

# 数值积分及其应用

华罗庚 王元

科学出版社

51.815  
235

# 数值积分及其应用

(“积分的近似计算”的修订本)

华罗庚 王元 著

31495/15

科学出版社

## 內 容 簡 介

本书分两部分,前一部分包括对古典的求积公式的重新处理;对实用調和分析的誤差及其应用的研究;对測量工作者常用的求容积与表面积的方法,作了数学加工与分析比較。第二部分为系統地总结近年来发展起来的用数論方法处理高維空間的数值积分的成果。这些理論目前已經达到了可以推广的阶段。不少实例說明了这些方法是极精密的。书中还談到了数論方法在数值計算的其他若干問題上的应用。

此书可供数学工作者及計算数学工作者之用,并可供地理、矿业及地质工作者参考。

## 数值积分及其应用

(“积分的近似計算”的修訂本)

华罗庚 王 元 著

科学出版社出版 (北京朝阳門大街 117 号)

北京市书刊出版业营业許可証出字第 061 号

中国科学院印刷厂印刷 新华书店总經售

1963 年 9 月第 一 版 书号: 2849 字数: 134,000  
1963 年 9 月第一次印刷 开本: 850×1168 1/32  
(京) 0001—5,000 印张: 5 1/4

定价: 0.90 元

## 序

我們的小冊子“積分的近似計算”，問世將近兩年了。近二年來，在數論方法用於多重積分的數值計算及其應用方面，有了較大的進展。此小冊子，由於是在這一分支剛開始發展時寫的，現在看來，無論從內容及其對一些問題的看法上，都有必要加以增訂。又由於這次添加了一些數值積分法的應用，所以將書名改為“數值積分及其應用”。

這本書的寫作開始於1958年，當時作者們在中國科學技術大學聯合執教微積分課。本書的前一部分就是為了教學的需要而寫的。有些想法雖然起源頗早，但一直到這次教課時才一同把它們整理了出來（見[1]）。又由於需要找一些計算面積、容積（或體積）與表面積的實用方法，作者曾向地理、礦業與地質工作者們請教了他們常用的方法，並對這些方法作了數學的加工和檢定，使之能夠作為數學課程的教材。

數論方法在數值計算上的應用的研究，開始於1957年，由於作者一直是非常重視數論方法的實際應用，所以對這方面的總結與整理就構成了書的後一部分。

用古典的矩形公式來計算某些函數族上的函數的數值積分時，誤差依賴於積分的重數。詳細言之，固定分點的個數，則當積分的重數增加時，誤差亦隨之而迅速增大，或者可以說，當要求數值積分有一定的精確度時，則分點的數目必須隨着積分重數的增加而迅速增加。因此，用這一方法來處理高維空間的數值積分時，由於計算量十分巨大，是難於實現的。

近年來所發展起來的 Monte Carlo 方法是常用的計算多重積分的方法。用這種方法來計算數值積分，首先就是對被積函數進行一系列的隨機抽樣，然後取平均值，用它來計算積分。這種方法

的优点在于在机器上运算的手續簡便。收斂的速度虽然比矩形方法快些,但是由这一方法所能得到的只能是概率的誤差,而不是真正的誤差。

数論方法处理多重积分的近似計算的理論基础在于数論中的一致分布理論,即按照事先选定的最佳分布上的函数值所构成的单和来逼近多重积分,因而得到的誤差不再是概率的,而是肯定的。不仅如此,这些肯定的誤差竟比概率誤差还要精密,并且可以証明,对于某些函数族来說,这种逼近的誤差的主阶已經臻于至善了。不少数論中的著名原理与方法都能有效地用于这一問題,例如三角和的估值、丢番图逼近論以及連分数論等等。在本书中,我們介紹了 van der Corput, Hammersley 与 Halton 等人所发展起来的利用  $r$  进位小数来构造最佳一致分布点列的方法,及 Коробов 与 Бахвалов 等人所发展起来的所謂“极值系数法”。在书末还附了一个可供实际应用的“极值系数表”。在这一部分里也包括了作者的一些工作,例如二重积分的計算方法及极值系数法在插入法方面的应用等等。此外,在处理某些已有的結果的时候,也参加了我們自己的看法或簡化了証明。

在計算調和分析或用迭代法求解积分方程时,实际上就是将問題归結为一系列积分的計算問題。如果給了有限多个数据,用数值积分法来計算,要注意計算的項数需要恰到好处,有时項数計算多了,不仅浪費,反而会导致不精確的結果。又有一些偏微分方程,在某些条件下,也能将解答写成一个积分,本书将举例說明,有时用数值积分法来处理是不妥当的;而从这有限多个边界值出发,通过有限的方法(指数論与代数方法)直接求出解的近似值来,反而能导致精確的結果。书中提供了两个最簡單的例子来闡明这一点,可以供作这方面进一步探討的参考。

因此,本书仅仅对数值积分及其应用的若干問題作一些討論,并未企图对数值計算作較全面的介紹。特別應該指出的是我国学者的貢獻,例如赵訪熊关于近似求解代数方程的工作,閔嗣鶴、徐利治<sup>[2]</sup>关于数值积分的工作,还有关肇直<sup>[3]</sup>、卢文等把泛函分析用

到数值計算方面的工作等等。

我們衷心地感謝我国的地理、矿业与地質工作者，他們热情地幫助我們学会了一些实际应用的求面积、容积与表面积的方法。还有木材厂的老工人，他們为我們提供了木材利用率的例子。在小册子初版問世后，一直不断地收到讀者們的宝贵意見，特别是何祚庥同志，还为本书写了书评<sup>[4]</sup>。再版的手稿，承蒙中国科学院計算技术研究所第三室的有关同志看过，并提出了很好的意見，对我們很有帮助。

最后，作者十分殷切地期望这本小册子再次問世后能得到更多的批評与帮助。

華罗庚 王 元

1963年5月15日于北京

# 目 录

序 .....	iii
§ 1. Euler 求和公式及 Euler 函数 .....	1
§ 2. 梯形法、矩形法与 Simpson 法 .....	5
§ 3. 求曲线的长度 .....	17
§ 4. 求面积 .....	22
§ 5. 求容积 .....	26
§ 6. 求表面积 .....	38
§ 7. Euler 函数及 Euler 公式的进一步精密化 .....	47
§ 8. 实用调和分析——有限调和分析 .....	53
§ 9. Laplace 方程的 Dirichlet 问题 .....	60
§ 10. 热传导方程 .....	68
§ 11. 一致分布 .....	71
§ 12. 做出高度均匀分布的数列——Halton 定理 .....	78
§ 13. 函数族 $H_r(q, \lambda, C)$ 上的求积公式的 $Q$ -结果 .....	86
§ 14. 周期函数的积分 .....	89
§ 15. 一个求积公式 .....	94
§ 16. Коробов 定理 .....	97
§ 17. 函数族 $E_r^a(C)$ 上的求积公式的 $Q$ -结果 .....	103
§ 18. 存在定理之另证 .....	106
§ 19. 二重积分 .....	110
§ 20. 求积公式与同余式的解 .....	113
§ 21. 极值系数 .....	118
§ 22. Бахвалов 定理 .....	125
§ 23. 重积分与单积分 .....	131
§ 24. 函数族 $E_r^a(C)$ 上的插值公式 .....	133

§ 25. Fredholm 型积分方程的渐近解法 .....	143
§ 26. Volterra 型积分方程的渐近解法 .....	148
附录 极值系数表 (I) — (XII) .....	152
参考文献 .....	158

## § 1. Euler 求和公式及 Euler 函数

**定理 1 (Euler).** 命  $\varphi(x)$  是有限閉区間  $[a, b]$  內有連續微商的函数, 則

$$\sum_{a < n \leq b} \varphi(n) = \int_a^b \varphi(x) dx + \int_a^b \left( x - [x] - \frac{1}{2} \right) \varphi'(x) dx + \left( a - [a] - \frac{1}{2} \right) \varphi(a) - \left( b - [b] - \frac{1}{2} \right) \varphi(b),$$

此处  $[x]$  代表实数  $x$  的整数部分.

証. 1) 如果  $[a] + 1 > [b]$ , 則  $[a] = [b]$ , 这公式变为

$$0 = \int_a^b \varphi(x) dx + \int_a^b \left( x - [a] - \frac{1}{2} \right) \varphi'(x) dx + \left( a - [a] - \frac{1}{2} \right) \varphi(a) - \left( b - [a] - \frac{1}{2} \right) \varphi(b),$$

即

$$\int_a^b \left( x - [a] - \frac{1}{2} \right) \varphi'(x) dx = - \left( a - [a] - \frac{1}{2} \right) \varphi(a) + \left( b - [a] - \frac{1}{2} \right) \varphi(b) - \int_a^b \varphi(x) dx.$$

这就是部分积分公式的直接推理.

2) 假定  $[a] + 1 \leq [b]$ , 則

$$\begin{aligned} \int_a^b [x] \varphi'(x) dx &= \int_{[a]+1}^{[b]} [x] \varphi'(x) dx + \int_a^{[a]+1} [x] \varphi'(x) dx + \\ &\quad + \int_{[b]}^b [x] \varphi'(x) dx = \\ &= \sum_{n=[a]+1}^{[b]-1} n \int_n^{n+1} \varphi'(x) dx + \int_a^{[a]+1} [a] \varphi'(x) dx + \int_{[b]}^b [b] \varphi'(x) dx = \\ &= \sum_{n=[a]+1}^{[b]-1} n (\varphi(n+1) - \varphi(n)) + [a] (\varphi([a]+1) - \varphi(a)) + \end{aligned}$$

$$\begin{aligned}
 & + [b](\varphi(b) - \varphi([b])) = \\
 & = - \sum_{n=[a]+1}^{[b]} \varphi(n) - [a]\varphi(a) + [b]\varphi(b).
 \end{aligned}$$

又由部分积分可知

$$\begin{aligned}
 \int_a^b \left(x - \frac{1}{2}\right) \varphi'(x) dx & = \left(b - \frac{1}{2}\right) \varphi(b) - \left(a - \frac{1}{2}\right) \varphi(a) - \\
 & - \int_a^b \varphi(x) dx,
 \end{aligned}$$

因此

$$\begin{aligned}
 \int_a^b \left(x - [x] - \frac{1}{2}\right) \varphi'(x) dx & = \sum_{n=[a]+1}^{[b]} \varphi(n) - \int_a^b \varphi(x) dx - \\
 & - \left(a - [a] - \frac{1}{2}\right) \varphi(a) + \left(b - [b] - \frac{1}{2}\right) \varphi(b),
 \end{aligned}$$

即明所欲証。

我們現在用 Euler 求和公式来研究, 当  $n$  充分大时,  $n!$  的漸近情况。

1) 命  $\varphi(x) = \log x$ ,  $a = 1$ ,  $b = n$  (整数), 則得

$$\begin{aligned}
 \sum_{1 < m \leq n} \log m & = \int_1^n \log x dx + \int_1^n \left(x - [x] - \frac{1}{2}\right) \frac{dx}{x} + \\
 & + \frac{1}{2} \log n. \tag{1}
 \end{aligned}$$

由于

$$\left| x - [x] - \frac{1}{2} \right| \leq \frac{1}{2}$$

及

$$\int_{\xi}^{\xi+1} \left(x - [x] - \frac{1}{2}\right) dx = 0 \quad (\xi \text{ 为实数}),$$

故由第二中值公式可知积分

$$\int_1^{\infty} \left(x - [x] - \frac{1}{2}\right) \frac{dx}{x}$$

收敛, 因此由(1)可知

$$\log n! = \left(n + \frac{1}{2}\right) \log n - n + C + \gamma_n,$$

此处

$$C = 1 + \int_1^{\infty} \left( x - [x] - \frac{1}{2} \right) \frac{dx}{x},$$
$$\gamma_n = - \int_n^{\infty} \left( x - [x] - \frac{1}{2} \right) \frac{dx}{x},$$

所以

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{n!}{e^{-n} n^{n+1/2}} = e^C = C_1. \quad (2)$$

我們称公式(2)为 Stirling 公式.

2) 現在我們来进一步定出  $C_1$ . 由 Wallis 公式

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{2 \cdot 2 \cdot 4 \cdot 4 \cdots (2n) \cdot (2n)}{1 \cdot 3 \cdot 3 \cdot 5 \cdot 5 \cdots (2n-1) \cdot (2n+1)} = \frac{\pi}{2}$$

可知

$$\frac{(2^n n!)^4}{(2n)!^2 (2n+1)} (1 + o(1)) = \frac{\pi}{2}.$$

以(2)式代入得

$$\frac{C_1^4 (2^n n^{n+1/2} e^{-n})^4}{C_1^2 ((2n)^{2n+1/2} e^{-2n})^2 (2n+1)} (1 + o(1)) = \frac{\pi}{2},$$
$$\frac{C_1^2 n}{2(2n+1)} (1 + o(1)) = \frac{\pi}{2}.$$

命  $n \rightarrow \infty$  得

$$C_1 = \sqrt{2\pi}.$$

同时我們也算出了

$$\int_1^{\infty} \left( x - [x] - \frac{1}{2} \right) \frac{dx}{x} = \frac{1}{2} \log 2\pi - 1.$$

因为經常用到, 我們引进符号

$$b_l(x) = x - [x] - \frac{1}{2}$$

并且用归纳法来定义 Euler 函数  $b_l$  ( $l = 1, 2, \dots$ ).

**定义.** (i)  $b_l(x)$  是以 1 为周期的函数, 也就是

$$b_l(x+1) = b_l(x).$$

$$(ii) \int_0^x b_l(y) dy = b_{l+1}(x) - b_{l+1}(0).$$

由周期性显然得出

$$\int_0^1 b_l(y) dy = 0.$$

我們得先說明一下，这样，函数  $b_l(x)$  就完全定义了。由 (ii) 可知如果  $b_l(x)$  完全定义了， $b_{l+1}(x)$  仅差一常数，也就完全定义了。这一常数可由  $b_{l+2}(x)$  的周期性来决定。

我們現在算出前几个  $b_l(x)$  来。周期既然是 1，我們不妨假定  $0 < x < 1$ ，由

$$b_2(x) - b_2(0) = \int_0^x \left( t - \frac{1}{2} \right) dt = \frac{x^2}{2} - \frac{x}{2},$$

即

$$b_2(x) = \frac{x^2}{2} - \frac{x}{2} + b_2(0).$$

由

$$0 = \int_0^1 b_2(x) dx = \frac{x^3}{6} - \frac{x^2}{4} + b_2(0)x \Big|_0^1 = -\frac{1}{12} + b_2(0),$$

即当  $0 < x < 1$  时

$$b_2(x) = \frac{x^2}{2} - \frac{x}{2} + \frac{1}{12}.$$

由于  $b_2(x)$  的周期性，可一般地有

$$b_2(x) = \frac{(x - [x])^2}{2} - \frac{x - [x]}{2} + \frac{1}{12}.$$

同法可以推得

$$b_3(x) = \frac{1}{6}(x - [x])^3 - \frac{1}{4}(x - [x])^2 + \frac{1}{12}(x - [x]),$$

$$b_4(x) = \frac{1}{24}(x - [x])^4 - \frac{1}{12}(x - [x])^3 + \frac{1}{24}(x - [x])^2 - \frac{1}{720}.$$

讀者可以再算一两个例子以資熟練。

## § 2. 梯形法、矩形法与 Simpson 法

假定  $f(x)$  是一个在  $[\alpha, \beta]$  内定义的函数, 以后如果用到几次微商, 便假定  $f(x)$  有几次微商. 我们用 Euler 求和公式来推出普通数值积分的梯形法、矩形法与 Simpson 法.

### 1. 梯形法

在 Euler 求和公式中取

$$\varphi(x) = f\left(\alpha + x \frac{\beta - \alpha}{n}\right), \quad a = 0, \quad b = n \quad (n \text{ 是自然数}).$$

記

$$y_l = f\left(\alpha + l \frac{\beta - \alpha}{n}\right),$$

如此則得

$$\begin{aligned} \sum_{0 < l < n} f\left(\alpha + l \frac{\beta - \alpha}{n}\right) &= \int_0^n f\left(\alpha + x \frac{\beta - \alpha}{n}\right) dx + \frac{1}{2} f(\beta) - \\ &- \frac{1}{2} f(\alpha) + \frac{\beta - \alpha}{n} \int_0^n \left(x - [x] - \frac{1}{2}\right) f'\left(\alpha + x \frac{\beta - \alpha}{n}\right) dx. \end{aligned}$$

換变数  $\alpha + x \frac{\beta - \alpha}{n} = t$ , 則得

$$\begin{aligned} \sum_{l=1}^{n-1} y_l + \frac{1}{2}(y_0 + y_n) &= \frac{n}{\beta - \alpha} \int_a^\beta f(t) dt + \\ &+ \frac{\beta - \alpha}{n} \int_0^n b_1(x) f'\left(\alpha + x \frac{\beta - \alpha}{n}\right) dx, \end{aligned}$$

也就是

$$\begin{aligned} \int_a^\beta f(t) dt - \frac{\beta - \alpha}{n} \left( \sum_{l=1}^{n-1} y_l + \frac{1}{2}(y_0 + y_n) \right) &= \\ = - \left( \frac{\beta - \alpha}{n} \right)^2 \int_0^n b_1(x) f'\left(\alpha + x \frac{\beta - \alpha}{n}\right) dx. \quad (1) \end{aligned}$$

这个式子說明，求积分的梯形法的誤差是可以积分形式表出来的。現在把誤差表达得更清楚些。用部分积分可知

$$\begin{aligned}
 & \int_0^n b_1(x) f' \left( \alpha + x \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx = b_2(x) f' \left( \alpha + x \frac{\beta - \alpha}{n} \right) \Big|_0^n - \\
 & \quad - \frac{\beta - \alpha}{n} \int_0^n b_2(x) f'' \left( \alpha + x \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx = \\
 & = \frac{1}{12} (f'(\beta) - f'(\alpha)) - \frac{\beta - \alpha}{n} \int_0^n b_2(x) f'' \left( \alpha + x \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx = \\
 & = \frac{1}{12} \frac{\beta - \alpha}{n} \int_0^n f'' \left( \alpha + x \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx - \\
 & \quad - \frac{\beta - \alpha}{n} \int_0^n b_2(x) f'' \left( \alpha + x \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx = \\
 & = - \frac{\beta - \alpha}{n} \int_0^n \left( b_2(x) - \frac{1}{12} \right) f'' \left( \alpha + x \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx,
 \end{aligned}$$

因此得出

$$\begin{aligned}
 & \int_a^\beta f(x) dx - \frac{\beta - \alpha}{n} \left( \sum_{i=1}^{n-1} y_i + \frac{1}{2} (y_0 + y_n) \right) = \\
 & = \left( \frac{\beta - \alpha}{n} \right)^3 \int_0^n \left( b_2(x) - \frac{1}{12} \right) f'' \left( \alpha + x \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx. \quad (2)
 \end{aligned}$$

梯形法余項(1)須假定  $f(x)$  有一次微商, 而(2)假定了  $f(x)$  有二次微商; 梯形法余項我們用

$$R_t = \int_a^\beta f(x) dx - \frac{\beta - \alpha}{n} \left( \sum_{i=1}^{n-1} y_i + \frac{1}{2} (y_0 + y_n) \right)$$

来表它。

**定理 1.** 如果  $|f''(x)| \leq M$  ( $\alpha \leq x \leq \beta$ ), 則

$$|R_t| \leq \frac{(\beta - \alpha)^3 M}{12n^2}.$$

証. 由(2)可知

$$\begin{aligned}
 |R_t| & \leq \left( \frac{\beta - \alpha}{n} \right)^3 \int_0^n \left| b_2(x) - \frac{1}{12} \right| \left| f'' \left( \alpha + x \frac{\beta - \alpha}{n} \right) \right| dx \leq \\
 & \leq \left( \frac{\beta - \alpha}{n} \right)^3 M \int_0^n \left| b_2(x) - \frac{1}{12} \right| dx =
 \end{aligned}$$

$$= \frac{(\beta - \alpha)^3}{n^2} M \int_0^1 \left( \frac{x}{2} - \frac{x^2}{2} \right) dx = \frac{(\beta - \alpha)^3 M}{12n^2}.$$

**定理 2.** 如果  $f'(x)$  是單調遞減非負函數，則

$$|R_i| \leq \frac{(\beta - \alpha)^2}{8n^2} f'(a).$$

証. 由 (1) 及第二中值公式可知

$$\begin{aligned} |R_i| &= \left| \left( \frac{\beta - \alpha}{n} \right)^2 \int_0^n b_1(x) f' \left( \alpha + x \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx \right| = \\ &= \left( \frac{\beta - \alpha}{n} \right)^2 f'(a) \left| \int_0^\xi b_1(x) dx \right|. \end{aligned}$$

由

$$\left| \int_0^\xi b_1(x) dx \right| \leq \frac{1}{8}$$

可得定理.

如果積分的區間較長，這估計比以前的好些。

## 2. 矩形法

取

$$\varphi(x) = f \left( \alpha + \left( x + \frac{1}{2} \right) \frac{\beta - \alpha}{n} \right),$$

$$a = -\frac{1}{2}, \quad b = n - \frac{1}{2},$$

并記

$$y_{l+\frac{1}{2}} = f \left( \alpha + \left( l + \frac{1}{2} \right) \frac{\beta - \alpha}{n} \right),$$

則得

$$\begin{aligned} \sum_{-\frac{1}{2} < l < n - \frac{1}{2}} f \left( \alpha + \left( l + \frac{1}{2} \right) \frac{\beta - \alpha}{n} \right) &= \\ &= \int_{-\frac{1}{2}}^{n - \frac{1}{2}} f \left( \alpha + \left( x + \frac{1}{2} \right) \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx + \\ &+ \frac{\beta - \alpha}{n} \int_{-\frac{1}{2}}^{n - \frac{1}{2}} b_1(x) f' \left( \alpha + \left( x + \frac{1}{2} \right) \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx. \end{aligned}$$

換變數

$$\alpha + \left(x + \frac{1}{2}\right) \frac{\beta - \alpha}{n} = t,$$

則得

$$\begin{aligned} \sum_{l=0}^{n-1} y_{l+\frac{1}{2}} &= \frac{n}{\beta - \alpha} \int_a^\beta f(t) dt + \frac{\beta - \alpha}{n} \int_{-\frac{1}{2}}^{n-\frac{1}{2}} b_1(x) \times \\ &\times f' \left( \alpha + \left(x + \frac{1}{2}\right) \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx. \end{aligned}$$

命

$$R_r = \int_a^\beta f(t) dt - \frac{\beta - \alpha}{n} \sum_{l=0}^{n-1} y_{l+\frac{1}{2}}$$

代表矩形法的余項, 則

$$R_r = - \left( \frac{\beta - \alpha}{n} \right)^2 \int_{-\frac{1}{2}}^{n-\frac{1}{2}} b_1(x) f' \left( \alpha + \left(x + \frac{1}{2}\right) \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx. \quad (3)$$

部分積分得

$$\begin{aligned} &\int_{-\frac{1}{2}}^{n-\frac{1}{2}} b_1(x) f' \left( \alpha + \left(x + \frac{1}{2}\right) \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx = \\ &= b_2(x) f' \left( \alpha + \left(x + \frac{1}{2}\right) \frac{\beta - \alpha}{n} \right) \Big|_{-\frac{1}{2}}^{n-\frac{1}{2}} - \\ &\quad - \frac{\beta - \alpha}{n} \int_{-\frac{1}{2}}^{n-\frac{1}{2}} b_2(x) f'' \left( \alpha + \left(x + \frac{1}{2}\right) \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx = \\ &= - \frac{1}{24} (f'(\beta) - f'(\alpha)) - \frac{\beta - \alpha}{n} \int_{-\frac{1}{2}}^{n-\frac{1}{2}} b_2(x) \times \\ &\quad \times f'' \left( \alpha + \left(x + \frac{1}{2}\right) \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx = \\ &= - \frac{\beta - \alpha}{n} \int_{-\frac{1}{2}}^{n-\frac{1}{2}} \left( b_2(x) + \frac{1}{24} \right) f'' \left( \alpha + \left(x + \frac{1}{2}\right) \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx, \end{aligned}$$

即

$$\begin{aligned} R_r &= \left( \frac{\beta - \alpha}{n} \right)^3 \int_{-\frac{1}{2}}^{n-\frac{1}{2}} \left( b_2(x) + \frac{1}{24} \right) \times \\ &\quad \times f'' \left( \alpha + \left(x + \frac{1}{2}\right) \frac{\beta - \alpha}{n} \right) dx. \quad (4) \end{aligned}$$

**定理 3.** 如果  $|f''(x)| \leq M$  ( $a \leq x \leq \beta$ ), 則

$$|R_r| \leq \frac{(\beta - \alpha)^3 M}{24n^2}.$$

証. 由 (4) 可知

$$\begin{aligned} |R_r| &\leq \left(\frac{\beta - \alpha}{n}\right)^3 M \int_{-\frac{1}{3}}^{n-\frac{1}{3}} \left| b_2(x) + \frac{1}{24} \right| dx \leq \\ &\leq \left(\frac{\beta - \alpha}{n}\right)^3 M n \int_0^1 \left| b_2(x) + \frac{1}{24} \right| dx = \\ &= \frac{(\beta - \alpha)^3}{n^2} M \int_0^1 \left( \frac{x^2}{2} - \frac{x}{2} + \frac{1}{8} \right) dx = \\ &= \frac{(\beta - \alpha)^3}{24n^2} M. \end{aligned}$$

**定理 4.** 如果  $f'(x)$  是單調遞減非負函數, 則

$$|R_r| \leq \frac{(\beta - \alpha)^2 f'(a)}{8n^2}.$$

証. 于 (3) 上用第二中值公式可知

$$\begin{aligned} |R_r| &= \frac{(\beta - \alpha)^2 f'(a)}{n^2} \left| \int_{-\frac{1}{3}}^{\epsilon} b_1(x) dx \right| \leq \\ &\leq \frac{(\beta - \alpha)^2 f'(a)}{8n^2}. \end{aligned}$$

### 3. Simpson 法

命

$$R_s = \frac{1}{3} R_i + \frac{2}{3} R_r,$$

則得

$$R_s = \int_a^\beta f(t) dt - \frac{\beta - \alpha}{6n} \left( y_0 + y_n + 2 \sum_{i=1}^{n-1} y_i + 4 \sum_{i=0}^{n-1} y_{i+\frac{1}{2}} \right),$$

而且 Simpson 公式的余項 [由 (2) 与 (4)] 为

$$R_s = \left(\frac{\beta - \alpha}{n}\right)^3 \int_0^1 \left( \frac{b_2(x)}{3} - \frac{1}{36} + \frac{2b_2(x - \frac{1}{2})}{3} + \frac{1}{36} \right) \times$$