

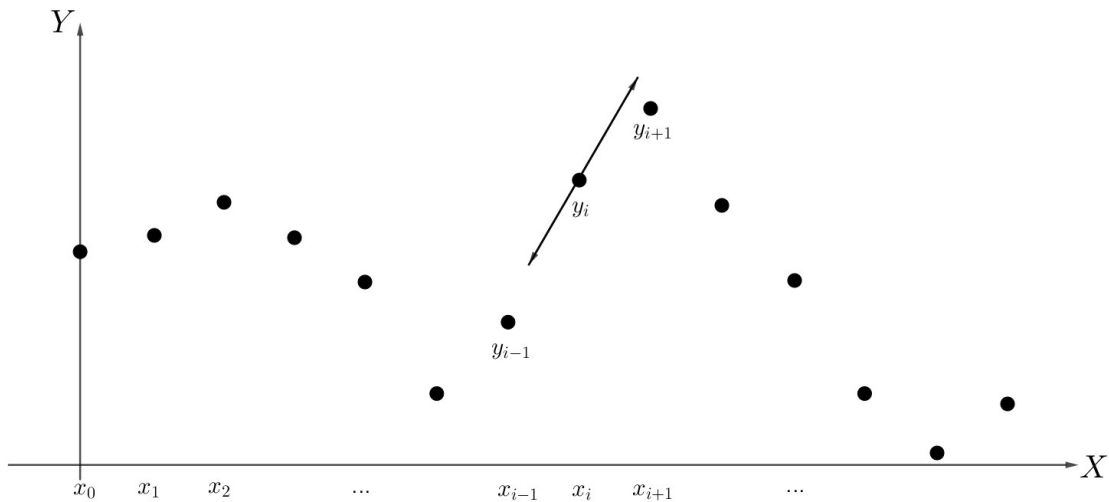
บทที่ 5

การหาอนุพันธ์และปริพันธ์เชิงตัวเลข

สาเหตุที่ต้องใช้การประมาณค่าเชิงตัวเลขในการอินทิกรัลจำกัดเขตบางฟังก์ชันเราไม่สามารถหาค่าอินทิเกรตได้ เช่น $f(x) = x^x$, $f(x) = e^{-x^2}$ การเขียนโปรแกรมซึ่งการเขียนโปรแกรมเพื่อประมาณพื้นที่ใต้กราฟใด ๆ เป็น เรื่องไม่ง่ายในคำนวณค่าของอินทิเกรตแบบสัญลักษณ์

5.1 การประมาณค่าอนุพันธ์อันดับหนึ่ง

พิจารณา อนุพันธ์อันดับหนึ่งของฟังก์ชันของตัวแปรตาม y เทียบกับตัวแปรอิสระ x ซึ่งเขียน แทนด้วย $\frac{dy}{dx}$ เราสามารถประมาณค่าโดยตรงของ $\frac{dy}{dx}$ ได้ 3 วิธีโดยพิจารณาจากรูปต่อไปนี้



ในทางเรขาคณิตเราทราบว่า $\frac{dy}{dx}_i$ หมายถึงความชันของเส้นสัมผัสเส้นโค้ง y_i ที่จุด x_i ดังนั้นเราสามารถประมาณค่าของความชันของเส้นสัมผัสดังกล่าวได้ 3 วิธีโดยตรงดังนี้

1. ผลต่างทางหน้า (Forward difference) เป็นการประมาณค่าจากความชันของเส้นตรง ที่ผ่านจุด x_i และ x_{i+1} นั่นคือ

$$\left. \frac{dy}{dx} \right|_{x_i} = f'(x_i) \approx \frac{y_{i+1} - y_i}{h}$$

หรือ

$$\left. \frac{dy}{dx} \right|_{x_i} = f'(x_i) \approx \frac{f(x_{i+1}) - f(x_i)}{h}$$

เมื่อ $h = x_{i+1} - x_i$

จากอนุกรมเทย์เลอร์รอบจุด x_i

$$f(x_i + h) = f(x_i) + f'(x_i)h + \frac{f''(\xi)}{2}h^2$$

เมื่อ $\xi \in (x_i, x_i + h)$

ดังนั้น จะได้

$$f'(x_i) = \frac{f(x_i + h) - f(x_i)}{h} - \frac{f''(\xi)}{2}h$$

พิจารณาค่าคลาดเคลื่อนตัดปลาย

$$E = -\frac{f''(\xi)}{2}h$$

เขียนได้เป็น

$$E(h) = -\frac{f''(\xi)}{2}h$$

พิจารณา

$$\lim_{h \rightarrow 0} \frac{-\frac{f''(\xi)}{2}h}{h} = -\frac{f''(\xi)}{2} = c < \infty$$

ให้ $E(h) = O(h)$

จะได้ว่า ระเบียบวิธีอันดับหนึ่ง (First-order method) คือ

$$f'(x_i) = \frac{f(x_i + h) - f(x_i)}{h} + O(h)$$

2. ผลต่างทางหลัง (Backward difference) เป็นการประมาณจากความชันของเส้นตรงที่ผ่านจุด x_{i-1} และ x_i นั่นคือ

$$\left. \frac{dy}{dx} \right|_{x_i} = f'(x_i) \approx \frac{y_i - y_{i-1}}{h}$$

หรือ

$$\left. \frac{dy}{dx} \right|_{x_i} = f'(x_i) \approx \frac{f(x_{i-1}) - f(x_i)}{h}$$

เมื่อ $h = x_i - x_{i-1}$

จากอนุกรมเทย์เลอร์รอบจุด x_i

$$f(x_i - h) = f(x_i) - f'(x_i)h + \frac{f''(\xi)}{2}h^2$$

เมื่อ $\xi \in (x_i - h, x_i)$

ดังนั้น จะได้

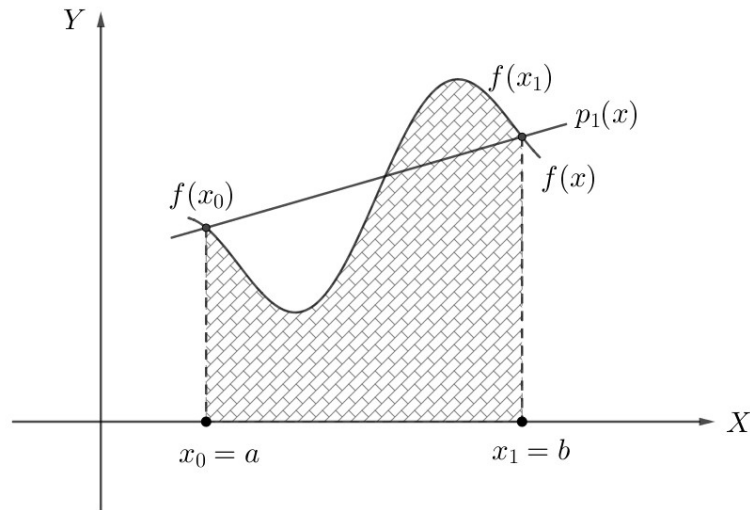
$$f'(x_i) = \frac{f(x_i) - f(x_i - h)}{h} + \frac{f''(\xi)}{2}h$$

หรือ

$$f'(x_i) = \frac{f(x_i) - f(x_i - h)}{h} + O(h)$$

A series of horizontal dotted lines for writing, consisting of 25 lines spaced evenly down the page.

5.3 การประมาณค่าปริพันธ์โดยใช้ระเบียบวิธีสี่เหลี่ยมคางหมู



จากรูปจะเห็นว่า

$$f(x) \approx p_1(x)$$

$$\int_a^b f(x)dx \approx \int_a^b p_1(x)dx$$

พิจารณาพหุนามลากรางจ์

$$p_1(x) = \frac{(x - x_1)}{(x_0 - x_1)} f(x_0) + \frac{(x - x_0)}{(x_1 - x_0)} f(x_1)$$

ดังนั้น

$$f(x) \approx \frac{(x - x_1)}{(x_0 - x_1)} f(x_0) + \frac{(x - x_0)}{(x_1 - x_0)} f(x_1)$$

เขียนใหม่

$$f(x) = \frac{(x - x_1)}{(x_0 - x_1)} f(x_0) + \frac{(x - x_0)}{(x_1 - x_0)} f(x_1) + \frac{1}{2} f''(\xi(x))(x - x_0)(x - x_1)$$

เมื่อ $\xi \in (x_0, x_1)$

ดังนั้น

$$\int_a^b f(x)dx = \left[\frac{(x - x_1)}{(x_0 - x_1)} f(x_0) + \frac{(x - x_0)}{(x_1 - x_0)} f(x_1) \right] + \frac{1}{2} f''(\xi(x))(x - x_0)(x - x_1)dx$$

พิจารณา $\int_{x_0}^{x_1} \left[\frac{(x - x_1)}{(x_0 - x_1)} f(x_0) + \frac{(x - x_0)}{(x_1 - x_0)} f(x_1) \right] dx$ จะได้ว่า

$$\begin{aligned} \int_{x_0}^{x_1} \left[\frac{(x - x_1)}{(x_0 - x_1)} f(x_0) + \frac{(x - x_0)}{(x_1 - x_0)} f(x_1) \right] dx &= \left[\frac{(x - x_1)^2}{2(x_0 - x_1)} f(x_0) + \frac{(x - x_0)^2}{2(x_1 - x_0)} f(x_1) \right]_{x_0}^{x_1} \\ &= \frac{(x_1 - x_0)}{2} [f(x_0) + f(x_1)] \\ &= \frac{h}{2} [f(x_0) + f(x_1)] \end{aligned}$$

พิจารณา $\frac{1}{2}f''(\xi(x))(x-x_0)(x-x_1)dx$ โดยทฤษฎีบทค่าเฉลี่ย จะได้ว่า

$$\begin{aligned}\frac{1}{2}\int_{x_0}^{x_1} f''(\xi(x))(x-x_0)(x-x_1)dx &= \frac{1}{2}f''(\xi)\int_{x_0}^{x_1} (x-x_0)(x-x_1)dx \\ &= \frac{1}{2}f''(\xi)\left[\frac{x^3}{3} - \frac{(x_1+x_0)}{2}x^2 + x_0x_1x\right]_{x_0}^{x_1} \\ &= -\frac{h^3}{12}f''(\xi)\end{aligned}$$

เมื่อ $\xi \in (x_0, x_1)$

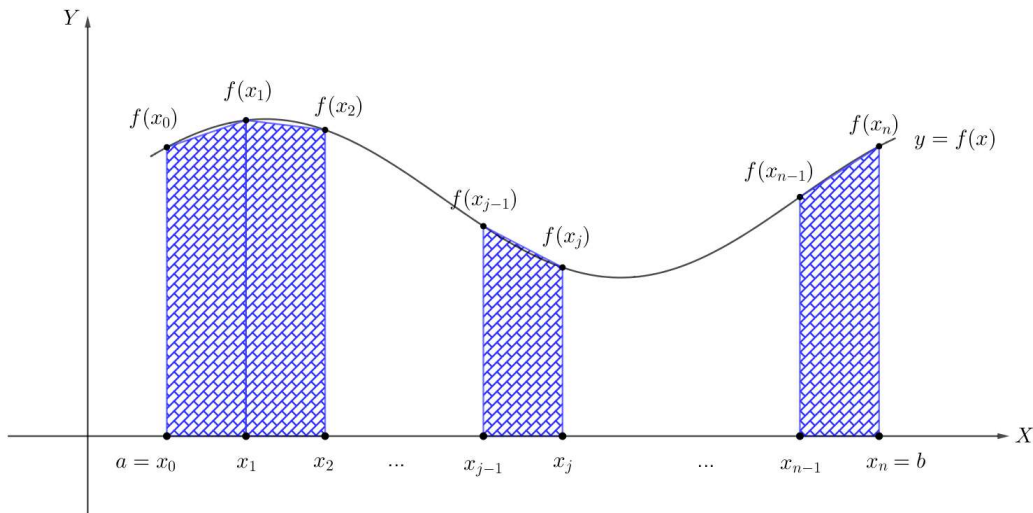
ดังนั้น

$$\int_a^b f(x)dx = \frac{h}{2}[f(x_0) + f(x_1)] - \frac{h^3}{12}f''(\xi)$$

หรือ

$$\boxed{\int_a^b f(x)dx \approx \frac{h}{2}[f(x_0) + f(x_1)]}$$

เราจะขยายแนวคิดนี้ไปยัง การใช้พื้นที่รูปสี่เหลี่ยมคางหมูหลายรูปในการประมาณพื้นที่ใต้กราฟ



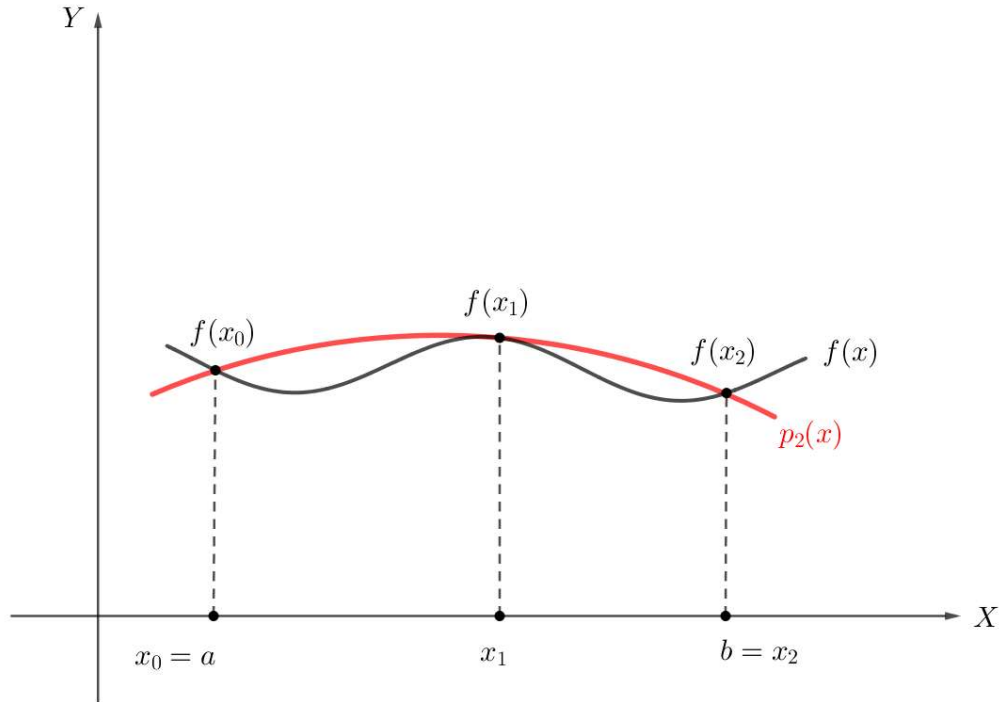
จากรูปจะได้ว่า

$$\begin{aligned}\int_a^b f(x)dx &\approx \left[\frac{1}{2}(f(x_0) + f(x_1))h + \frac{1}{2}(f(x_1) + f(x_2))h + \dots + \frac{1}{2}(f(x_{n-1}) + f(x_n))h\right] \\ &\approx \frac{h}{2}[f(x_0) + 2f(x_1) + 2f(x_2) + \dots + 2f(x_{n-1}) + f(x_n)] \\ &\approx \frac{h}{2}\left[f(x_0) + 2\sum_{j=1}^{n-1} f(x_j) + f(x_n)\right]\end{aligned}$$

หรือ

$$\boxed{\int_a^b f(x)dx = \frac{h}{2}\left[f(x_0) + 2\sum_{j=1}^{n-1} f(x_j) + f(x_n)\right] - \frac{(b-a)h^2}{12}f''(\xi)}$$

5.4 การประมาณค่าปริพันธ์โดยใช้ระเบียบวิธีซิมป์สัน



จากพหุนามลากรางจ์ดีกรีสอง

$$p_2(x) = \frac{(x-x_1)(x-x_2)}{(x_0-x_1)(x_0-x_2)}f(x_0) + \frac{(x-x_0)(x-x_2)}{(x_1-x_0)(x_1-x_2)}f(x_1) + \frac{(x-x_0)(x-x_1)}{(x_2-x_0)(x_2-x_1)}f(x_2)$$

ดังนั้น

$$f(x) \approx p_2(x)$$

หรือ

$$f(x) = p_2(x) + \text{remainder term}$$

จาก

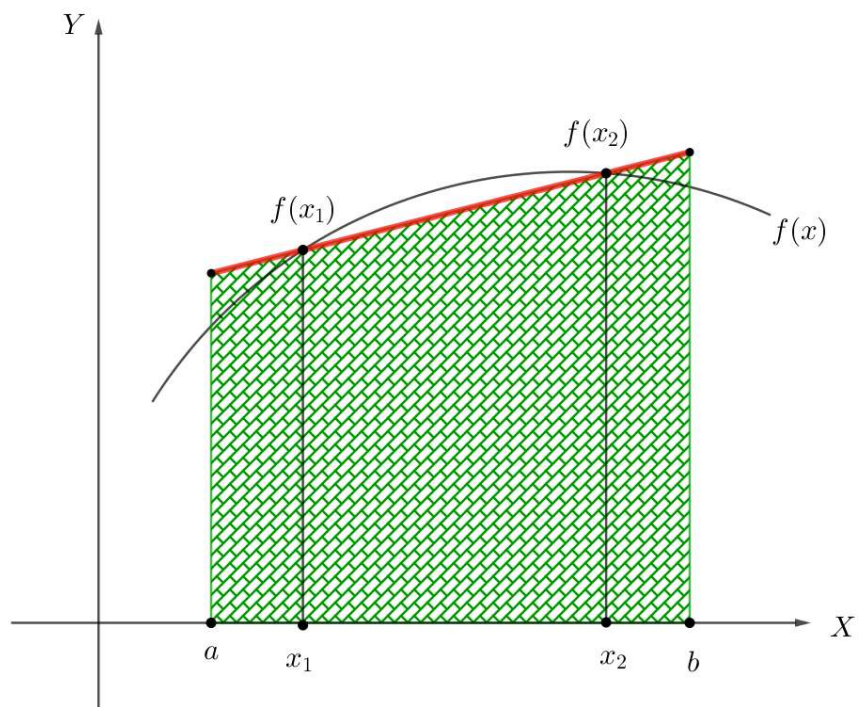
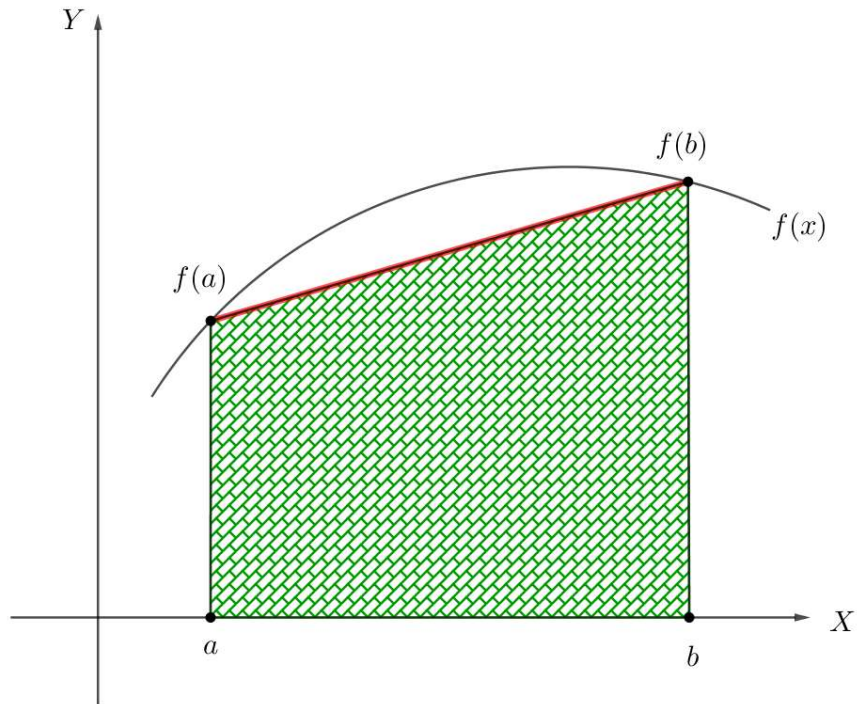
$$\int_a^b f(x)dx = \int_{x_0}^{x_2} \left[\frac{(x-x_1)(x-x_2)}{(x_0-x_1)(x_0-x_2)}f(x_0) + \frac{(x-x_0)(x-x_2)}{(x_1-x_0)(x_1-x_2)}f(x_1) + \frac{(x-x_0)(x-x_1)}{(x_2-x_0)(x_2-x_1)}f(x_2) \right] dx + \int_{x_0}^{x_2} \frac{(x-x_0)(x-x_1)(x-x_2)}{6} f'''(\xi(x)) dx$$

พิจารณาใหม่ โดยใช้อนุกรมเทย์เลอร์

$$f(x) = f(x_1) + f'(x_1)(x-x_1) + \frac{f''(x_1)}{2!}(x-x_1)^2 + \frac{f'''(x_1)}{3!}(x-x_1)^3 + \frac{f^{(4)}(\xi(x))}{4!}(x-x_1)^4$$

$$\int_{x_0}^{x_2} f(x) = \left[f(x_1)x + f'(x_1)\frac{(x-x_1)^2}{2} + f''(x_1)\frac{(x-x_1)^3}{6} + f'''(x_1)\frac{(x-x_1)^4}{24} \right]_{x_0}^{x_2} + \frac{1}{24} \int_{x_0}^{x_2} f^{(4)}(\xi(x))(x-x_1)^4 dx$$

5.5 การประมาณค่าปริพันธ์โดยใช้ระเบียบเกาส์ควอดราเจอร์



สมมติการประมาณค่าปริพันธ์

$$\int_a^b f(x)dx \approx \sum_{i=1}^n c_i f(x_i)$$

เมื่อ c_i เป็นค่าคงที่

$$\int_{-1}^1 f(x)dx \approx c_1 f(x_1) + c_2 f(x_2)$$

ถ้า $n = 2$, $2n - 1 = 3$

$$f(x) = a_0 + a_1 x + a_2 x^2 + a_3 x^3$$

เมื่อ a_0, a_1, a_2, a_3 เป็นค่าคงที่

$$\begin{aligned} \int_{-1}^1 f(x) &= \int_{-1}^1 (a_0 + a_1 x + a_2 x^2 + a_3 x^3) dx \\ &= a_0 \int_{-1}^1 1 dx + a_1 \int_{-1}^1 x dx + a_2 \int_{-1}^1 x^2 dx + a_3 \int_{-1}^1 x^3 dx \\ &= c_1 f(x_1) + c_2 f(x_2) \end{aligned}$$

เงื่อนไขในการหา c_1, c_2, x_1, x_2

$$f(x) = 1, f(x) = x, f(x) = x^2, f(x) = x^3$$

กรณีที่ 1 $f(x) = 1$

$$\begin{aligned} \int_{-1}^1 f(x) dx &= \int_{-1}^1 1 dx = 2 \\ \int_{-1}^1 f(x) dx &\approx c_1 f(x_1) + c_2 f(x_2) = c_1 \cdot 1 + c_2 \cdot 1 \end{aligned}$$

ดังนั้นจะได้เงื่อนไขแรกคือ $c_1 + c_2 = 2$ (1)

กรณีที่ 2 $f(x) = x$

$$\begin{aligned} \int_{-1}^1 f(x) dx &= \int_{-1}^1 x dx = \left[\frac{x^2}{2} \right]_{-1}^1 = 0 \\ \int_{-1}^1 f(x) dx &\approx c_1 f(x_1) + c_2 f(x_2) = c_1 \cdot x_1 + c_2 \cdot x_2 \end{aligned}$$

ดังนั้นจะได้เงื่อนไขแรกคือ $c_1 x_1 + c_2 x_2 = 0$ (2)

กรณีที่ 3 $f(x) = x^2$

$$\begin{aligned} \int_{-1}^1 f(x) dx &= \int_{-1}^1 x^2 dx = \left[\frac{x^3}{3} \right]_{-1}^1 = \frac{2}{3} \\ \int_{-1}^1 f(x) dx &\approx c_1 f(x_1) + c_2 f(x_2) = c_1 \cdot x_1^2 + c_2 \cdot x_2^2 \end{aligned}$$

ดังนั้นจะได้เงื่อนไขแรกคือ $c_1 x_1^2 + c_2 x_2^2 = \frac{2}{3}$ (3)

กรณีที่ 4 $f(x) = x^3$

$$\begin{aligned} \int_{-1}^1 f(x) dx &= \int_{-1}^1 x^3 dx = \left[\frac{x^4}{4} \right]_{-1}^1 = 0 \\ \int_{-1}^1 f(x) dx &\approx c_1 f(x_1) + c_2 f(x_2) = c_1 \cdot x_1^3 + c_2 \cdot x_2^3 \end{aligned}$$

ดังนั้นจะได้เงื่อนไขแรกคือ $c_1 x_1^3 + c_2 x_2^3 = 0$ (4)

แก้ระบบสมการเชิงเส้น

$$c_1 + c_2 = 2 \quad \dots\dots\dots (1)$$

$$c_1x_1 + c_2x_2 = 0 \quad \dots\dots (2)$$

$$c_1x_1^2 + c_2x_2^2 = \frac{2}{3} \quad \dots\dots (3)$$

$$c_1x_1^3 + c_2x_2^3 = 0 \quad \dots\dots (4)$$

จะได้

$$c_1 = 1, c_2 = 1, x_1 = -\frac{\sqrt{3}}{3}, x_2 = \frac{\sqrt{3}}{3}$$

ดังนั้น

$$\begin{aligned} \int_{-1}^1 f(x) &\approx c_1f(x_1) + c_2f(x_2) \\ &= 1 \cdot f\left(-\frac{\sqrt{3}}{3}\right) + 1 \cdot f\left(\frac{\sqrt{3}}{3}\right) \end{aligned}$$

จุดเกาส์สองจุดบนช่วง $(-1,1)$ คือ $-\frac{\sqrt{3}}{3}$, $\frac{\sqrt{3}}{3}$ หรือ -0.5773 , 0.5773

ถ้าเราเพิ่มจุดเกาส์เพิ่มขึ้นเรื่อย ๆ จะได้ว่า

n	ค่าถ่วงน้ำหนัก	ตำแหน่งจุดเกาส์
2	$c_1 = 1.0000$	$x_1 = -0.5773$
	$c_2 = 1.0000$	$x_2 = 0.5773$

n	ค่าถ่วงน้ำหนัก	ตำแหน่งจุดเกาส์
3	$c_1 = 0.5556$	$x_1 = -0.7746$
	$c_2 = 0.8889$	$x_2 = 0.0000$
	$c_3 = 0.5556$	$x_3 = 0.7746$

n	ค่าถ่วงน้ำหนัก	ตำแหน่งจุดเกาส์
4	$c_1 = 0.3479$	$x_1 = -0.8611$
	$c_2 = 0.6521$	$x_2 = -0.3400$
	$c_3 = 0.6521$	$x_3 = 0.3400$
	$c_4 = 0.3479$	$x_4 = 0.8611$

n	ค่าถ่วงน้ำหนัก	ตำแหน่งจุดเกาส์
5	$c_1 = 0.2369$	$x_1 = -0.9062$
	$c_2 = 0.4786$	$x_2 = -0.5385$
	$c_3 = 0.5689$	$x_3 = 0.0000$
	$c_4 = 0.4786$	$x_4 = 0.5385$
	$c_5 = 0.2369$	$x_5 = 0.9062$

ตัวอย่าง ถ้า $n = 3$

$$\begin{aligned} \int_{-1}^1 f(x) &\approx c_1f(x_1) + c_2f(x_2) + c_3f(x_3) \\ &= 0.556 \cdot f(-0.7746) + 0.8889 \cdot f(0.0000) + 0.5556 \cdot f(0.7746) \end{aligned}$$

