



普通高等教育“十一五”国家级规划教材

数值分析

哈尔滨工业大学数学系

吴勃英 主编



高等教育出版社

普通高等教育“十一五”国家级规划教材

数值分析

哈尔滨工业大学数学系

吴勃英 主编

高等教育出版社

内容简介

本书介绍了常用数值计算方法的构造和使用,内容包括线性代数方程组、非线性方程和方程组、常微分方程和方程组的数值解法,插值法与数值逼近,数值积分,矩阵的特征值和特征向量的计算等。同时,对数值计算方法的计算效果、稳定性、收敛性、误差分析、适用范围及优缺点也作了必要的分析与介绍。

本书可作为高等院校各类工科专业研究生和数学系各专业本科生教材或参考用书,也可供从事科学与工程计算的科研工作者参考。

图书在版编目(CIP)数据

数值分析 / 吴勃英主编. —北京:高等教育出版社,
2007.1

ISBN 978 - 7 - 04 - 020193 - 3

I. 数... II. 吴... III. 数值计算 - 高等学校 -
教材 IV. O241

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2006) 第 139635 号

策划编辑 杨 波 责任编辑 杨 波 封面设计 张志奇 责任绘图 宗小梅
版式设计 王 莹 责任校对 殷 然 责任印制 宋克学

出版发行 高等教育出版社
社 址 北京市西城区德外大街 4 号
邮政编码 100011
总 机 010 - 58581000

经 销 蓝色畅想图书发行有限公司
印 刷 高等教育出版社印刷厂

开 本 787 × 960 1/16
印 张 16.75
字 数 310 000

购书热线 010 - 58581118
免费咨询 800 - 810 - 0598
网 址 <http://www.hep.edu.cn>
<http://www.hep.com.cn>
网上订购 <http://www.landaco.com>
<http://www.landaco.com.cn>
畅想教育 <http://www.widedu.com>

版 次 2007 年 1 月第 1 版
印 次 2007 年 1 月第 1 次印刷
定 价 22.90 元

本书如有缺页、倒页、脱页等质量问题,请到所购图书销售部门联系调换。

版权所有 侵权必究

物料号 20193 - 00

郑 重 声 明

高等教育出版社依法对本书享有专有出版权。任何未经许可的复制、销售行为均违反《中华人民共和国著作权法》,其行为人将承担相应的民事责任和行政责任,构成犯罪的,将被依法追究刑事责任。为了维护市场秩序,保护读者的合法权益,避免读者误用盗版书造成不良后果,我社将配合行政执法部门和司法机关对违法犯罪的单位和个人给予严厉打击。社会各界人士如发现上述侵权行为,希望及时举报,本社将奖励举报有功人员。

反盗版举报电话: (010) 58581897/58581896/58581879

传 真: (010) 82086060

E - mail: dd@hep.com.cn

通信地址: 北京市西城区德外大街 4 号

高等教育出版社打击盗版办公室

邮 编: 100011

购书请拨打电话: (010)58581118

前 言

随着科学技术的发展,科学与工程计算愈来愈显示出其重要性,与实验、理论三足鼎立,成为科学实践的三大手段之一,其应用范围渗透到所有的科学活动领域。作为科学与工程计算的数学工具,“数值分析”从20世纪80年代起,就逐渐成为各高等院校工科硕士研究生学位公共必修课。

本教材考虑到工科各专业对数值分析的实际需要,重点突出学以致用原则,着重介绍在计算机上常用的数值计算方法的构造和使用,同时对数值计算方法的计算效果、稳定性、收敛性、误差分析、适用范围及优缺点也作了必要的分析与介绍。教材中每章都配有难易程度不等的习题,有些习题必须通过上机实践来完成。这样,能让学生通过习题来消化课堂内容,结合实验课中上机实习的要求,可使学生对所学数值方法有更深刻确切的理解。

由于编者水平所限,教材中难免有不妥之处,恳请读者指正,以便今后做进一步的修改。

编 者

2006年9月

大学数学系列教材编写委员会

主 任：王 勇

委 员（按姓氏笔画为序）：

王德明 邓廷权 田波平 刘国庆

刘 锐 李道华 吴勃英 张宗达

郑宝东 高广宏 唐余勇 盖云英

目 录

绪论	1
§ 0.1 研究数值分析的必要性	1
§ 0.2 误差概念	1
§ 0.3 数值计算中应注意的若干问题	5
习题零	9
第一章 线性代数方程组数值解法	10
§ 1.1 向量范数、矩阵范数和连续函数的范数	10
§ 1.2 Gauss 消元法	16
§ 1.3 三角分解法	22
§ 1.4 方程组的性态、条件数	35
§ 1.5 线性方程组的迭代解法	40
§ 1.6 梯度法	51
习题一	61
第二章 非线性方程和方程组的数值解法	69
§ 2.1 基本问题	69
§ 2.2 迭代法	71
§ 2.3 单点迭代法	73
§ 2.4 多点迭代法	81
§ 2.5 重根上的迭代法	84
§ 2.6 迭代加速收敛的方法	86
§ 2.7 拟 Newton 法	88
习题二	91
第三章 插值和拟合	96
§ 3.1 多项式插值	96
§ 3.2 样条插值	117
§ 3.3 有理逼近	129
§ 3.4 最佳平方逼近	132
§ 3.5 周期函数逼近与快速 Fourier 变换	146
习题三	150
第四章 数值积分与微分	159
§ 4.1 数值积分的一般问题	159
§ 4.2 等距节点的 Newton - Cotes 公式	162

§ 4.3	Romberg 积分法	170
§ 4.4	Gauss 求积公式	175
§ 4.5	带权函数的 Gauss 型求积公式	182
§ 4.6	振荡函数的求积公式	193
§ 4.7	自动变步长 Simpson 方法和自适应 Simpson 方法	196
§ 4.8	数值微分法	197
习题四		198
第五章	矩阵特征值和特征向量的计算	205
§ 5.1	乘幂法与反幂法	205
§ 5.2	Jacobi 方法	209
§ 5.3	Householder 方法	212
§ 5.4	QR 算法	217
习题五		219
第六章	常微分方程数值解法	223
§ 6.1	初值问题数值解法的一般概念	223
§ 6.2	单步法的局部截断误差和阶	226
§ 6.3	Runge - Kutta 法	228
§ 6.4	单步法的收敛性与稳定性	233
§ 6.5	线性多步法	239
§ 6.6	预测 - 校正方法	244
§ 6.7	高阶方程和方程组	247
§ 6.8	Stiff 方程简介	250
习题六		254
参考文献		260

绪 论

§ 0.1 研究数值分析的必要性

数值分析是研究用计算机解决数学问题的数值计算方法及有关理论.

一般的,用计算机进行科学与工程计算时要经历如下过程:

实际问题 $\Rightarrow$ 数学建模 $\Rightarrow$ 提出数值问题 $\Rightarrow$ 设计实用的数值计算方法 $\Rightarrow$ 软件实现 $\Rightarrow$ 程序的执行 $\Rightarrow$ 结果的分析验证及可视化.

可见,数值分析是科学与工程计算过程中必不可少的环节.它以纯数学为基础,但不只研究数学本身的理论,而着重研究解决问题的数值方法及效果,如怎样使计算速度最快、存储量最少等问题,以及数值方法的收敛性、稳定性、误差分析.虽然有些方法在理论上还不够完善与严密,但通过对比分析、实际计算和实践检验等手段,被证明是行之有效的方法,也可采用.因此,数值分析这门课程既带有纯数学高度抽象性和严密科学性的特点,又具有应用的广泛性和实际试验的高度技术性特点,是一门与计算机密切相连的实用性很强的计算数学课程.

例如,用 Cramer 法则解一个 n 阶线性代数方程组需要计算 $n+1$ 个 n 阶行列式.不计加减运算,求解总共需要 $n!(n+1)+n$ 次乘除法.当 n 很大时,这个计算量是相当惊人的.比如解一个不算太大的 20 阶线性方程组,大约要做 9.7×10^{20} 次乘除法,显然,这样的方法是毫无实用意义的.然而,如果采用数值分析中介绍的任何一种解线性方程组的数值方法,比如 Gauss 消元法,乘除法次数不超过 3 000 次,即使在微型计算机上,也只需几秒钟时间就能很容易地完成.这个例子说明了研究实用的数值方法是非常有必要的.而数值分析研究的正是在计算效率上最佳的或近似最佳的方法.而不是像 Cramer 法则这样的方法.评价一个算法的优劣主要有两个标准:计算结果的精度和得到这个精度结果需要付出的代价.

§ 0.2 误差概念

对数学问题进行数值求解,求得的结果一般都包含有误差.即数值计算绝大多数情况是近似计算,因此,误差分析和估计是数值计算过程中的重要内容,由它们可以确切地知道误差的性态和误差的界.

0.2.1 误差来源

数值计算所得结果中的误差通常来自固有误差与计算误差,如下面所示:

$$\text{误差来源} \left\{ \begin{array}{l} \text{固有误差} \left\{ \begin{array}{l} \text{模型误差} \\ \text{观测误差} \end{array} \right. \\ \text{计算误差} \left\{ \begin{array}{l} \text{截断误差} \\ \text{舍入误差} \end{array} \right. \end{array} \right.$$

固有误差的一个来源是由求解问题的数学模型本身所固有的模型误差,它包括对实际物理过程进行近似的数学描述时所引进的误差. 另一个来源是物理数据的不精确性,这些数据往往是由实验观测得到的,从而带有观测误差. 这些都不是数值分析所研究的内容. 这里仅考虑数学模型的精确解与计算结果之间的误差. 即计算误差.

计算误差主要有两个来源. 一个是由于在求解某一个已公式化的数学问题时,不是对其本身求解而是对它的某一个近似问题求解而造成的,这类误差称为截断误差或方法误差. 这类误差往往是由有限过程逼近一个无限过程时产生的. 比如,函数 e^x 可展开为幂级数形式

$$e^x = 1 + x + \frac{x^2}{2!} + \cdots + \frac{x^n}{n!} + \cdots, \quad (0.2.1)$$

如果用式(0.2.1)右边前 $n+1$ 项

$$S_n(x) = 1 + x + \frac{x^2}{2!} + \cdots + \frac{x^n}{n!} \quad (0.2.2)$$

来近似 e^x 的无穷多项的和,所产生的误差就是这一问题的截断误差,为

$$e^x - S_n(x) = \frac{x^{n+1}}{(n+1)!} e^{\theta x}, \quad 0 < \theta < 1. \quad (0.2.3)$$

再比如序列

$$\begin{cases} x_0 = 3, \\ x_{n+1} = \frac{1}{2} \left(x_n + \frac{5}{x_n} \right), \end{cases} \quad n = 0, 1, 2, \cdots, \quad (0.2.4)$$

因为 $\lim_{n \rightarrow +\infty} x_n = \sqrt{5}$, 所以,可以用无限迭代过程式(0.2.4)的有限次结果来得到 $\sqrt{5}$ 的近似值,而产生的误差也是截断误差.

通常这类误差的精确值是不能求得的. 所以,一般只研究这类误差的某一估计值或它的某一个界.

产生计算误差的另一重要来源,是由于算术运算几乎不可能在计算机上完全精确地进行. 首先,由于计算机所能表示的数字的位数有限(即字长有限),在进行计算时,对超过计算机所能表达的位数的数字就要进行舍入;其次,尽管有些数据

些数据可以精确地由计算机表达,但是,当进行乘除运算时,常常也要对其运算的结果进行舍入,如计算 $\frac{1}{7}$. 上述这种对某一个数进行舍入而产生的误差称为舍入误差.

一般情况,每一步的舍入误差是微不足道的,但是经过计算过程的传播和积累,舍入误差可能会对真值产生很大的影响. 甚至在一些情况中,一次的舍入就会大大改变计算结果.

0.2.2 误差限量

1. 误差与误差限

[定义 0.1] 设 $\tilde{x}$ 代表精确值 x 的一个近似值,称

$$E(\tilde{x}) = x - \tilde{x} \quad (0.2.5)$$

为近似值 x 的绝对误差,或简称误差.

显然,绝对误差依赖于量纲,通常无法精确地算出绝对误差的真值,只能根据具体测量或计算的情况估计它的绝对值的范围,也就是去估计 $|E(\tilde{x})|$ 的上界. 若

$$|E(\tilde{x})| = |x - \tilde{x}| \leq \varepsilon, \quad (0.2.6)$$

称 ε 为 $\tilde{x}$ 的绝对误差限,或简称误差限.

在工程技术上,常将不等式(0.2.6)表示成

$$x = \tilde{x} \pm \varepsilon.$$

绝对误差的大小,在许多情况下还不能完全刻画一个近似值的精确程度. 如有两个数

$$x = 10 \pm 0.1, \quad y = 10^{15} \pm 10^6,$$

这里 y 的绝对误差是 x 的 10^7 倍,但是不能就此断定近似值 $\tilde{x} = 10$ 一定比近似值 $\tilde{y} = 10^{15}$ 精确程度高. 若考虑到精确值本身的大小,在 10^{15} 内差 10^6 显然比在10内差0.1更精确些. 这说明一个近似值的精确程度,除了与绝对误差有关,还与精确值本身有关. 为此引入相对误差概念.

2. 相对误差与相对误差限

[定义 0.2] 设 $\tilde{x}$ 是精确值 x 的一个近似值,称

$$RE(\tilde{x}) = \frac{E(\tilde{x})}{x} = \frac{x - \tilde{x}}{x} \quad (0.2.7)$$

为近似值 $\tilde{x}$ 的相对误差.

相对误差是无量纲的,通常用百分数表示. 与绝对误差类似,我们只能估计

相对误差绝对值的某一个上界. 若

$$|RE(\tilde{x})| \leq \varepsilon, \quad (0.2.8)$$

则称 ε 为近似值 $\tilde{x}$ 的相对误差限.

由于

$$\frac{x - \tilde{x}}{\tilde{x}} - \frac{x - \tilde{x}}{x} = \frac{(x - \tilde{x})^2}{\tilde{x}x} = \left[\frac{E(\tilde{x})}{\tilde{x}} \right]^2 \left[\frac{1}{1 + \frac{E(\tilde{x})}{\tilde{x}}} \right],$$

当

$$\left| \frac{E(\tilde{x})}{\tilde{x}} \right| \leq \frac{1}{2},$$

有

$$\left| 1 + \frac{E(\tilde{x})}{\tilde{x}} \right| \geq 1 - \left| \frac{E(\tilde{x})}{\tilde{x}} \right| \geq \frac{1}{2},$$

从而

$$\left| \frac{x - \tilde{x}}{\tilde{x}} - \frac{x - \tilde{x}}{x} \right| \leq 2 \left[\frac{E(\tilde{x})}{\tilde{x}} \right]^2.$$

显然, 当 $\left| \frac{E(\tilde{x})}{\tilde{x}} \right|$ 很小时, $\frac{x - \tilde{x}}{\tilde{x}}$ 与 $\frac{x - \tilde{x}}{x}$ 的差是 $\frac{E(\tilde{x})}{\tilde{x}}$ 的平方量级, 可以忽略不计. 因

此, 在实际计算中, 常取

$$RE(\tilde{x}) = \frac{x - \tilde{x}}{\tilde{x}}. \quad (0.2.9)$$

0.2.3 有效数字

我们表示一个近似数时, 为了能反映它的精确程度, 常常用到“有效数字”的概念.

【定义 0.3】若 x 的某一近似值 $\tilde{x}$ 的绝对误差界是某一位的半个单位, 则从这一位起直到左边第一个非零数字为止的所有数字都称为 $\tilde{x}$ 的有效数字.

具体地说, 对于数 x , 经四舍五入之后, 得到它的近似值

$$\tilde{x} = \pm (x_1 \cdot 10^{-1} + x_2 \cdot 10^{-2} + \cdots + x_n \cdot 10^{-n}) \cdot 10^m, \quad (0.2.10)$$

其中, $x_1, x_2, \dots, x_n$ 都是 $0, 1, 2, \dots, 9$ 这十个数字之一, $x_1 \neq 0$, n 是正整数, m 是整数. 如果 $\tilde{x}$ 的绝对误差满足

$$|x - \tilde{x}| \leq \frac{1}{2} \times 10^{m-n}, \quad (0.2.11)$$

我们称 $\tilde{x}$ 为 x 具有 n 位有效数字的近似值, 也可以说它精确到第 n 位. 其中 $x_1, x_2, \dots, x_n$ 都是 $\tilde{x}$ 的有效数字. 如果表示一个数的数字全是有效数字, 则称此数为有效数.

【例 0.1】按四舍五入原则分别写出数 0.037 835 51, $e = 2.718\ 281\ 828\dots$, 0.002 030 002 具有 5 位有效数字的近似数.

【解】按有效数字定义, 上述各数具有 5 位有效数字的近似数分别是

$$0.037\ 836, 2.718\ 3, 0.002\ 030\ 0.$$

需要注意的是, 有效数 0.002 03 与 0.002 030 0 是不同的, 前者具有 3 位有效数字, 其绝对误差不超过 $\frac{1}{2} \times 10^{-5}$, 而后者具有 5 位有效数字, 其绝对误差不超过 $\frac{1}{2} \times 10^{-7}$.

0.2.4 有限数字与两种误差的关系

由式(0.2.11)可见, n 越大, 绝对误差限越小. 即有效数字越多, 数字越准确, 绝对误差越小.

下面再来讨论有效数字与相对误差的关系. 设 $\tilde{x}$ 具有 n 位有效数字, 由式(0.2.10)知

$$x_1 \cdot 10^{m-1} \leq |\tilde{x}| \leq (x_1 + 1) \cdot 10^{m-1},$$

所以再由(0.2.11)得

$$|RE(\tilde{x})| = \left| \frac{x - \tilde{x}}{\tilde{x}} \right| \leq \frac{\frac{1}{2} \times 10^{m-n}}{x_1 \cdot 10^{m-1}} = \frac{1}{2x_1} \cdot 10^{-(n-1)}. \quad (0.2.12)$$

这个结果说明, 有效数字越多, 相对误差也越小. 因此, 在计算过程中, 我们要保留尽量多的有效数字.

§ 0.3 数值计算中应注意的若干问题

我们用一些例子来说明数值计算中常遇到的一些应该注意的问题.

0.3.1 防止有效数字的损失

1. 相近两数相减有效数字会严重损失

【例 0.2】用中心差商公式

$$f'(x) \approx \frac{f(x+h) - f(x-h)}{2h}, \quad (0.3.1)$$

求 $f(x) = \sqrt{x}$ 在 $x=2$ 的导数近似值.

【解】 根据所给公式

$$\frac{d\sqrt{x}}{dx} \approx \frac{\sqrt{x+h} - \sqrt{x-h}}{2h}, \quad (0.3.2)$$

用 5 位字长的数字计算, 取 $h=0.1$ 得

$$\left. \frac{d\sqrt{x}}{dx} \right|_{x=2} \approx \frac{1.449\,1 - 1.378\,4}{0.2} = 0.353\,50,$$

与导数精确值 $\frac{1}{2\sqrt{2}} = 0.353\,553\dots$ 比较, 计算结果是可接受的. 然而, 若取 $h = 0.000\,1$, 则由

$$\left. \frac{d\sqrt{x}}{dx} \right|_{x=2} \approx \frac{1.414\,2 - 1.414\,2}{0.000\,2} = 0$$

算出的结果完全失真. 出现这种现象的原因是由于计算机上数的表示受机器字长的限制. 当 h 很小时, 发生两个值相近的数相减, 损失了有效数字, 甚至在计算机字长范围内, 有效数字损失殆尽. 为避免损失有效数字, 可将式 (0.3.2) 改写成

$$\frac{d\sqrt{x}}{dx} \approx \frac{1}{\sqrt{x+h} + \sqrt{x-h}},$$

用这个公式, 仍取 $h=0.000\,1$, 计算出的值为 $0.353\,56$. 显然, 这一结果有 4 位有效数字.

表达式 $\frac{\sqrt{x+h} - \sqrt{x-h}}{2h}$ 与 $\frac{1}{\sqrt{x+h} + \sqrt{x-h}}$ 从纯数学的角度, 两者完全等价,

没有任何差异. 造成上面计算效果的不同, 完全是由于数值计算中的舍入误差. 再分析 Taylor 公式

$$f'(x) = \frac{f(x+h) - f(x-h)}{2h} + \frac{h^2}{6} f'''(\xi), \quad x-h < \xi < x+h,$$

即用式 (0.3.1) 近似 $f'(x)$, 其截断误差为 $\frac{h^2}{6} f'''(\xi)$, 当 h 不太小时, 近似计算的误差主要取决于截断误差, 从理论上讲, h 越小, 截断误差也越小, 逼近程度应该越好. 之所以在上面出现与这个结论矛盾的结果, 是因为当 h 很小时, 截断误差将变得微乎其微. 对计算结果的影响占主导地位的就成为舍入误差, 而不是截断误差. 在一般的数值计算中, 截断误差与舍入误差之间常常处于这种矛盾之中, 要解决它们之间的这种矛盾, 通常的作法是, 在满足给定的截断误差范围内, 尽

量选取大的步长 h .

2. 大数可能“吃掉”小数而使有效数字损失

【例 0.3】 在计算机上求二次方程 $ax^2 + bx + c = 0$ 的根.

【解】 由求根公式, 得

$$x_1 = \frac{-b + \sqrt{b^2 - 4ac}}{2a}, \quad x_2 = \frac{-b - \sqrt{b^2 - 4ac}}{2a},$$

如果 $b^2 \gg |ac|$, 则 $\sqrt{b^2 - 4ac} \approx |b|$, 若用上面公式计算 x_1 和 x_2 , 其中之一将会损失有效数字. 出现大的误差. 原因就是由于在 $b^2 - 4ac$ 中, 大数 b^2 “吃掉了” 小数 $4ac$, 并且公式之一中出现两个值相近的数相减. 如果改用公式

$$x_1 = \frac{-b - \text{sign}(b) \sqrt{b^2 - 4ac}}{2a}, \quad x_2 = \frac{c}{ax_1}$$

就可以得到好的结果. 其中 $\text{sign}(b)$ 是 b 的符号函数.

出现大数吃小数的现象, 主要是参与计算的数之间数量级相差太大造成的. 在有些情形, 大数吃掉小数不会引起结果的太大变化, 如在计算 x_1 时, 这些情形允许大数吃掉小数. 但是, 在另一些情形则不允许. 为避免大数“吃掉” 小数, 一定要注意安排计算次序, 使计算始终在数量级相差不大的数之间进行.

0.3.2 减少计算次数

对于计算 n 次多项式 $P_n(x) = a_n x^n + \cdots + a_1 x + a_0$ 在某一点 x_0 的值 $P_n(x_0)$. 如果先计算 $x_0^2, x_0^3, \cdots, x_0^n$, 再作线性组合, 需要 $2n-1$ 次乘法和 n 次加法. 如果把它写成

$$P_n(x_0) = ((\cdots(a_n x_0 + a_{n-1})x_0 + a_{n-2})x_0 + \cdots + a_1)x_0 + a_0,$$

记 $s_n = a_n, s_k = s_{k+1}x_0 + a_k, k = n-1, n-2, \cdots, 1, 0$, 则只需要做 n 次乘法和 n 次加法就可计算出 $s_0 = P_n(x_0)$, 大大减少了计算次数. 这就是计算多项式的著名的秦九韶算法(即 Horner 算法).

【例 0.4】 利用 $\ln(1+x) = \sum_{n=1}^{\infty} (-1)^{n+1} \frac{x^n}{n}$ 计算 $\ln 2$, 要求精确到 10^{-5} .

【解】 如果直接计算, 这需要计算 10 万项求和, 才能达到精度要求, 不仅计算量很大, 而且舍入误差的积累也十分严重. 如果改用级数

$$\ln \frac{1+x}{1-x} = 2 \left(x + \frac{x^3}{3!} + \frac{x^5}{5!} + \cdots + \frac{x^{2n+1}}{(2n+1)!} + \cdots \right),$$

取 $x = \frac{1}{3}$, 只需计算前 9 项, 截断误差便小于 10^{-10} .

0.3.3 避免使用不稳定的数值方法

算法的数值稳定性是指: 若算法的执行结果与算法精确解之间的误差(它

是由舍入误差造成的)很大,就说该算法是数值不稳定的,否则是数值稳定的.

【例 0.5】 计算 $y_n = 10y_{n-1} - 1, n = 1, 2, \dots$, 并估计误差. 其中 $y_0 = \sqrt{3}$.

【解】 由于 $y_0 = \sqrt{3}$ 是无限不循环小数, 计算机只能截取其前有限位数, 这样得到 y_0 经机器舍入的近似值 $\tilde{y}_0$, 记 $\tilde{y}_n$ 为利用初值 $\tilde{y}_0$ 按所给公式计算的值, 并记 $e_n = y_n - \tilde{y}_n$, 则

$$y_n = 10^n y_0 - 10^{n-1} - 10^{n-2} - \dots - 1,$$

$$\tilde{y}_n = 10^n \tilde{y}_0 - 10^{n-1} - 10^{n-2} - \dots - 1,$$

$$e_n = y_n - \tilde{y}_n = 10^n (y_0 - \tilde{y}_0) = 10^n e_0.$$

这个结果表明, 当初始值存在误差 e_0 时, 经 n 次递推算后, 误差将扩大为 10^n 倍, 这说明计算是不稳定的. 这种不稳定现象在数值计算中经常会遇到, 特别是在微分方程的差分计算中. 因此, 我们在实际应用中要选择稳定的数值方法, 不稳定的数值方法是不能使用的.

在实际计算中, 对任何输入数据都是稳定的数值方法, 称为无条件稳定; 对某些数据稳定, 而对另一些数据不稳定的数值方法, 称为条件稳定.

【例 0.6】 求积分值 $I_n = \int_0^1 \frac{x^n}{x+5} dx, n = 0, 1, \dots, 8$.

【解】 由

$$I_n + 5I_{n-1} = \int_0^1 \frac{x^n + 5x^{n-1}}{x+5} dx = \int_0^1 x^{n-1} dx = \frac{1}{n},$$

可得两个递推算法

$$\text{算法 1:} \quad I_n = \frac{1}{n} - 5I_{n-1}, \quad n = 1, 2, \dots, 8;$$

$$\text{算法 2:} \quad I_{n-1} = \frac{1}{5} \left(\frac{1}{n} - I_n \right), \quad n = 8, 7, \dots, 1.$$

算法 1 的初始值

$$I_0 = \int_0^1 \frac{1}{x+5} dx = \ln(1.2) = 0.182\,321\,5\dots$$

算法 2 的初始值是

$$I_8 = \int_0^1 \frac{x^8}{x+5} dx = 0.018\,836\,92\dots$$

现在假设计算机的十进制尾数是 4 位, 即取十进制 4 位有效数字进行计算. 记算

法 1 的计算值为 $\tilde{I}_n^{(1)}$, 算法 2 的计算值为 $\tilde{I}_n^{(2)}$. 运算结果如表 0.1, 取 6 位有效数字. 易知, 对于任何自然数 n , 都有 $0 < I_n < 1$, 并且 I_n 单调减. 可见, 算法 1 是不稳定的, 算法 2 是稳定的.

表 0.1

n	$\tilde{I}_n^{(1)}$	$\tilde{I}_n^{(2)}$	$\tilde{I}_n$
0	0.182 3	0.182 3	0.182 322
1	0.088 50	0.088 39	0.088 392 2
2	0.057 50	0.058 04	0.058 038 9
3	0.045 83	0.043 14	0.043 138 7
4	0.020 85	0.034 31	0.034 306 3
5	0.095 75	0.028 47	0.028 468 4
6	-0.312 1	0.024 33	0.024 324 9
7	1.703	0.021 23	0.021 232 6
8	-8.392	0.018 84	0.018 836 9

习 题 零

1. 计算积分

$$E_n = \int_0^1 x^n e^{x-1} dx, \quad n=0, 1, 2, \dots, 10.$$

2. 利用 $\sqrt{783} \approx 27.982$ 计算方程 $x^2 - 56x + 1 = 0$ 的两个根.

3. 已知 $\sqrt{2} = 1.414\ 213\ 562\ 373 \dots$, 计算 $a = (\sqrt{2} - 1)^6$, 采用下列等式计算:

$$(1) \frac{1}{(\sqrt{2}+1)^6}; \quad (2) 99 - 70\sqrt{2}; \quad (3) (3 - 2\sqrt{2})^3; \quad (4) \frac{1}{(3 + 2\sqrt{2})^3}.$$

问哪一个方法得到的结果最好?

4. 利用等价变形的方法, 计算下列表达式, 使计算结果具有较高的精度.

$$(1) \ln(x - \sqrt{x^2 - 1}), x \gg 1; \quad (2) \ln(x+1) - \ln x, x \gg 1;$$

$$(3) \sqrt[3]{x+1} - \sqrt[3]{x}, x \gg 1; \quad (4) \frac{1 - \cos x}{x}, x \neq 0, |x| \ll 1;$$

$$(5) \sin x - \tan x, x \neq 0, |x| \ll 1; \quad (6) \arctan(x+1) - \arctan x, x \gg 1.$$

5. 设数 x 的近似数 x^* 有两位有效数字, 求其相对误差限.

6. 已知近似数的相对误差限为 0.3%, 问 x^* 至少有几位有效数字?

7. 为了使计算

$$y = 10 + \frac{3}{x-1} + \frac{4}{(x-1)^2} - \frac{6}{(x-1)^3}$$

的乘除法运算次数尽量地少, 应将表达式改写为怎样的形式?