



MATLAB

与科学计算 (第3版)

王沫然 编著



电子工业出版社
PUBLISHING HOUSE OF ELECTRONICS INDUSTRY
<http://www.phei.com.cn>

MATLAB工程应用丛书

MATLAB

与科学计算

(第3版)

王沫然 编著

电子工业出版社
Publishing House of Electronics Industry
北京•BEIJING

内 容 简 介

本书从高校数学课程的教学出发，结合了科学的研究和工程计算的实际，系统详细地介绍了MATLAB语言的强大功能及其在科学计算领域中的应用。本书前两版出版之后受到了广大读者的一致好评，应热心读者的要求，第3版完善了数据可视化、统计优化以及建模仿真等内容，增加了例题，以适应各层次读者的不同需求。

本书可用来作为MATLAB教学用书或高等数学、线性代数、计算方法、复变函数、概率统计、数学规划、偏微分方程解法以及动态仿真等课程的教学辅导书，也可作为科研人员及工程计算人员学习和使用MATLAB的工具书。

未经许可，不得以任何方式复制或抄袭本书之部分或全部内容。

版权所有，侵权必究。

图书在版编目（CIP）数据

MATLAB与科学计算 / 王沫然编著. — 3版. —北京：电子工业出版社，2012.10

（MATLAB工程应用丛书）

ISBN 978-7-121-18052-1

I . ①M… II . ①王… III . ①Matlab软件—高等学校—教材 IV . ①TP317

中国版本图书馆CIP数据核字（2012）第201351号

责任编辑：张月萍

责任编辑：付 睿

印 刷：

装 订：北京中新伟业印刷有限公司

出版发行：电子工业出版社

北京市海淀区万寿路173信箱 邮编：100036

开 本：787×1092 1/16 印张：26.75 字数：685千字

印 次：2012年10月第1次印刷

印 数：4000册 定价：49.80元

凡所购买电子工业出版社图书有缺损问题，请向购买书店调换。若书店售缺，请与本社发行部联系，联系及邮购电话：（010）88254888。

质量投诉请发邮件至zlt@phei.com.cn，盗版侵权举报请发邮件至dbqq@phei.com.cn。

服务热线：（010）88258888。

前　　言

1. 编写目的

自 MATLAB 4.0 问世以来, MATLAB 语言就成为了最具吸引力、应用最为广泛的科学计算语言, 2001 年和 2002 年 Mathworks 公司相继推出了强大的 MATLAB 升级版本 MATLAB 6.0 和 MATLAB 6.5, 使其在符号运算和图形处理功能上进一步完善。如今, MATLAB 已成为集数值计算功能、符号运算功能和图形处理功能为一身的超级科学计算语言, 可以说 MATLAB 语言是真正的 21 世纪的科学计算语言。除此之外, 新版本的 MATLAB 还增强了它的应用工具箱, 使 MATLAB 的应用面越来越广, 功能也越来越强大。

在国外, MATLAB 不仅大量走入企业、各大公司和科研机构, 而且在高等院校中, MATLAB 也成为大学生们必不可少的计算工具, 甚至是本科生到博士生都必须掌握的一项基本技能。在我国, MATLAB 之风已在各大高等院校悄然兴起, 越来越多的人开始关注和使用 MATLAB, 许多专业已把 MATLAB 作为基本计算工具。针对这种情况, 作者旨在全面地介绍 MATLAB 的主要功能——科学计算及其可视化, 以及它在计算方法、复变函数、概率统计、优化处理和偏微分方程求解等领域中的应用, 使 MATLAB 真正成为不同专业的学生及科研、工程技术人员所普遍认可的科学计算工具。

鉴于如上原因, 笔者很久以来就一直致力于 MATLAB 的推广工作, 而且曾于 1999 年编写过一本《MATLAB 5.x 与科学计算》, 获得了广大读者的好评。但由于当时出版条件有限, 对 MATLAB 的基本功能介绍还显不足, 很多热心的读者也曾经通过电子邮件询问过此类问题, 并希望在新的版本中看到更详尽的介绍。2001 年, 在电子工业出版社的帮助下, 配合 MATLAB 6.0 软件的产生, 又推出了《MATLAB 6.0 与科学计算》一书, 该书应读者的要求, 补充了 MATLAB 基本功能的系统介绍, 同时继承了原书的实用性风格, 一经出版就获得了广大读者的一致好评, 很多大学、研究所和企业还将此书作为 MATLAB 的教材和科学计算的辅助教材。2003 年, 应读者需求在原书的基础上增加了动画实现、程序接口以及 Simulink 建模等内容, 实现了对 MATLAB 全功能的系统介绍。2004 年以后, Mathworks 公司每半年推出 MATLAB 的更新版本。如今, 在《MATLAB 与科学计算》(第

1 版)出版后的十多年时间里,笔者总结了来自热心读者的好的建议,并将在新版图书中有所体现,希望能给读者一个满意的答复。

2. 内容框架

本书基于 MATLAB 的最新版本,全面系统地介绍了它的数值计算、符号运算和图形处理等功能,让读者对 MATLAB 的强大功能有基本了解,同时深入科学计算内部,较为详尽地讲述了 MATLAB 在计算方法、复变函数、概率统计、最优化问题、偏微分方程解法以及动态仿真等领域中的应用。

全书按内容共分 12 章。

第 1 章 安装及使用前的准备 主要介绍 MATLAB 的概况、桌面平台、帮助系统及其搜索路径与扩展,使读者在使用 MATLAB 之前对使用环境有个整体的认识。

第 2 章 数值计算功能 包括 MATLAB 的数据类型、向量及其运算、矩阵及其运算、数组及其运算和多项式运算等几部分内容。

第 3 章 符号运算功能 将向读者全面介绍 MATLAB 的符号运算功能,主要包括符号表达式和符号矩阵的建立及其基本运算、符号微积分、符号代数方程求解以及符号微分方程求解。此外,还介绍了一种使用方便的“图示化函数计算器”。

第 4 章 图形处理功能 将介绍图形处理的基本功能及高级功能,包括二维、三维甚至四维图形的绘制、图形处理的基本和高级技术、图形窗口的控制、句柄图形、图形用户界面(GUI)的处理方法以及动画显示的方法。

第 5 章 程序设计 将向读者介绍 MATLAB 语言的开放性程序设计,读者可依其简单的规则编制属于自己的程序函数库。

第 6 章 应用程序接口 主要介绍使用 MATLAB 在科学计算应用中与 FORTRAN 及 C 等高级语言接口的问题,并增加创建独立应用程序的内容。

第 7 章 MATLAB 在计算方法中的应用 结合大学的计算方法课程,详尽地讲解 MATLAB 在插值与拟合、微积分、线性方程组解法、非线性方程组解法、特征值问题及常微分方程解法等方面的应用,且给出众多例子和例程。

第 8 章 MATLAB 在复变函数中的应用 着重介绍利用 MATLAB 内部功能函数来解决复数领域中的一些问题,如复数的基本运算、复矩阵的各种函数运算、留数的计算及解析函数的 Taylor 展开。另外,还延伸讲了一些可能用到的 Laplace 变换、Fourier 变换等重要运算。

第 9 章 MATLAB 在概率统计中的应用 将为那些苦于实验数据处理统计的人打开方便之门。本章介绍如何用 MATLAB 处理诸如数学期望值、方差、协方差、相关系数、参数估计、置信区间计算、假设检验、方差分析及回归诊断等问题,还介绍了统计图方面的内容。

第 10 章 MATLAB 在运筹优化问题中的应用 将介绍一个热门和实用的问题——最优



化问题。主要介绍以下处理问题的方法：线性优化、二次优化、非线性无约束优化与约束优化、最小二乘优化等，有很大的现实意义。

第 11 章 MATLAB 在偏微分方程解法中的应用 将对力学、热传导和波形传递等问题中的偏微分方程在 MATLAB 中的求解方法做简单介绍，使读者对这些基本问题可以很快地掌握其解决方法，为更深入的研究打下基础。

第 12 章 MATLAB 在建模仿真中的应用 主要对 Simulink 的使用方法、程序设计以及一些高级应用知识进行系统的介绍。

3. 本书的特点

- 内容系统、全面

本书对最新版的 MATLAB 的科学计算功能做了详尽的介绍，这在国内外出版物中还不多见。且本书没有局限于对 MATLAB 命令的简单介绍，而是结合不同层次的高校教学中的数学课程，做到有的放矢，适应面广。

- 紧密结合理论、算法语言及 MATLAB 实现

介绍理论、算法并非本书的目的，然而在一些问题上只有紧密结合三者才能使读者对 MATLAB 有更全面、准确的认识。

- 算例多、应用性强

本书提供了众多的算例，特别是在第 7 章以后，许多算例是来自各大学教材及讲义的习题或作业，因此对各层次的学生来说，适用性和实用性更强。

- 基于 MATLAB 最新版，对主要命令各版本兼顾

笔者是从 MATLAB 4.0 开始使用 MATLAB 的，因此，对不同版本的主要命令比较熟悉。在本书写作中，尽可能多地标注出不同版本之间的异同之处，以供各种版本的用户使用。

- 命令查询方便

本书还提供了主要函数命令的索引和注释，是学习 MATLAB 的好帮手。

4. 致谢

笔者自学会使用 MATLAB 之日起，就一直致力于 MATLAB 在中国的推广工作。后经几位老师指导，终于可在数学上初窥门径。能够写成此书，需要感谢数学分析、数值分析、线性代数、统计学、运筹学、计算机仿真学以及大规模数学优化等课程老师的教导。特别感谢清华大学的李志信、梁新刚、顾丽珍、白峰杉、高策里、李海中等几位教授和所有支持此书编写的老师。

能够完成此书，离不开我的父母、岳父母以及妻儿给我的支持和鼓励，在此向他们表示感谢；也希望最新版的出版能够告慰父亲的在天之灵。

笔者要特别感谢电子工业出版社计算机图书分社社长郭立编辑，正是她在 2001 年敏

锐的挖掘和发现，才使这本书能够以崭新的面貌展现给读者；感谢张立红编辑对本书前两版的精心雕琢，感谢张月萍编辑对最新版图书的辛勤组织和润色。没有三位编辑的大力帮助，很难让我在繁忙的科研教学之余完成这样一个严肃而艰巨的任务。

最后还要衷心感谢关心和喜欢本书的可爱读者们！热爱 MATLAB 是我撰写这样一本教材工具书的初动力，而读者的欣赏、支持和鼓励则是我坚持不断完善该书的持久推动力。当我远渡重洋在美国多次遇到同学、同事打开行李箱拿出仅有的一本或有限的几本参考书中由我所编写的这本书时，当我看到他们偶然发现他们珍藏的参考书的作者就在眼前那种惊诧的眼神时，我清晰地感觉到我内心深处不仅仅有成就感，更多的可能还是责任感和那份沉甸甸。更让我欣喜的是读者来信，让我从抱怨和批评中得到灵感，从赞扬和感谢中获取坚持。

本书旨在推广 MATLAB 语言，倘若读者能从本书中有所裨益的话，实属笔者之幸。由于水平有限，错误及不当之处在所难免，恳请读者指正。

作者 王沫然
(moral@tsinghua.org.cn) 于清华园

目 录

第 1 章 安装及使用前的准备	1
1.1 MATLAB 简介	1
1.1.1 21 世纪的科学计算语言	1
1.1.2 MATLAB 的发展历史	3
1.1.3 MATLAB 的应用和网上资源	4
1.2 MATLAB 的桌面平台	5
1.2.1 启动 MATLAB	5
1.2.2 桌面平台	5
1.3 帮助系统	8
1.3.1 联机帮助系统	8
1.3.2 命令窗口查询帮助	10
1.3.3 联机演示系统	12
1.3.4 常用的命令和技巧	14
1.4 MATLAB 的搜索路径与扩展	15
1.4.1 MATLAB 的搜索路径	15
1.4.2 扩展 MATLAB 的搜索路径	16
第 2 章 数值计算功能	18
2.1 MATLAB 的数据类型	18
2.1.1 变量与常量	18
2.1.2 数字变量	20
2.1.3 字符串	22
2.1.4 矩阵	25
2.1.5 单元型变量	25
2.1.6 结构型变量	28
2.2 向量及其运算	30

2.2.1	向量的生成	30
2.2.2	向量的基本运算	32
2.2.3	点积、叉积及混合积的实现	32
2.3	矩阵及其运算	33
2.3.1	矩阵的生成	34
2.3.2	矩阵的基本数学运算	35
2.3.3	矩阵的基本函数运算	40
2.3.4	矩阵分解函数	46
2.3.5	特殊矩阵的生成	48
2.3.6	矩阵的一些特殊操作	50
2.4	数组及其运算	54
2.4.1	基本数组运算	54
2.4.2	数组函数运算	56
2.4.3	数组逻辑运算	56
2.5	多项式运算	58
2.5.1	多项式的表示方法	58
2.5.2	多项式运算	59
第3章	符号运算功能	63
3.1	符号表达式的生成	64
3.2	符号和数值之间的转换	65
3.3	符号函数的运算	66
3.3.1	复合函数运算	66
3.3.2	反函数运算	67
3.4	符号矩阵的创立	68
3.4.1	使用 sym 函数直接创建符号矩阵	68
3.4.2	用创建子阵的方法创建符号矩阵	68
3.4.3	将数值矩阵转化为符号矩阵	68
3.4.4	符号矩阵的索引和修改	69
3.5	符号矩阵的运算	69
3.5.1	基本运算	69
3.5.2	矩阵分解	71
3.5.3	矩阵的空间运算	72
3.5.4	符号矩阵的简化	73
3.6	符号微积分	75
3.6.1	符号极限	75
3.6.2	符号积分	76

3.6.3 符号微分和差分	77
3.7 符号代数方程求解	79
3.7.1 线性方程组的符号解法	79
3.7.2 非线性方程的符号解法	79
3.8 符号微分方程求解	80
3.9 符号函数的二维图	81
3.9.1 符号函数的简易绘图函数 ezplot	81
3.9.2 绘制函数图函数 fplot	82
3.10 图示化函数计算器	82
3.10.1 输入框的控制操作	83
3.10.2 命令按钮的操作	83
第 4 章 图形处理功能	86
4.1 二维图形	86
4.1.1 基本绘图命令	86
4.1.2 特殊的二维图形函数	90
4.2 三维图形	94
4.2.1 基本绘图命令	95
4.2.2 特殊的三维图形函数	99
4.3 四维表现图	102
4.4 图形处理的基本技术	103
4.4.1 图形的控制	103
4.4.2 图形的标注	106
4.4.3 图形的保持与子图	112
4.5 图形处理的高级技术	114
4.5.1 颜色映像	114
4.5.2 视角与光照	120
4.5.3 图像处理	124
4.5.4 图形的输出	127
4.6 图形窗口	127
4.6.1 图形窗口的菜单操作	127
4.6.2 图形窗口的工具栏	129
4.7 句柄图形	129
4.7.1 句柄图形的层次结构	129
4.7.2 句柄的访问	130
4.7.3 句柄的操作	131
4.8 图形用户界面操作 GUI	135

4.8.1 GUI 设计工具简介	136
4.8.2 GUI 向导设计	141
4.8.3 GUI 程序设计	144
4.9 动画	152
第5章 程序设计	155
5.1 M 文件介绍	155
5.1.1 M 文件的特点与形式	155
5.1.2 命令式文件	156
5.1.3 函数式文件	157
5.2 控制语句	158
5.2.1 循环语句	158
5.2.2 选择语句	161
5.2.3 分支语句 switch-case-otherwise	162
5.2.4 人机交互语句	163
5.3 函数变量及变量作用域	165
5.4 子函数与局部函数	167
5.5 程序设计的辅助函数	168
5.6 程序设计的优化	172
5.7 程序调试	173
5.7.1 M 文件错误的种类	173
5.7.2 错误的识别	174
5.7.3 调试过程	174
5.8 M 文件的调用记录	176
5.9 函数句柄	177
5.9.1 函数句柄的创建和显示	177
5.9.2 函数句柄的调用和操作	178
第6章 应用程序接口	180
6.1 应用程序接口介绍	180
6.1.1 MEX 文件	180
6.1.2 MATLAB 计算引擎	182
6.1.3 MAT 文件	182
6.2 MEX 文件的编辑与使用	182
6.2.1 C 语言 MEX 文件	183
6.2.2 FORTRAN 语言 MEX 文件	185
6.3 MATLAB 计算引擎	186



6.3.1 C 语言 MATLAB 计算引擎	186
6.3.2 FORTRAN 语言 MATLAB 计算引擎	188
6.4 MAT 文件的编辑与使用	190
6.4.1 MATLAB 中的数据处理	190
6.4.2 C 语言 MAT 文件	190
6.4.3 FORTRAN 语言 MAT 文件	193
6.5 创建独立应用程序	195
6.5.1 转化为 C/C++ 语言程序	195
6.5.2 创建独立的可执行程序	197
6.6 与 Word 的接口——Notebook	198
6.6.1 Notebook 的安装与启动	198
6.6.2 在 Word 中使用 Notebook	199
第 7 章 MATLAB 在计算方法中的应用	200
7.1 插值与拟合	200
7.1.1 Lagrange 插值	200
7.1.2 Runge 现象的产生和分段插值	201
7.1.3 Hermite 插值	204
7.1.4 样条插值	205
7.1.5 最小二乘法拟合	208
7.1.6 快速 Fourier 变换简介	210
7.2 积分与微分	211
7.2.1 Newton-Cotes 系列数值求积公式	212
7.2.2 Gauss 求积公式	218
7.2.3 Romberg 求积公式	221
7.2.4 Monte-Carlo 方法简介	222
7.2.5 符号积分	223
7.2.6 微分和差分	223
7.3 求解线性方程组	225
7.3.1 直接解法	225
7.3.2 迭代解法的几种形式	228
7.3.3 线性方程组的符号解法	231
7.3.4 稀疏矩阵技术	232
7.4 求解非线性方程组	236
7.4.1 非线性方程的解法	236
7.4.2 方程组解法	240
7.4.3 非线性方程(组)的符号解法	243



7.5 特征值问题	243
7.5.1 特征值函数	243
7.5.2 广义特征值分解	244
7.5.3 其他分解	245
7.6 常微分方程的解法	246
7.6.1 欧拉方法	246
7.6.2 Runge-Kutta 方法	249
7.6.3 刚性问题的解	251
7.6.4 常微分方程的符号解	253
第 8 章 MATLAB 在复变函数中的应用	254
8.1 复数和复矩阵的生成	254
8.1.1 复数的生成	254
8.1.2 创建复矩阵	254
8.2 复数的运算	255
8.2.1 复数的实部和虚部	255
8.2.2 共轭复数	255
8.2.3 复数的模和辐角	255
8.2.4 复数的乘除法	256
8.2.5 复数的平方根	256
8.2.6 复数的幂运算	256
8.2.7 复数的指数和对数运算	257
8.2.8 复数的三角函数运算	257
8.2.9 复数方程求根	257
8.3 留数	258
8.4 Taylor 级数展开	259
8.5 Laplace 变换及其逆变换	260
8.6 Fourier 变换及其逆变换	261
第 9 章 MATLAB 在概率统计中的应用	263
9.1 统计量的数字特征	263
9.1.1 简单数学期望和几种均值	263
9.1.2 数据比较	265
9.1.3 累积和累和	265
9.1.4 方差和标准差	265
9.1.5 偏斜度和峰度	266
9.1.6 协方差和相关系数	267

9.1.7 协方差矩阵	268
9.2 常用的统计分布量	269
9.2.1 给定分布下的期望和方差	269
9.2.2 概率密度函数	270
9.2.3 概率值函数(概率累积函数)	272
9.2.4 分值点函数(逆概率累积函数)	274
9.2.5 随机数生成函数	275
9.3 参数估计	276
9.3.1 正态分布参数估计	277
9.3.2 指数最大似然参数估计	278
9.4 区间估计	279
9.4.1 Gauss-Newton 法的非线性最小二乘数据拟合	279
9.4.2 非线性拟合和预测的交互图形工具	279
9.4.3 非线性最小二乘预测的置信区间	279
9.4.4 非线性模型的参数置信区间	280
9.4.5 非负最小二乘	280
9.5 假设检验	280
9.5.1 单个总体 $N(\mu, \sigma^2)$ 均值 μ 的检验	280
9.5.2 两个正态总体均值差的检验(t 检验)	282
9.5.3 秩和检验	283
9.6 方差分析和回归诊断	284
9.6.1 方差分析	284
9.6.2 回归分析	286
9.7 统计图	287
9.7.1 直方图	287
9.7.2 角度扇形图	288
9.7.3 正态分布图	288
9.7.4 参考线	288
9.7.5 显示数据采样的盒图	288
9.7.6 对离散图形加最小二乘法直线	289
9.7.7 QQ 图	289
第 10 章 MATLAB 在运筹优化问题中的应用	291
10.1 线性优化	292
10.2 二次优化	295
10.3 非线性无约束优化问题	296
10.3.1 fminbnd	297



10.3.2 fminsearch	298
10.3.3 fminunc.....	298
10.3.4 options 选项	301
10.4 最小二乘优化问题	303
10.4.1 最小二乘优化	303
10.4.2 最小二乘曲线/面拟合	305
10.5 非线性约束问题优化	306
10.5.1 函数介绍	306
10.5.2 应用举例	307
10.6 多任务“目标-达到”问题的优化	309
10.7 非线性方程的优化解	311
 第 11 章 MATLAB 在偏微分方程解法中的应用	313
11.1 解简单 Poisson 方程	313
11.2 解 Helmholtz 方程并研究反射波	314
11.2.1 Helmholtz 方程的求解	314
11.2.2 反射波的可视化研究	316
11.3 最小表面问题求解	317
11.4 使用子区域分解法解 FEM 问题	317
11.5 求解热传导方程	319
11.6 求解波形传递问题	321
11.7 使用自适应网格求解点力方程问题	323
11.8 使用矩形栅格解 Poisson 方程	325
 第 12 章 MATLAB 在建模仿真中的应用	327
12.1 Simulink 快速入门	327
12.1.1 Simulink 与建模仿真	327
12.1.2 创建一个简单模型	329
12.1.3 Simulink 是如何工作的	330
12.1.4 创建一个复杂模型	333
12.2 运行仿真	338
12.2.1 使用窗口运行仿真	338
12.2.2 仿真参数的设置	340
12.3 模型的调试	344
12.3.1 Simulink 调试器	344
12.3.2 在调试状态下运行仿真	345
12.3.3 设置断点	346

12.4 子系统及其封装技术	346
12.4.1 Simulink 子系统	346
12.4.2 压缩子系统	347
12.4.3 子系统模块	348
12.4.4 封装技术概述	350
12.4.5 子系统到封装模块的转化	350
12.4.6 查看封装和解封装	351
12.5 回调	352
12.5.1 回调函数的介绍	352
12.5.2 基于回调的图形用户界面	353
12.6 S 函数	354
12.6.1 什么是 S 函数	354
12.6.2 S 函数模块	354
12.6.3 S 函数是如何工作的	355
12.6.4 S 函数中的几个概念	356
12.6.5 S 函数动画	359
12.7 高级应用	363
12.7.1 算法选择	363
12.7.2 解法参数设置	365
12.7.3 代数环	367
12.7.4 改善仿真性能及精度	372
附录 A MATLAB 的设置	374
A.1 通用属性设置 (General)	375
A.2 颜色属性设置 (Colors)	375
A.3 命令窗口属性设置 (Command Window)	376
A.4 编辑调试属性设置 (Editor/Debugger)	377
A.5 帮助属性设置 (Help)	377
A.6 当前文件夹属性设置 (Current Folder)	378
A.7 工作空间属性设置 (Workspace)	378
A.8 变量编辑器属性设置 (Variable Editor)	379
A.9 GUIDE 属性设置 (GUIDE)	379
A.10 图形复制属性设置 (Figure Copy Template)	380
附录 B 主要函数命令注释	382
B.1 一般函数命令	382
B.2 运算符与运算	383

B.3	参数选择	384
B.4	数据类型和结构	385
B.5	数据分析和 Fourier 变换	386
B.6	基本矩阵和矩阵操作	387
B.7	基本数学函数	388
B.8	矩阵函数	389
B.9	稀疏矩阵	390
B.10	专用数学函数	391
B.11	时间函数	392
B.12	二维图	393
B.13	图形句柄	393
B.14	特殊图形	394
B.15	三维图	396
B.16	插值和多项式	397
B.17	语言程序设计	398
B.18	文件输入/输出函数	399
B.19	字符串函数	400
B.20	符号数学工具箱	400
B.21	统计工具箱	402
B.22	最优化工具箱	405
B.23	常微分方程解法 (ODE)	406
附录 C Simulink 主要库和库函数介绍		407
参考文献		411