechnen will, muss folgende Befehle benutzen:

- Funktion definieren: `f[x_]:=1/(1+25x^2)`
- Interpolationspolynome ausrechnen: `Expand[InterpolatingPolynomial[Table[{i,f[i]},{i,-1,-1,Schrittweite}],{x}]]`
- plotten: `Plot[f[x],InterpolatingPolynomial[Table[{i,f[i]},{i,-1,-1,Schrittweite}],{x}],{x,-1,1}]`

**Satz 2.9**

Sei  $f \in C^{n+1}[a, b]$  und gelte  $a \leq x_0 < \dots < x_n \leq b$ . Mit  $p_n \in \Pi_n$  werde das zu den Datenpaaren  $(x_0, f(x_0)), \dots, (x_n, f(x_n))$  gehörende Interpolationspolynom bezeichnet. Dann existiert zu jedem  $x \in [a, b]$  eine Zahl  $\xi \in (a, b)$ , so dass

$$f(x) - p_n(x) = \frac{f^{(n+1)}(\xi(x))}{(n+1)!} w(x) \quad \text{für alle } x \in [a, b]$$

wobei  $w(x) = (x - x_0) \cdot \dots \cdot (x - x_n)$

*Beweis.* Für  $x = x_k$  mit  $k = 0, \dots, n$  ist nicht zu zeigen, da  $p_n$  die Interpolationsbedingung erfüllt. Sei nun  $x \in [a, b]$  fest gewählt mit  $x \notin \{x_0, \dots, x_n\}$ . Weiter seien

$$K = \frac{f(x) - p_n(x)}{w(x)} \quad \text{und} \quad F : \begin{cases} [a, b] \rightarrow \mathbb{R} \\ t \mapsto f(t) - p_n(t) - Kw(t) \end{cases}$$

Man stellt unter Beachtung der Interpolationsbedingung fest, dass  $F(x_0) = F(x_1) = \dots = F(x_n) = 0$  und  $F(x) = 0$ . Also besitzt  $F$  mindestens  $n + 2$  paarweise verschiedene Nullstellen in  $[a, b]$ . Da  $F \in C^{n+1}[a, b]$  erhält man durch  $n + 1$ -fache Anwendung des Satzes von Rolle, dass  $F^{(n+1)}$  mindestens eine Nullstelle  $\xi(x)$  in  $(a, b)$  besitzt. Also folgt

$$0 = F^{(n+1)}(\xi(x)) = f^{(n+1)}(\xi(x)) - \underbrace{p_n^{(n+1)}(\xi(x))}_{=0} - \underbrace{K w^{(n+1)}(\xi(x))}_{\text{Konstante}}$$

Da  $w^{(n+1)} = (n + 1)!$ , erhält man

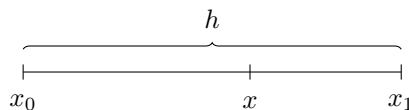
$$K = \frac{f^{(n+1)}(\xi(x))}{(n+1)!}$$

Da  $x \in [a, b]$  beliebig gewählt war, ist die Behauptung bewiesen. □

■ **Beispiel 2.10**

Sei  $f \in C^2[a, b]$  mit  $\|f\|_\infty \leq M$ . Weiter sei  $a = x_0 < x_1 = x_0 + h = b$ . Mit Satz 2.9 folgt:

$$\begin{aligned} |f(x) - p_2(x)| &= \left| \frac{f''(\xi(x))}{2} (x - x_0)(x - x_1) \right| \\ &\leq \frac{1}{2} M \cdot \lambda(x) h \cdot (1 - \lambda(x)) h \\ &\leq \frac{1}{2} M \cdot h^2 \underbrace{\lambda(x)(1 - \lambda(x))}_{\leq 1/4} \\ &\leq \frac{1}{8} M \cdot h^2 \end{aligned}$$



$$\Rightarrow x = x_0 + \lambda \cdot (x_1 - x_0) = \lambda x_1 + (1 - \lambda)x_0$$

### 3. Interpolation durch Polynomsplines

#### 3.1. Polynomsplines

Zur Abkürzung bezeichne  $\Delta$  eine Zerlegung des Intervall  $[a, b]$  durch die Stützstellen  $a =: x_0 < \dots < x_n := b$ .

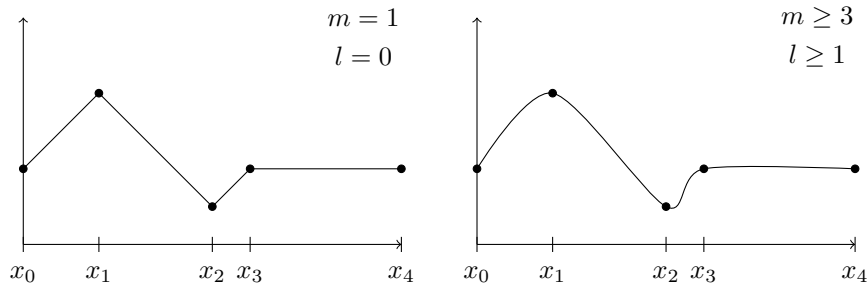
**Definition 3.1 (Polynomspline)**

Ein Polynomspline vom Grad  $m \in \mathbb{N}$  und Glattheit  $l \in \mathbb{N}$  zur Zerlegung  $\Delta$  ist eine Funktion  $s \in C^l[a, b]$  mit

$$s_k := s|_{[x_k, x_{k+1}]} \in \Pi_m \quad \text{für } k = 0, \dots, n-1$$

Dabei bezeichnet  $s|_{[x_k, x_{k+1}]}$  die Einschränkung von  $s$  auf das Intervall  $[x_k, x_{k+1}]$ . Die Menge aller Splines wird mit  $\mathcal{S}_m^l(\Delta)$  bezeichnet.

Folglich ist ein Polynomspline  $s \in \mathcal{S}_m^l(\Delta)$  auf jedem der Teilintervall  $[x_k, x_{k+1}]$  ein Polynom vom Höchstgrad  $m$ . Außerdem ist  $s \in \mathcal{S}_m^l(\Delta)$  in allen Punkten  $x \in [a, b]$  (also auch in den Stützstellen)  $l$ -mal stetig differenzierbar.  $\mathcal{S}_m^l(\Delta)$  ist mit der üblichen Addition und Multiplikation ein Vektorraum. Speziell ist  $\mathcal{S}_1^0(\Delta)$  die Menge aller stetigen stückweise affin linearen Funktionen.



#### 3.2. Interpolation durch kubische Polynomsplines

Gegeben sei eine Zerlegung  $\Delta$  und die Stützwerte  $f_0, \dots, f_n$ . Gesucht ist eine Funktion  $s \in \mathcal{S}_3^l(\Delta)$  mit  $l = 1, 2$  derart, dass

$$s(x_k) = f_k \quad \text{für } k = 0, \dots, n \tag{1}$$

Jede derartige Funktion heißt kubischer Interpolationspline.

**Konstruktion eines solchen Splines:**

$$\begin{aligned} h_k &:= x_{k+1} - x_k \quad \text{für } k = 0, \dots, n-1 \\ m_k &:= s'(x_k) \quad \text{für } k = 0, \dots, n-1 \end{aligned}$$

Wegen  $l \in \{1, 2\}$  ist  $s$  zunächst stetig differenzierbar. Wegen  $s_k = s|_{[x_k, x_{k+1}]}$  für  $k = 0, \dots, n-1$  und  $m = 3$  kann man folgenden Ansatz für  $s_k$  benutzen:

$$s_k(x) = a_k(x - x_k)^3 + b_k(x - x_k)^2 + c_k(x - x_k) + d_k \tag{2}$$

Aus den Interpolationsbedingungen Gleichung (1) und der stetigen Differenzierbarkeit aller Funktionen in  $s \in \mathcal{S}_m^l(\Delta)$  für  $l \geq 1$  ergeben sich folgende Forderungen an  $s_k$ ,  $k = 0, \dots, n-1$ :

$$\begin{aligned} s_k(x_k) &= f_k & \text{und} & & s_k(x_{k+1}) &= f_{k+1} \\ s'_k(x_k) &= m_k & \text{und} & & s'_k(x_{k+1}) &= m_{k+1} \end{aligned} \quad (3)$$

Diese liefern:

$$\begin{aligned} d_k &= s_k(x_k) = f_k \\ c_k &= s'_k(x_k) = m_k \end{aligned} \quad (4)$$

und damit:

$$\begin{aligned} s_k(x_{k+1}) &= a_k h_k^3 + b_k h_k^2 + m_k h_k + f_k = f_{k+1} \\ s'_k(x_{k+1}) &= 3a_k h_k^2 + 2b_k h_k + m_k = m_{k+1} \end{aligned}$$

Damit ergeben sich  $a_k$  und  $b_k$  als eindeutige Lösung für das lineare Gleichungssystem

$$\begin{pmatrix} h_k^3 & h_k^2 \\ 3h_k^2 & 2h_k \end{pmatrix} \begin{pmatrix} a_k \\ b_k \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} f_{k+1} - f_k - m_k h_k \\ m_{k+1} - m_k \end{pmatrix} \quad (5)$$

Die Determinante ist  $-h_k^4 \neq 0$ .

### Satz 3.2

Sei eine Zerlegung  $\Delta$  des Intervalls  $[a, b]$  gegeben. Dann gibt es für beliebig gewählte reelle Zahlen  $f_0, \dots, f_n$  und  $m_0, \dots, m_n$  einen Interpolationsspline  $s \in \mathcal{S}_3^1(\Delta)$ , der den Interpolationsbedingungen

$$s'(x_0) = m_0, \dots, s'(x_n) = m_n$$

genügt. Außerdem gilt:  $s|_{[x_k, x_{k+1}]} = s_k$  für  $k=0, \dots, n-1$  mit  $s_k$  entsprechend Gleichung (2), wobei sich  $a_k, b_k, c_k, d_k$  aus Gleichung (4) und Gleichung (5) ergeben.

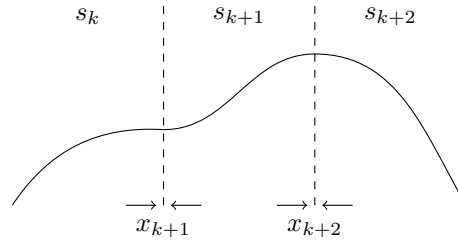
Für die Wahl der  $m_k$  gibt es verschiedene Möglichkeiten, zum Beispiel:

- Falls Ableitungswerte der zu interpolierenden Funktion  $f$  bekannt sind, kann man  $m_k = f'(x_k)$  setzen.
- Man wählt  $m_0, \dots, m_n$  so, dass  $s$  zweimal stetig differenzierbar ist, das heißt  $s \in \mathcal{S}_3^2(\Delta)$  statt  $s \in \mathcal{S}_3^1(\Delta)$  gilt.

### 3.3. Interpolation mit kubischen $C^2$ -Splines

Damit ein kubischer Interpolationsspline  $s$  zu  $\mathcal{S}_3^2(\Delta)$  gehört, muss neben den Forderungen in Gleichung (3) die Stetigkeit von  $s''$  an den Stützstellen  $x_1, \dots, x_{n-1}$  gewährleistet sein. Also hat man zusätzliche Bedingungen

$$s''_k(x_{k+1}) = s''_{k+1}(x_{k+1}) \quad \text{für } k = 0, \dots, n-2$$



Mit Gleichung (2) ergibt sich  $s''(x) = 6a_k(x - x_0) + 2b_k$  für  $x \in [x_k, x_{k+1}]$  und damit  $s_k''(x_{k+1}) = 6a_k h_k + 2b_k$  und  $s_{k+1}''(x_{k+1}) = 2b_{k+1}$ , also

$$3a_k h_k + b_k = b_{k+1} \quad \text{für } k = 0, \dots, n-2 \quad (6)$$

Aus Gleichung (5) folgt

$$a_k = \frac{-2}{h_k^2}(f_{k+1} - f_k) + \frac{1}{h_k^2}(m_k + m_{k+1})$$

$$b_k = \frac{3}{h_k^2}(f_{k+1} - f_k) - \frac{1}{h_k}(2m_k + m_{k+1})$$

für  $k = 0, \dots, n-1$ . Wegen Gleichung (6) erhält man für  $k = 0, \dots, n-2$

$$\begin{aligned} & \frac{-6}{h_k^2}(f_{k+1} - f_k) + \frac{3}{h_k}(m_k + m_{k+1}) + \frac{3}{h_k^2}(f_{k+1} - f_k) - \frac{1}{h_k}(2m_k + m_{k+1}) \\ &= \frac{-6}{h_{k+1}^2}(f_{k+2} - f_{k+1}) - \frac{1}{h_{k+1}}(2m_{k+1} + m_{k+2}) \end{aligned}$$

Damit folgt

$$\frac{1}{h_k}(m_k + 2m_{k+1}) + \frac{1}{h_{k+1}}(2m_{k+1} + m_{k+2}) = \frac{3}{h_k^2}(f_{k+1} - f_k) + \frac{3}{h_{k+1}^2}(f_{k+2} - f_{k+1})$$

bzw.  $h_{k+1}m_k + 2(h_{k+1} + h_k)m_{k+1} + h_k m_{k+2} = \frac{3h_{k+1}}{h_k}(f_{k+1} - f_k) + \frac{3h_k}{h_{k+1}}(f_{k+2} - f_{k+1})$

Also müssen die  $n+1$  Zahlen  $m_0, \dots, m_n$  den  $n-1$  Gleichungen des linearen Gleichungssystems

$$\begin{pmatrix} \lambda_0 & 2 & \mu_0 & & & \\ & \lambda_1 & 2 & \mu_1 & & \\ & & \ddots & \ddots & \ddots & \\ & & & \lambda_{n-2} & 2 & \mu_{n-2} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} m_0 \\ m_1 \\ \vdots \\ m_n \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} r_0 \\ r_1 \\ \vdots \\ r_{n-2} \end{pmatrix}$$

genügen, wobei  $\lambda_k, \mu_k, r_k$  durch

$$\lambda_k = \frac{h_{k+1}}{h_k + h_{k+1}}$$

$$\mu_k = \frac{h_k}{h_k + h_{k+1}}$$

$$r_k = \frac{3h_{k+1}}{h_k(h_k + h_{k+1})}(f_{k+1} - f_k) + \frac{3h_k}{h_{k+1}(h_k + h_{k+1})}(f_{k+2} - f_{k+1})$$

für  $k = 0, \dots, n - 2$  gegeben sind. Die Systemmatrix und die erweiterte Systemmatrix haben den Rang  $n - 1$ . Somit ist das Gleichungssystem lösbar, besitzt aber keine eindeutige Lösung. Um solche zu erhalten, kann man zusätzliche Bedingungen stellen, etwa

(a) **natürliche Randbedingungen:**

$$s''(x_0) = s''(x_n) = 0 \quad (7)$$

Diese sind gleichbedeutend mit

$$s_0''(x_0) = 6a_0(x - x_0) + 2b_0 = 0 \quad \text{und} \quad s_{n-1}''(x_n) = 6a_{n-1}(x_n - x_{n-1}) + 2b_{n-1} = 0$$

Also folgt

$$b_0 = 0 \quad \text{und} \quad 3a_{n-1}h_{n-1} + b_{n-1} = 0$$

Nutzt man noch die Darstellung für  $b_0$  sowie für  $a_{n-1}$  und  $b_{n-1}$ , so folgt

$$2m_0 + m_1 = \frac{3}{h_0}(f_1 - f_0) \quad \text{und} \quad m_{n-1} + 2m_n = \frac{3}{h_{n-1}}(f_n - f_{n-1})$$

Fügt man beide Gleichungen geeignet zum obigen System hinzu, erhält man ein lineares Gleichungssystem mit einer regulären trigonalen Systemmatrix. Dieses kann in  $\mathcal{O}(n)$  Operationen gelöst werden.

(b) **Vollständige Randbedingungen:** Sind  $f'(a)$  und  $f'(b)$  bekannt, dann können die zusätzlichen Bedingungen

$$s'(x_0) = f'(a) \quad \text{und} \quad s'(x_n) = f'(b) \quad (8)$$

mittels  $m_0 = f'(a)$  und  $m_n = f'(b)$  geeignet in das Gleichungssystem eingefügt werden, so dass man analog zu Fall (a) eine trigonale reguläre Systemmatrix erhält.

(c) **Periodische Spline-Interpolation:** Falls

$$f'(a) = f'(b) \quad (9)$$

und  $f''(a) = f''(b)$  gilt, dann sind

$$s'(x_0) = s'(x_n) \quad \text{und} \quad s''(x_0) = s''(x_n) \quad (10)$$

sinnvolle Randbedingungen, woraus sich zwei zusätzliche lineare Gleichungen zur Ergänzung des Gleichungssystems ableiten lassen.

(d) (nicht in der Vorlesung) **Not-in-knot Bedingung:** Es soll zusätzlich

$$s_0'''(x_1) = s_1'''(x_1) \quad \text{und} \quad s_{n-2}'''(x_{n-1}) = s_{n-1}'''(x_{n-1})$$

gelten, das heißt  $s$  ist auf  $[x_0, x_2]$  und auf  $[x_{n-2}, x_n]$  ein Polynom dritten Grades. Man erhält daraus die Forderungen  $a_0 = a_1$  und  $a_{n-2} = a_{n-1}$ , woraus sich zusätzliche Gleichungen in den

Variablen  $m_0, m_1, m_2$  und  $m_{n-2}, m_{n-1}, m_n$  ergeben.

### 3.4. Eine Minimaleigenschaft kubischer $C^2$ -Interpolationssplines

Durch

$$\langle f, g \rangle := \int_a^b f(x)g(x)dx \quad \text{bzw.} \quad \|g\|_2 := \sqrt{\int_a^b g(x)^2 dx} \quad \text{für } f, g \in L^2[a, b]$$

ist ein Skalarprodukt bzw. eine Norm in  $L^2[a, b]$  definiert.

#### Satz 3.3

Seien  $f \in C^2[a, b]$ ,  $\Delta$  eine Zerlegung von  $[a, b]$  und  $f_k := f(x_k)$  für  $k = 0, \dots, n$ . Für einen Interpolationsspline  $s \in \mathcal{S}_3^2(\Delta)$ , der die natürlichen, vollständigen oder periodischen Randbedingungen (bei letzteren gelte Gleichung (9)) erfüllt, gilt:

$$\|s''\|_2^2 = \|f''\|_2^2 - \|f'' - s''\|_2^2 \leq \|f''\|_2^2$$

*Beweis.* Durch Nachrechnen sieht man

$$\int_a^b (f''(x))^2 dx - \int_a^b (f''(x) - s''(x))^2 dx = \int_a^b (s''(x))^2 dx + 2 \int_a^b [f''(x) - s''(x)] s''(x) dx$$

Es wird nun  $J := \int_a^b [f''(x) - s''(x)] s''(x) dx = 0$  gezeigt. Mit Hilfe partieller Integration folgt

$$J = [f'(x) - s'(x)] s''(x) \Big|_a^b - \int_a^b [f'(x) - s'(x)] s'''(x) dx$$

wobei  $s'''$  auf jedem Teilintervall  $[x_k, x_{k+1}]$  konstant ist. Dies ergibt wegen Gleichung (1)

$$\begin{aligned} \int_a^b [f'(x) - s'(x)] s'''(x) dx &= \sum_{k=0}^{n-1} s''' \left( x_k + \frac{h_k}{2} \right) \int_{x_k}^{x_{k+1}} f'(x) - s'(x) dx \\ &= \sum_{k=0}^{n-1} s''' \left( x_k + \frac{h_k}{2} \right) ([f(x_{k+1}) - s(x_{k+1})] - [f(x_k) - s(x_k)]) \\ &= 0 \end{aligned}$$

und damit

$$J = [f'(x) - s'(x)] s''(x) \Big|_a^b = [f'(b) - s'(b)] s''(b) - [f'(a) - s'(a)] s''(a)$$

Nutzt man nun noch Gleichung (7), Gleichung (8) bzw. Gleichung (9) mit Gleichung (10), so folgt  $J = 0$ .  $\square$

#### Anmerkung

- Gleichung (7): natürliche Randbedingungen:  $s''(a) = s''(b) = 0$
- Gleichung (8): vollständige Randbedingungen:  $s(a') = f'(a)$ ,  $s'(b) = f'(b)$
- Gleichung (9) und Gleichung (10): periodische Randbedingungen:  $s'(a) = s'(b)$ ,  $s''(a) = s''(b)$ ,  $f'(a) = f'(b)$



### 3.5. Interpolationsfehler bei kubischer $C^2$ -Interpolation

#### Anmerkung

Die CAUCHY-SCHWARZ-Ungleichung hat folgende Form:

$$|\langle f, g \rangle| \leq \|f\|_2 \cdot \|g\|_2$$

#### Satz 3.4

Seien  $f \in C^2[a, b]$ ,  $\Delta$  eine Zerlegung von  $[a, b]$  und  $f_k := f(x_k)$  für  $k = 0, \dots, n$ . Für einen Interpolationsspline  $s \in \mathcal{S}_3^2(\Delta)$ , der die natürlichen, vollständigen oder periodischen Randbedingungen (bei letzteren gelte Gleichung (9)) erfüllt, gilt:

$$\|f - s\|_\infty \leq \frac{1}{2} h^{3/2} \|f''\|_2$$

wobei  $h := \max\{h_0, \dots, h_{n-1}\}$ .

*Beweis.* Die Funktion  $r := f - s$  hat wegen Gleichung (1) die  $n + 1$  Nullstellen  $x_0, \dots, x_n$ . Der maximale Abstand benachbarter Nullstellen ist  $h$ . Nach dem Satz von Rolle besitzt  $r'$  mindestens  $n$  Nullstellen. Der Abstand zweier Nullstellen von  $r'$  ist durch  $2h$  nach oben beschränkt. Sei  $z \in [a, b]$  so gewählt, dass  $|r'(z)| = \|r'\|_\infty$ . Dann gilt  $|z - z^0| \leq h$  für die  $z$  am nächsten liegende Nullstelle  $z^0$  von  $r'$ . O.B.d.A. sei  $z^0 \leq z$ . Mit der CAUCHY-SCHWARZ-Ungleichung folgt:

$$\begin{aligned} \|r'\|_\infty^2 &= |r'(z) - \underbrace{r'(z^0)}_{z^0 \text{ NST}}|^2 \\ &\stackrel{*}{=} \left| \int_{z^0}^z r''(x) \cdot 1 dx \right|^2 \\ &\stackrel{\text{CS}}{\leq} \int_{z^0}^z r''(x)^2 dx \cdot \underbrace{\int_{z^0}^z 1^2 dx}_{=z-z^0 \leq h} \\ &\leq h \|r''\|_2^2 \end{aligned} \tag{11}$$

\*: Anwendung des Hauptsatzes der Integralrechnung

Sei nun  $y \in [a, b]$  so gewählt, dass  $|r(y)| = \|r\|_\infty$ . Dann gilt  $|y - y_0| \leq h/2$  für die  $y$  am nächsten liegende Nullstelle  $y_0$  von  $r$ . O.B.d.A. sei  $y_0 \leq y$ . Mit Gleichung (11) ergibt sich

$$\|r\|_\infty = |r(y) - r(y_0)| = \left| \int_{y_0}^y r'(x) dx \right| \leq \max |r'(x)| \cdot \int_{y_0}^y dx \leq \frac{1}{2} \|r'\|_\infty \leq \frac{1}{2} h^{3/2} \|r''\|_2$$

Mit Satz 3.3 hat man  $\|r''\|_2 \leq \|f\|_2$  und damit die Behauptung.  $\square$

#### ► Bemerkung 3.5

Besitzt  $f$  eine höhere Glattheit, so kann die obige Fehlerschranke bezüglich der  $h$ -Potenz verbessert werden. Es lassen sich ferner Abschätzungen für  $\|f' - s'\|_\infty$  und  $\|f'' - s''\|_\infty$  herleiten.

## Kapitel II

# *numerische Integration (Quadratur)*

### 1. Integration von Interpolationspolynomen

Für eine Funktion  $f \in C[a, b]$  ist eine Näherung für den Wert des bestimmten Integrals

$$J(f) := \int_a^b f(x) dx$$

gesucht. Seien  $a \leq x_0 < \dots < x_n \leq b$  Stützstellen und  $f_k = f(x_k)$  für  $k = 0, \dots, n$ . Weiter bezeichne  $p_n \in \Pi_n$  das zugehörige Interpolationspolynom. Dann kann man

$$Q_n(f) := J(p_n) = \int_a^b p_n(x) dx$$

als Näherung für  $J(f)$  verwenden. Mit der LAGRANGE-Form des Interpolationspolynoms sieht man, dass

$$Q_n(f) = \int_a^b \sum_{k=0}^n f_k \cdot L_k(x) dx = \sum_{k=0}^n f_k \cdot \int_a^b L_k(x) dx$$

das heißt die Quadraturformel  $Q_n(f)$  ist die gewichtete Summe von Funktionswerten der Funktion  $f$  mit den Gewichten  $\int_a^b L_k(x) dx$ .

## 2. Newton-Cotes-Formeln

Falls die Stützstellen gleichabständig sind mit  $x_0 = a$  und  $x_n = b$ , das heißt

$$x_{k+1} = x_k + h \quad \text{für } k = 0, \dots, n-1 \quad (1)$$

mit der Schrittweite  $h = \frac{b-a}{n}$  gilt, so nennt man  $Q_n(f)$  geschlossene NEWTON-COTES-Formel. Ist  $a < x_0$  und  $x_n < b$  und gilt Gleichung (1) mit  $h = \frac{b-a}{n+2}$ , so bezeichnet man  $Q_n(f)$  als offene NEWTON-COTES-Formel. Im Folgenden wollen wir uns auf den Fall geschlossener NEWTON-COTES-Formeln beschränken.

### 3. spezielle Newton-Cotes-Formeln

Für  $n = 1$  erhält man die Trapezformel mit  $x_0 = a$ ,  $x_1 = b$  und  $h = b - a$  wie folgt:

$$Q_1(f) = f_0 \int_a^b L_0(x) dx + f_1 \int_a^b L_1(x) dx$$

Mit

$$L_0(x) = \frac{x - x_1}{x_0 - x_1} = \frac{b - x}{h} \quad \text{und} \quad L_1(x) = \frac{x - x_0}{x_1 - x_0} = \frac{x - a}{h}$$

$$\int_a^b L_0(x) dx = \frac{1}{h} \int_a^b (b - x) dx = \frac{1}{h} \left( bx - \frac{1}{2} x^2 \right) \Big|_a^b = \frac{1}{h} \left( \frac{b^2}{2} - ab + \frac{a^2}{2} \right) = \frac{h}{2}$$

$$\int_a^b L_1(x) dx = \frac{h}{2}$$

folgt

$$Q_1(f) = \frac{h}{2}(f_0 + f_1)$$

Für Polynomgrad  $n = 2$  erhält man auf ähnliche Weise die SIMPSON-Formel (auch KEPLER'sche Fassregel genannt):

$$Q_2(f) = \frac{h}{3}(f_0 + 4f_1 + f_2)$$

Für Polynomgrade bis  $n = 6$  findet man weitere Formeln in der Literatur. Formeln nur  $n > 6$  werden aus numerischen Gründen nicht verwendet. Es können dann negative Gewichte auftreten.

#### Satz 3.1

(a) Sei  $f \in C^2[a, b]$ . Dann gilt:

$$|Q_1(f) - J(f)| \leq \frac{1}{12} h^3 \|f''\|_\infty$$

(b) Sei  $f \in C^4[a, b]$ . Dann gilt:

$$|Q_2(f) - J(f)| \leq \frac{1}{12} h^5 \|f^{(4)}\|_\infty$$

*Beweis.* (a) Für die Trapezformel erhält man mit Satz 2.9

$$|Q_1(f) - J(f)| = \left| \int_a^b f(x) - p_1(x) dx \right| \leq \frac{\|f''\|_\infty}{2!} \int_a^b |(x-a)(x-b)| dx$$

Mit  $y := x - \frac{a+b}{2}$  ergibt sich:

$$x - a = y + \frac{b-a}{2} = y + \frac{h}{2} \quad \text{und} \quad x - b = y + \frac{a-b}{2} = y - \frac{h}{2}$$

$$\int_a^b |(x-a)(x-b)| dx = - \int_{-h/2}^{h/2} \left(y + \frac{h}{2}\right) \left(y - \frac{h}{2}\right) dy = - \left(\frac{1}{3}y^3 - \frac{1}{4}h^2y\right) \Big|_{-h/2}^{h/2} = \frac{1}{6}h^3$$

(b) Zur Analyse des Quadraturfehlers der SIMPSON-Formel untersuchen wir zunächst

$$W := \int_a^b (x-a)(x-x_1)(x-b) dx$$

$$\bar{W} := \int_a^b |(x-a)(x-x_1)(x-b)| dx$$

Mit der Substitution  $y := x - x_1$  folgen  $x - a = y + h$ ,  $x - x_1 = y$  und  $x - b = y - h$ , also

$$W = \int_a^b (y+h)y(y-h) dy = 0 \tag{1}$$

da die zu integrierende Funktion  $y \mapsto (y+h)y(y-h)$  ungerade ist. Weiter erhält man

$$\bar{W} = \int_{-h}^h |(y+h)y(y-h)| dy = -2 \int_0^h (y^2 - h^2)y dy = \frac{1}{2}h^4 \tag{2}$$

Wegen Satz 2.9 haben wir

$$f(x) - p_2(x) = \frac{f'''(\xi(x))}{3!} w(x) = \frac{1}{6} f'''(x_1) w(x) + \frac{1}{6} (f'''(\xi(x)) - f'''(x_1)) w(x)$$

für alle  $x \in [a, b]$ . Insbesondere ist daher  $x \mapsto f'''(\xi(x))$  eine Funktion aus  $C^1[a, b]$ . Durch Integration folgt mit Gleichung (1):

$$\begin{aligned} \left| \int_a^b f(x) - p_2(x) dx \right| &= \frac{1}{6} \left| f'''(x_1) \int_a^b w(x) dx + \int_a^b (f'''(\xi(x)) - f'''(x_1)) w(x) dx \right| \\ &= \frac{1}{6} \left| \int_a^b (f'''(\xi(x)) - f'''(x_1)) w(x) dx \right| \\ &\leq \max_{x \in [a, b]} \left\{ |f'''(x) - f'''(x_1)| \cdot \int_a^b |w(x)| dx \right\} \end{aligned} \tag{3}$$

Da  $f \in C^4[a, b]$  erhält man mit dem Mittelwertsatz

$$|f'''(x) - f'''(x_1)| = |f^{(4)}(\zeta(x))| \cdot |x - x_1| \leq h \|f^{(4)}\|_\infty$$

mit  $\zeta \in (a, b)$ . Deshalb und wegen Gleichung (2) folgt aus Gleichung (3) weiter

$$|Q_2(f) - J(f)| = \left| \int_a^b f(x) - p_2(x) dx \right| \leq \frac{1}{12} h^5 \|f^{(4)}\|_\infty \quad \square$$

**► Bemerkung 3.2**

Durch verfeinerte Abschätzungen kann man in Satz 3.1 b)

$$|Q_2(f) - J(f)| \leq \frac{1}{90} h^5 \|f^{(4)}\|_\infty \quad (4)$$

erreichen. Auch für Quadraturformeln  $Q_n(f)$  mit  $n > 2$  lassen sich entsprechende Ergebnisse für den Quadraturfehler herleiten, insbesondere hat der Quadraturfehler für  $n = 3$  mit  $f \in C^4[a, b]$  die Ordnung  $h^5$  und für  $n = 4$  mit  $f \in C^6[a, b]$  die Ordnung  $h^7$ .

## 4. Zusammengesetzte Newton-Cotes-Formeln

Um den Quadraturfehler weiter zu reduzieren, bietet es sich unter Berücksichtigung der Abschätzung des Quadraturfehlers in Satz 3.1 an, das Intervall  $[a, b]$  in  $r$  Teilintervalle zu zerlegen und auf jedem der Teilintervalle dieselbe Quadraturformel (niedriger Ordnung) anzuwenden. Dazu wird das Intervall  $[a, b]$  in  $l = rn$  Elementarintervalle gleicher Länge zerlegt, wobei  $n$  die Ordnung des auf jedem Teilintervall zu verwendenden Interpolationspolynoms ist. Mit  $f_0, \dots, f_l$  werden die Funktionswerte an den Stellen  $x_k = a + kh$  für  $k = 0, \dots, l$  bezeichnet, wobei  $h = \frac{b-a}{l}$  die Länge des Elementarintervalls ist. Die zusammengesetzte Trapezformel ist dann gegeben durch:

$$T_h(f) = \frac{h}{2}(f_0 + 2f_1 + 2f_2 + \dots + 2f_{l-1} + f_l)$$

die zusammengesetzte SIMPSON-Formel durch

$$S_h(f) = \frac{h}{3}(f_0 + 4f_1 + 2f_2 + 4f_3 + \dots + 2f_{l-2} + 4f_{l-1} + f_l)$$

### Satz 4.1

(a) Für  $f \in C^2[a, b]$  gilt

$$|T_h(f) - J(f)| \leq \frac{b-a}{12} h^2 \|f''\|_\infty$$

(b) Für  $f \in C^4[a, b]$  gilt

$$|S_h(f) - J(f)| \leq \frac{b-a}{180} h^4 \|f^{(4)}\|_\infty$$

*Beweis.* Wendet man Satz 3.1 auf die SIMPSON-Formel (unter Beachtung von Gleichung (4)) für  $[x_k, x_{k+2}]$  anstelle von  $[a, b]$  an, so folgt

$$|S_h(f) - J(f)| = \left| S_h(f) - \sum_{k=0}^{r-1} \int_{x_{2k}}^{x_{2k+2}} f(x) dx \right| \leq \frac{1}{90} r h^5 \|f^{(4)}\|_\infty \leq \frac{b-a}{2 \cdot 90} h^4 \|f^{(4)}\|_\infty$$

und damit Behauptung b). Behauptung a) zeigt man auf ähnliche Weise.  $\square$

## 5. Gauss'sche Quadraturformeln

Wir gehen zunächst vom Interpolationsfehler (vgl. Satz 2.9)

$$f(x) - p_n(x) = \frac{f^{(n+1)}(\xi(x))}{(n+1)!} w_n(x) \quad \text{für } x \in [a, b]$$

mit  $w_n(x) = (x - x_0) \dots (x - x_n)$  aus. Bezogen auf das ganze Intervall  $[a, b]$ , kann man etwa  $\|f - p_n\|_\infty$  oder  $\|f - p_n\|_2$  als Maß für diesen Fehler verwenden. Da man über  $f^{(n+1)}$  nicht verfügt, wird anstelle dessen  $\|w_n\|_\infty$  oder  $\|w_n\|_2$  untersucht. Dieses Fehlermaß ist offenbar nur von der Lage der Stützstellen  $x_0, \dots, x_n \in [a, b]$  abhängig. Zur Vereinfachung beschränkt man sich zunächst auf das Intervall  $[-1, 1]$ . Die Aufgabe, die Funktion

$$F_\infty : \begin{cases} \mathbb{R}^{n+1} & \rightarrow \mathbb{R} \\ F_\infty(x_0, \dots, x_n) & \mapsto \max_{x \in [-1, 1]} |(x - x_0) \dots (x - x_n)| \end{cases}$$

unter der Bedingung  $(x_0, \dots, x_n) \in [-1, 1]^{n+1}$  zu minimieren, hat als Lösung die Nullstellen des sogenannten TSCHEBYSCHOW-Polynoms  $T_{n+1}$  der Ordnung  $n + 1$ . Die Funktion

$$F_2 : \begin{cases} \mathbb{R}^{n+1} & \rightarrow \mathbb{R} \\ F_2(x_0, \dots, x_n) & \mapsto \int_{-1}^1 (x - x_0)^2 \dots (x - x_n)^2 dx \end{cases}$$

wird unter der Bedingung  $(x_0, \dots, x_n) \in [-1, 1]^{n+1}$  durch die Nullstellen des sogenannten LEGENDRE-Polynoms  $P_{n+1}$  minimiert. Die LEGENDRE-Polynome können rekursiv wie folgt definiert werden:

$$\begin{aligned} P_0(t) &= 1 \\ P_1(t) &= t \\ &\vdots \\ (k+1)P_{k+1}(t) &= (2k+1)tP_k(t) - kP_{k-1}(t) \end{aligned}$$

für alle  $t \in \mathbb{R}$  und  $k = 1, 2, \dots$ . Für  $n = 1$  erhält man zum Beispiel  $P_2(t) = t^2 - \frac{1}{3}$  mit den Nullstellen  $x_{1/2} = \pm \frac{\sqrt{3}}{3}$ . Das Interpolationspolynom zu diesen Stützstellen und den Stützwerten  $f_0 = f(x_0)$  sowie  $f_1 = f(x_1)$  lautet dann (in der LAGRANGE-Form)

$$q_1(x) = f_0 \frac{x - x_1}{x_0 - x_1} + f_1 \frac{x - x_0}{x_1 - x_0}$$

Wegen

$$\begin{aligned} \int_{-1}^1 \frac{x - x_1}{x_0 - x_1} dx &= -\frac{\sqrt{3}}{2} \int_{-1}^1 \left( x - \frac{\sqrt{3}}{3} \right) dx = 1 \\ \int_{-1}^1 \frac{x - x_0}{x_1 - x_0} dx &= 1 \end{aligned}$$



hat man die GAUSS-LEGENDRE-Quadraturformel für das Integral  $\int_{-1}^1 f(x)dx$  für  $n = 1$ :

$$f\left(-\frac{\sqrt{3}}{3}\right) + f\left(\frac{\sqrt{3}}{3}\right)$$

Man kann zeigen, dass die GAUSS-LEGENDRE-Quadraturformel mit  $n+1$  Stützstellen (also den Nullstellen von  $P_{n+1}$ ) Polynome bis zum Grad  $2n+1$  exakt integriert. Bei den geschlossenen NEWTON-COTES-Formeln ist dies nur bis Grad  $n$  (falls  $n$  ungerade) bzw. bis zum Grad  $n+1$  (falls  $n$  gerade) möglich (vgl. Übungsaufgabe). Spezielle Modifikationen der GAUSS-LEGENDRE-Quadratur beziehen einen Randpunkt (GAUSS-RADAU) oder beide Randpunkte (GAUSS-LOBATTO) des Integrals mit ein.

Falls über  $[a, b]$  zu integrieren ist, führt eine Variablentransformation auf ein Integral über  $[-1, 1]$  zum Ziel. Mit

$$y = \frac{2}{b-a} \left( x - \frac{a+b}{2} \right)$$

ergibt sich  $x = \frac{b-a}{2}y + \frac{a+b}{2}$ ,  $dx = \frac{b-a}{2}dy$  und

$$\int_a^b f(x)dx = \frac{b-a}{2} \int_{-1}^1 f\left(\frac{b-a}{2}y + \frac{a+b}{2}\right) dy$$

## Kapitel III

# *direkte Verfahren für lineare Gleichungssysteme*

### 1. Gauss'scher Algorithmus für quadratische Systeme

## 2. Lineare Quadratmittelprobleme

### **3. Kondition linearer Gleichungssysteme**

## Kapitel IV

# *Kondition von Aufgaben und Stabilität von Algorithmen*

### 1. Maschinenzahlen und Rundungsfehler

## 2. Fehleranalyse

Kapitel V

# Newton-*Verfahren zur Lösung nichtlinearer Gleichungssysteme*

## 1. Das Newton-Verfahren

## 2. Gedämpftes Newton-Verfahren



## Kapitel VI

# *lineare Optimierung*

### 1. Ecken und ihre Charakterisierung

## 2. Simplex-Verfahren

### **3. Die Tableauform des Simplex-Verfahrens**

## 4. Revidiertes Simplex-Verfahren

## 5. Bestimmung einer ersten zulässigen Basislösung

# Anhang

## Anhang A: Listen

### A.1. Liste der Theoreme

## A.2. Liste der benannten Sätze, Lemmata und Folgerungen

Satz I.2.7:      Satz von FABER 1914 . . . . . 6



# Index

- HORNER-Schema, 6
- KEPLER'sche Fassregel, 17
- LAGRANGE-Form, 4
- LEGENDRE-Polynoms, 21
- SIMPSON-Formel, 17
- TSCHEBYSCHOW-Polynoms, 21
  
- Basispolynom
  - LAGRANGE-Basispolynom, 4
  - NEWTON-Basispolynome, 5
  
- Funktionsraum, 2
  
- Interpolationsbedingungen, 2
- Interpolationspolynom, 4
- Interpolierende, 2
  
- kubischer Interpolationspline, 9
  
- Maximum-Norm, 6
  
- Newton-Cotes-Formel
  - geschlossene NEWTON-COTES-Formel, 16
  - offene NEWTON-COTES-Formel, 16
  
- Polynomspline, 9
  
- Stützstellen, 2
- Stützstellensystem, 6
- Stützwerte, 2
  
- Trapezformel, 17
  
- zusammengesetzte SIMPSON-Formel, 20
- zusammengesetzte Trapezformel, 20