



УДК 519.622

## О ВЫЧИСЛЕНИИ КОЭФФИЦИЕНТОВ ОРТОГОНАЛЬНЫХ РАЗЛОЖЕНИЙ РЕШЕНИЙ ОБЫКНОВЕННЫХ ДИФФЕРЕНЦИАЛЬНЫХ УРАВНЕНИЙ<sup>1</sup>

О. Б. Арушанян, Н. И. Волченскова, С. Ф. Залеткин

Предложены способы определения начального приближения коэффициентов разложений решений обыкновенных дифференциальных уравнений и их производных в ряды по многочленам Чебышева первого рода. Полученные приближения предназначены для использования в методе приближенного аналитического интегрирования обыкновенных дифференциальных уравнений на основе ортогональных разложений.

**Ключевые слова:** обыкновенные дифференциальные уравнения, приближенные аналитические методы интегрирования, численные методы интегрирования, смещенные ряды Чебышева, квадратурные формулы Маркова.

Рассматривается задача Коши для нормальной системы  $M$  обыкновенных дифференциальных уравнений

$$y' = f(x, y), \quad x_0 \leq x \leq x_0 + X, \quad y(x_0) = y_0. \quad (1)$$

В [1] предложен приближенный аналитический метод решения задачи (1), основанный на ортогональном разложении решения и его производной на шаге интегрирования в ряды по смещенным многочленам Чебышева первого рода. Приближенное решение вычисляется в виде частичной суммы такого ряда. В [1] также приведены соотношения, которые связывают коэффициенты Чебышева решения с коэффициентами Чебышева правой части системы. Для нахождения последних на основе квадратурных формул Маркова [2, 3] построены уравнения и описан итерационный процесс их решения.

Настоящая статья посвящена вопросу, связанному с определением начального приближения коэффициентов Чебышева правой части системы для данного итерационного процесса. Здесь мы рассмотрим два способа определения начального приближения. Будем предполагать, что правая

<sup>1</sup> Работа выполнена при поддержке РФФИ (проект 10-01-00297-а).

часть дифференциального уравнения имеет нужное число непрерывных частных производных, обеспечивающих справедливость приводимых оценок и преобразований.

**1. Первый способ определения начального приближения.** Опишем этот способ для частичного сегмента  $[x_0, x_0 + h]$ ,  $0 < h \leq X$ , на котором приближенное решение ищется в виде конечной суммы ряда.

Пусть  $\tilde{J}_k$  —  $k$ -я частичная сумма смещенного ряда Чебышева правой части системы (1) на сегменте  $[x_0, x_0 + h]$ ,  $U$  — частичная сумма смещенного ряда Чебышева для решения задачи (1) на том же сегменте,  $a_i^*$  — значения коэффициентов смещенного ряда Чебышева и  $T_i^*(\alpha)$  — смещенные многочлены Чебышева первого рода. Положим

$$\frac{1}{2} a_0^* [\tilde{J}_k] = \frac{1}{2} a_0^* [f(x_0, y_0)] = f(x_0, y_0)$$

и определим приближенные значения первых двух коэффициентов Чебышева решения:

$$a_1^*[U] = \frac{h}{4} a_0^*[\tilde{J}_k], \quad \frac{1}{2} a_0^*[U] = y_0 + \frac{h}{4} a_0^*[\tilde{J}_k].$$

Далее вычисляем в узлах

$$x_j^0 = x_0 + \alpha_j h, \quad \alpha_0 = 0, \quad \alpha_j = \frac{1}{2} \left( 1 + \cos \frac{(2j-1)\pi}{2k+1} \right), \quad j = 1, \dots, k,$$

значения приближенного решения и правой части:

$$U(x_j^0) = \frac{1}{2} a_0^*[U] T_0^*(\alpha_j) + a_1^*[U] T_1^*(\alpha_j) = \frac{1}{2} a_0^*[U] + a_1^*[U] \cos \frac{(2j-1)\pi}{2k+1},$$

$$\tilde{\Phi}(\alpha_0) = f(x_0, y_0), \quad \tilde{\Phi}(\alpha_j) = f(x_j^0, U(x_j^0)), \quad j = 1, \dots, k.$$

В качестве нулевого приближения для  $a_i^*[\tilde{J}_k]$  возьмем значения, определяемые по следующей квадратурной формуле Маркова:

$$a_i^{*(0)}[\tilde{J}_k] = \frac{4}{2k+1} \sum_{j=0}^k{}' \tilde{\Phi}(\alpha_j) T_i^*(\alpha_j), \quad i = 0, 1, \dots, k.$$

Здесь символ  $\sum'$  определен формулой  $\sum_{j=l}^m{}' a_j = \frac{1}{2} a_l + a_{l+1} + \dots + a_m$ ,  $m \geq l$ . Эти значения имеют погрешность  $O(h^2)$ . Дальнейшее уточнение значений коэффициентов выполняется с помощью итерационного процесса так, как это описано в [1]. Для погрешности полученных в результате итерационного процесса приближенных значений  $a_i^*[\tilde{J}_k]$  коэффициентов Чебышева справедлива асимптотическая оценка

$$a_i^*[\Phi] - a_i^*[\tilde{J}_k] = O(h^{k+1}), \quad h \rightarrow 0, \tag{2}$$

где

$$\Phi(\alpha) = F(x_0 + \alpha h) = f(x_0 + \alpha h, y(x_0 + \alpha h)), \quad 0 \leq \alpha \leq 1. \tag{3}$$

В рассмотренном способе используется только значение решения на левом конце промежутка интегрирования, поэтому приведенный алгоритм может быть применен на любом частичном сегменте  $[x_n, x_n + h]$ .

**2. Второй способ определения начального приближения.** Описанный ниже способ опирается на экстраполяцию коэффициентов Чебышева с предыдущего сегмента на следующий.

Покажем, как коэффициенты Чебышева разложения функции (3) могут быть использованы для получения коэффициентов Чебышева разложения функции

$$\Phi_1(\alpha) = F(x_1 + \alpha h^*) = f(x_1 + \alpha h^*, y(x_1 + \alpha h^*)), \quad 0 \leq \alpha \leq 1, \quad x_1 = x_0 + h,$$

где  $h^*$  — длина следующего частичного сегмента  $[x_1, x_1 + h^*]$ .

Обратимся к частичной сумме смещенного ряда Чебышева функции  $\Phi(\alpha)$  с приближенными коэффициентами. Пусть  $t = 2\alpha - 1$  и  $\bar{\Phi}(t) = \Phi(\alpha(t))$ , тогда  $a_i^*[\Phi(\alpha)] = a_i[\bar{\Phi}(t)]$ , где  $a_i$  — коэффициенты ряда по несмещенным многочленам Чебышева. С учетом (2) имеем

$$\tilde{S}_k(\alpha, \Phi) = \tilde{J}_k(\alpha) = \sum_{i=0}^k a_i^*[\tilde{J}_k] T_i^*(\alpha) = \sum_{i=0}^k a_i[\bar{\Phi}(t)] T_i(t) + O(h^{k+1}). \quad (4)$$

Используя выражение коэффициента Чебышева функции через производную этой функции [4]

$$a_i[\bar{\Phi}(t)] = \frac{1}{2^{i-1}} \frac{\bar{\Phi}^{(i)}(\zeta_i)}{i!}, \quad \zeta_i \in [-1, 1],$$

и упорядочивая сумму по степеням переменной  $t$ , получим

$$\begin{aligned} \tilde{S}_k(t, \bar{\Phi}) &= \sum_{i=0}^k \frac{1}{2^{i-1}} \frac{\bar{\Phi}^{(i)}(\zeta_i)}{i!} T_i(t) + O(h^{k+1}) = \\ &= \sum_{i=0}^k \frac{1}{2^{i-1}} \left[ \frac{1}{i!} \left(\frac{h}{2}\right)^i F^{(i)}(x_{1/2}) + O(h^{i+1}) \right] T_i(t) + O(h^{k+1}) = \\ &= \sum_{i=0}^k \left( \frac{1}{i!} \left(\frac{h}{2}\right)^i F^{(i)}(x_{1/2}) + O(h^{i+1}) \right) t^i + O(h^{k+1}), \quad x_{1/2} = x_0 + \frac{h}{2}. \end{aligned} \quad (5)$$

Аналогично можно представить частичную сумму ряда Чебышева функции  $\Phi_1(\alpha)$ :

$$\tilde{S}_k(t, \bar{\Phi}_1) = \sum_{i=0}^k \left( \frac{1}{i!} \left(\frac{h^*}{2}\right)^i F^{(i)}(x_{3/2}) + O(h^{*i+1}) \right) t^i + O(h^{*k+1}), \quad x_{3/2} = x_1 + \frac{h^*}{2}. \quad (6)$$

Для дальнейшего определим следующие матрицы:  $P$  — верхняя треугольная матрица Паскаля с элементами  $p_{ij} = C_{j-1}^{i-1}$ ,  $1 \leq i \leq k+1$ ,  $1 \leq j \leq k+1$ ,  $i \leq j$ ;  $T$  и  $I$  — диагональные матрицы  $(k+1)$ -го порядка:  $T = \{1, 1 + \xi, (1 + \xi)^2, \dots, (1 + \xi)^k\}$  и  $I = \{1, \omega, \omega^2, \dots, \omega^k\}$ , где  $\xi = h^*/h$  и  $\omega = \xi/(1 + \xi)$ .

Введем векторы длины  $k+1$ :

$$\begin{aligned} Z(x_{1/2}) &= \left( F(x_{1/2}), \frac{h}{2} F'(x_{1/2}), \frac{1}{2} \left(\frac{h}{2}\right)^2 F''(x_{1/2}), \dots, \frac{1}{k!} \left(\frac{h}{2}\right)^k F^{(k)}(x_{1/2}) \right)^T, \\ Z(x_{3/2}) &= \left( F(x_{3/2}), \frac{h^*}{2} F'(x_{3/2}), \frac{1}{2} \left(\frac{h^*}{2}\right)^2 F''(x_{3/2}), \dots, \frac{1}{k!} \left(\frac{h^*}{2}\right)^k F^{(k)}(x_{3/2}) \right)^T. \end{aligned}$$

Последовательно применяя линейные преобразования, задаваемые матрицами  $T$ ,  $P$  и  $I$ , к вектору  $Z(x_{1/2})$ , приходим к следующим соотношениям:

$$TZ(x_{1/2}) = \left( F(x_{1/2}), \frac{h+h^*}{2} F'(x_{1/2}), \dots, \frac{1}{k!} \left(\frac{h+h^*}{2}\right)^k F^{(k)}(x_{1/2}) \right)^T,$$

$$PTZ(x_{1/2}) = \left( F(x_{3/2}), \frac{h+h^*}{2} F'(x_{3/2}), \dots, \frac{1}{k!} \left( \frac{h+h^*}{2} \right)^k F^{(k)}(x_{3/2}) \right)^T + O(h^{k+1}),$$

$$IPTZ(x_{1/2}) = Z(x_{3/2}) + O(h^{k+1}).$$

Точные компоненты вектора  $Z(x_{1/2})$  нам не известны, но приближения к ним могут быть получены из (5). Применяя указанные выше преобразования к вектору, составленному из этих приближений, мы получим компоненты вектора  $Z(x_{3/2})$  с погрешностями  $O(h^*)$ ,  $O(h^{*2})$ ,  $\dots$ ,  $O(h^{*k+1})$ , а именно получим величины

$$d_i = \frac{1}{i!} \left( \frac{h^*}{2} \right)^i F^{(i)}(x_{3/2}) + O(h^{*i+1}).$$

Далее составим полином переменной  $t$  с коэффициентами, равными числам  $d_i$ , и выполним с ним те преобразования, которые были использованы при выводе формул (4)–(6), но осуществим их в обратном порядке:

$$\begin{aligned} \sum_{i=0}^k d_i t^i &= \sum_{i=0}^k \left( \frac{1}{i!} \left( \frac{h^*}{2} \right)^i F^{(i)}(x_{3/2}) + O(h^{*i+1}) \right) t^i = \sum_{i=0}^k \left( \frac{1}{i!} \bar{\Phi}_1^{(i)}(0) + O(h^{*i+1}) \right) t^i = \\ &= \sum_{i=0}^k \left( \frac{1}{2^{i-1}} \frac{1}{i!} \bar{\Phi}_1^{(i)}(0) + O(h^{*i+1}) \right) T_i(t) = \sum_{i=0}^k \left( a_i [\bar{\Phi}_1(t)] + O(h^{*i+1}) \right) T_i(t) = \\ &= \sum_{i=0}^k \left( a_i^* [\Phi_1(\alpha)] + O(h^{*i+1}) \right) T_i^*(\alpha). \end{aligned}$$

Таким образом, мы имеем в итоге коэффициенты Чебышева функции  $\Phi_1(\alpha)$  с погрешностями  $O(h^*)$ ,  $O(h^{*2})$ ,  $\dots$ ,  $O(h^{*k+1})$ , которые и принимаем за нулевое приближение для неизвестных  $a_i^*[\bar{J}_k]$  на сегменте  $[x_1, x_1 + h^*]$ . Дальнейшее уточнение значений коэффициентов  $a_i^*[\bar{J}_k]$  выполняется с помощью итерационного процесса так, как это описано в [1].

**3. Примеры.** 1) Интегрируется обыкновенное дифференциальное уравнение [5]

$$y' = y^2 - x \ln x y + \ln x + 1, \quad y(1) = 0. \tag{7}$$

Точное решение  $y = x \ln x$  представляет собой произведение линейной и логарифмической функций. Задача решалась методом рядов Чебышева на интервале  $[1, X_F]$ , при этом задавалось разбиение интервала на несколько частичных сегментов длиной  $h$  и на каждом сегменте решение представлялось в виде  $(k + 1)$ -й частичной суммы ряда Чебышева. Вычисления проводились с 16 значащими цифрами. Значения  $X_F$ ,  $h$  и  $k$ , способ выбора начального приближения для коэффициентов Чебышева правой части дифференциального уравнения, а также количество верных цифр в приближенных значениях решения  $y(X_F)$ , вычисленных в конце интервала, приведены в табл. 1 и 2. В них содержатся результаты счета, отражающие разные условия окончания итерационного процесса вычисления коэффициентов разложения решения в ряд по многочленам Чебышева. В табл. 1 даны результаты, полученные за *фиксированное число* итераций, в то время как результаты из табл. 2 относятся к случаю *исправления до сходимости*.

Из табл. 1 наглядно видно, что применение второго способа определения начального приближения коэффициентов, основанного на экстраполировании уже известных на предыдущем частичном сегменте коэффициентов, может существенно повысить точность нахождения коэффициентов разложения решения и точность вычисления самого решения на данном сегменте.

В табл. 2 даны для сравнения результаты, полученные классическим методом Рунге–Кутты четвертого порядка и методом Адамса пятого порядка типа предиктор–корректор с постоянным шагом  $h$  [2, 6, 7]. Прочерк в таблице означает, что при указанном в ней значении  $h$  вычисленные значения приближенного решения задачи не имеют ни одной верной цифры.

Таблица 1

№	$X_F$	$h$	Количество верных цифр для $y(X_F)$ в методе рядов Чебышева		
			$k$	Способ выбора начального приближения	
				Первый способ: из начального условия	Второй способ: экстраполяция
1	3.2	0.2	5	7	9
2	3.2	0.2	10	6	14
3	3.4	0.2	10	6	13
4	3.4	0.4	10	9	12
5	3.4	0.4	20	9	13
6	5.0	0.4	20	4	9

Таблица 2

№	$X_F$	$h$	Количество верных цифр для $y(X_F)$				
			Метод рядов Чебышева			Классический метод Рунге–Кутта 4-го порядка	Метод Адамса 5-го порядка
			$K$	Способ выбора начального приближения			
				Первый способ: из начального условия	Второй способ: экстраполяция		
1	3.2	0.2	5	9	9	4	3
2	3.2	0.2	10	14	14	4	3
3	3.4	0.2	10	14	13	3	3
4	3.4	0.4	10	12	12	2	1
5	3.4	0.4	20	13	13	2	1
6	5.0	0.4	20	9	9	–	–

Из данных таблиц также следует, что использование второго способа может существенно сократить число итераций в итерационной процедуре вычисления коэффициентов разложения решения без потери точности приближенного решения.

В табл. 3 приведены с удвоенной точностью коэффициенты Чебышева разложения решения  $y(x)$  на сегменте  $[3.0, 3.2]$  в виде частичной суммы смещенного ряда Чебышева, соответствующего  $k = 10$ :

$$y(3 + 0.2\alpha) = \sum_{i=0}^{11} a_i^* [y] T_i^*(\alpha), \quad 0 \leq \alpha \leq 1.$$

Эти коэффициенты получены с использованием описанных выше способов определения начального приближения. Видно, что последовательность коэффициентов достаточно регулярно стремится к нулю и ряд Чебышева на данном сегменте быстро сходится.

При интегрировании уравнения (7) на интервале  $[1, X_F]$ ,  $X_F = 3.2$ , методом Рунге–Кутта с автоматическим выбором шага интегрирования максимальная фактически достигнутая точность в точке  $X_F$  равнялась  $0.400 \times 10^{-12}$ , при этом было выполнено 5396 вычислений правой части уравнения (7). Для метода Адамса с автоматическим выбором шага интегрирования максимальная фактически достигнутая точность в точке  $X_F = 3.2$  равнялась  $0.176 \times 10^{-11}$  при количестве вычислений правой части 1784. При интегрировании (7) методом рядов Чебышева с

разбиением промежутка интегрирования  $[1, X_F]$ ,  $X_F = 3.2$ , на одиннадцать частичных сегментов длиной  $h = 0.2$  и представлением решения на каждом таком сегменте  $(k + 1)$ -й частичной суммой ряда Чебышева (при  $k = 10$ ) полученное приближенное решение  $y(X_F)$  имеет 14 верных цифр и абсолютную погрешность  $0.621 \times 10^{-14}$ , при этом было выполнено 781 вычислений правой части.

Таблица 3

Номер коэффициента	Коэффициенты Фурье-Чебышева	
	Первый способ	Второй способ
0	.7016306204338346D+01	.7016306204338350D+01
1	.2131272004797743D+00	.2131272004797756D+00
2	.8065915307780902D-03	.8065915307787086D-03
3	-.4337454135282221D-05	-.4337454134895229D-05
4	.3498766228166824D-07	.3498766252168790D-07
5	-.3386726712828877D-09	-.3386725384792346D-09
6	.3642481730688130D-11	.3642542704863059D-11
7	-.4200086991603610D-13	-.4197639966661063D-13
8	.5014507045545968D-15	.5093808811166757D-15
9	-.9868649107779156D-17	-.5169310316412304D-17
10	.4798272239606154D-18	.5855369357779519D-18
11	.5250372225053376D-18	-.1109027938139574D-17

Качественно такое же соотношение между вычислительными затратами и максимальной фактически достигнутой точностью приближенного решения наблюдается для методов Рунге-Кутта, Адамса и рассматриваемого метода рядов также и при интегрировании уравнения (7) на интервале  $[1, X_F]$ ,  $X_F = 5.0$ .

2) Интегрируется обыкновенное дифференциальное уравнения [5]

$$y' = \frac{1}{1+x} (y^2 + 1 - \ln^2(1+x)), \quad y(0) = 0, \quad 0 \leq x \leq 1. \quad (8)$$

Точным решением задачи является логарифмическая функция  $y(x) = \ln(1+x)$ . На заданном интервале решение представляется в виде частичной суммы смещенного ряда Чебышева при  $k = 20$ :

$$y(x) \approx \sum_{i=0}^{k+1} a_i^*[y] T_i^*(x). \quad (9)$$

Вычисления проводились с 16 значащими цифрами. Приближенное значение решения  $y(1) \approx 0.6931471805599453$  в конце промежутка интегрирования, найденное с помощью данной частичной суммы, имеет 16 верных цифр. Аналогичные значения искомого решения, полученные классическим методом Рунге-Кутта четвертого порядка и методом Адамса пятого порядка типа предиктор-корректор с шагом  $h = 1$  имеют соответственно только две и одну верную цифры.

Приближенные значения коэффициентов  $a_0^*[y]$  и  $a_1^*[y]$  разложения (9), вычисленные с помощью метода рядов, имеют абсолютные погрешности  $0.555 \times 10^{-16}$  и  $0.166 \times 10^{-15}$ . Абсолютные погрешности остальных коэффициентов в (9) существенно меньше, чем  $10^{-16}$ , и сами коэффициенты имеют 16 верных десятичных знаков. Погрешности коэффициентов определялись, исходя из известного ряда Чебышева логарифмической функции:

$$\ln(1+x) = 2 \ln \frac{\sqrt{2}+1}{2} - 2 \sum_{i=1}^{\infty} (-1)^i \frac{(\sqrt{2}-1)^{2i}}{i} T_i^*(x).$$

При интегрировании задачи (8) методом Рунге–Кутта с автоматическим выбором шага интегрирования максимальная фактически достигнутая точность в конце промежутка интегрирования равнялась  $0.343 \times 10^{-13}$ , при этом было выполнено 10 276 вычислений правой части уравнения (8). Для метода Адамса с автоматическим выбором шага интегрирования максимальная фактически достигнутая точность в конце промежутка равнялась  $0.164 \times 10^{-13}$  при количестве вычислений правой части, равном 2104. При интегрировании уравнения (8) с помощью частичной суммы ряда (9) было выполнено всего 301 вычислений правой части и все 16 цифр приближенного решения  $y(1)$  являются верными.

Из приведенных результатов можно сделать следующий вывод. Представление решения обыкновенного дифференциального уравнения в виде частичной суммы ряда Чебышева позволяет вычислять приближение к решению с такой высокой точностью, которая на практике может оказаться недостижимой в методах типа Рунге–Кутта и Адамса для той же разрядной сетки, поскольку эта точность требует столь малых размеров шага интегрирования, что эти шаги выходят за границу *реальной области асимптотики* для этих методов [7].

### Список литературы

1. Арушанян О.Б., Волченкова Н.И., Залеткин С.Ф. Приближенное интегрирование обыкновенных дифференциальных уравнений на основе ортогональных разложений // Дифференциальные уравнения и процессы управления. 2009. 14, № 4. 59–68.
2. Мысовский И.П. Лекции по методам вычислений. СПб.: Изд-во С.-Петербург. ун-та, 1998.
3. Арушанян О.Б., Волченкова Н.И., Залеткин С.Ф. О некоторых свойствах частичных сумм рядов Чебышева // Дифференциальные уравнения и процессы управления. 2009. 14, № 3. 26–34.
4. Пашковский С. Вычислительные применения многочленов и рядов Чебышева. М.: Наука, 1983.
5. Зайцев В.Ф., Полянин А.Д. Справочник по обыкновенным дифференциальным уравнениям. М.: Физматлит, 2001.
6. Бахвалов Н.С., Жидков Н.П., Кобельков Г.М. Численные методы. М.: БИНОМ, 2007.
7. Арушанян О.Б., Залеткин С.Ф. Численное решение обыкновенных дифференциальных уравнений на Фортране. М.: Изд-во Моск. ун-та, 1990.