

# Estrapolazione <sup>1</sup>

A. Sommariva<sup>2</sup>

---

*Keywords:* Cenni al metodo di estrapolazione. Metodo di Romberg.

---

*Revisione:* 3 giugno 2019

---

## 1. Estrapolazione

**Problema 1.1 (Estrapolazione).** *Il metodo di estrapolazione (di Richardson) è una procedura molto generale basata sul calcolo di diverse stime, in funzione di un parametro  $h > 0$ , di una quantità incognita  $\alpha$ , da combinare opportunamente allo scopo di fornire un valore più accurato di  $\alpha$  stessa.*

La definizione, pur essendo corretta, non risulta chiara. Di seguito la mostriamo più in dettaglio.

Data una formula di approssimazione  $\phi_0(h)$  di una quantità  $\alpha$ , con la struttura

$$\phi_0(h) = \alpha + ch^p + O(h^q), \quad q > p \geq 1$$

dove  $c$  è una costante indipendente da  $h$ , necessariamente

$$\phi_0\left(\frac{h}{2}\right) = \alpha + c\left(\frac{h^p}{2^p}\right) + O(h^{pq}). \quad (1)$$

da cui moltiplicando (1) per  $2^p$ , visto che dalla teoria degli infinitesimi  $2^p O(h^{pq}) + O(h^q) = O(h^q)$  in quanto  $pq > q$ , ricaviamo

$$\begin{aligned} \phi_0(h) - 2^p \phi_0(h/2) &= (\alpha + ch^p + O(h^q)) - 2^p(\alpha + c\left(\frac{h^p}{2^p}\right) + O(h^{pq})) \\ &= (1 - 2^p)\alpha + O(h^q) \end{aligned}$$

ovvero, visto che  $O(h^q)/(1 - 2^p) = O(h^q)$ ,

$$\phi_1(h) = \frac{\phi_0(h) - 2^p \phi_0(h/2)}{1 - 2^p} = \alpha + O(h^q).$$

In definitiva, abbiamo ottenuto una nuova approssimazione di  $\alpha$ , il cui errore non è più dell'ordine di  $p$ , ma dell'ordine di  $q > p$  e quindi potenzialmente migliore.

Ciò significa che se consideriamo ad esempio la successione di passi

$$h_0, h_0/2, h_0/4, \dots, h_0/2^k, \dots,$$

allora la successione

$$\{\phi_1(h_0/2^k)\}_{k \in \mathbb{N}}$$

converge ad  $\alpha$  più rapidamente di quanto non faccia

$$\{\phi_0(h_0/2^k)\}_{k \in \mathbb{N}}.$$

Il procedimento può essere iterato qualora

$$\phi_0(h) = \alpha + c_1 h^{p_1} + c_2 h^{p_2} + \dots + c_m h^m + O(h^{p_{m+1}})$$

con  $1 \leq p_1 < p_2 < \dots < p_m < p_{m+1}$ . A tal proposito, poniamo

$$\phi_1(h) = \frac{2^{p_1} \phi_0(h/2) - \phi_0(h)}{2^{p_1} - 1}.$$

Con qualche conto un po' tedioso, si ottiene

$$\phi_1(h) = \alpha + \sum_{k=2}^m c_k \left(1 - \frac{2^{p_1}}{2^{p_k}}\right) h^{p_k} + O(h^{p_{m+1}}).$$

Posto  $c_k^{(1)} = c_k(1 - \frac{2^{p_1}}{2^{p_k}})$ , abbiamo

$$\phi_1(h) = \alpha + c_2^{(1)} h^{p_2} + c_3^{(1)} h^{p_3} + \dots + c_m^{(1)} h^m + O(h^{p_{m+1}}).$$

In generale possiamo reiterare il processo, ottenendo

$$\phi_i(h) = \frac{2^{p_i} \phi_{i-1}(h/2) - \phi_{i-1}(h)}{2^{p_i} - 1}, \quad i = 1, \dots, m.$$

e

$$\phi_i(h) = \alpha + c_{i+1}^{(i)} h^{p_{i+1}} + c_{i+2}^{(i)} h^{p_{i+2}} + \dots + c_m^{(i)} h^m + O(h^{p_{m+1}}).$$

ed essendo  $p_{i+1} > p_i$  ci si aspetta un'approssimazione di  $\alpha$  potenzialmente migliore.

Usualmente si tabula il procedimento, come si può vedere nella seguente tabella.

$i = 0$	$i = 1$	$i = 2$	$i = \dots$	$i = m$
$\phi_0(h_0)$				
$\phi_0(h_0/2)$	$\phi_1(h_0)$			
$\phi_0(h_0/4)$	$\phi_1(h_0/2)$	$\phi_2(h_0/2^{m-2})$		
$\dots$	$\dots$	$\dots$	$\dots$	$\dots$
$\phi_0(h_0/2^m)$	$\phi_1(h_0/2^{m-1})$	$\phi_2(h_0/2^{m-2})$	$\dots$	$\phi_m(h_0)$

Tabella 1: Esempio di tabella di estrapolazione.

## 2. Alcuni esempi. Approssimazione di integrali definiti.

Mostriamo di seguito alcuni esempi in cui si ha la struttura

$$\phi_0(h) = \alpha + ch^p + O(h^q), \quad q > p \geq 1.$$

Per il teorema di Eulero-Mac Laurin,

1. se  $f \in C^{(4)}([a, b])$ ,  $-\infty < a < b < +\infty$ ,
2.  $T(f, h)$  è la formula dei trapezi composta, avente passo  $h = (b - a)/m$ ,  $m \in \{1, 2, \dots\}$ , ovvero

$$T(f, h) = \frac{h}{2}(f(a) + 2f(a+h) + \dots + 2f(b-h) + f(b))$$

abbiamo

$$T(f, h) = \underbrace{\int_a^b f(x)dx}_{\alpha} + \underbrace{\frac{(f'(b) - f'(a))}{12}}_c h^2 + O(h^4)$$

Quindi,  $T(f, h) = \alpha + ch^p + O(h^q)$  per  $\alpha = \int_a^b f(x)dx$ ,  $c = \frac{(f'(b) - f'(a))}{12}$ ,  $p = 2$ ,  $q = 4$ .

Il metodo di estrapolazione legato alla formula dei trapezi è detto di Romberg (pubblicato nel 1955).

Di seguito, mostriamo alcune tabelle che mostrano tale metodo per calcolare

1.  $\int_{-1}^1 \exp(x)dx = \exp(1) - \exp(-1)$ ,
2.  $\int_{-1}^1 \cos(x)dx = \sin(1) - \sin(-1)$ ,
3.  $\int_0^{\pi/2} (x^2 + x + 1) \cos(x)dx = -2 + \frac{\pi}{2} + \frac{\pi^2}{4}$ .

In ognuna di esse,

- la prima colonna è il passo utilizzato,
- la seconda colonna è quella della formula dei trapezi con passo  $h_k$ , in cui si valutano vari  $\phi_0(h_k)$ ,
- le colonne successive sono gli errori di  $|\phi_j(h_k) - I|$  dove  $I$  è l'integrale da approssimare.

Risulta chiaro il miglioramento dei risultati ottenuto nell'ultima colonna.

## 3. Alcuni esempi. Approssimazione di derivate.

Sviluppando il rapporto incrementale  $\delta_+$  dopo qualche conto simile a quelli già fatti, ma troncando la formula di Taylor rispettivamente al terzo e quinto ordine, abbiamo per  $f \in C^3([a, b])$ ,  $x, x+h \in [a, b]$ ,

$$f(x+h) = f(x) + f^{(1)}(x)h + f^{(2)}(x)\frac{h^2}{2} + f^{(3)}(\xi)\frac{h^3}{6}, \quad \xi \in (x, x+h)$$

$h$	$i = 0$	$i = 1$	$i = 2$	$i = 3$	$i = 4$	$i = 5$
2.0e + 00	7.4e - 01					
1.0e + 00	1.9e - 01	1.2e - 02				
5.0e - 01	4.9e - 02	7.9e - 04	6.9e - 05			
2.5e - 01	1.2e - 02	5.1e - 05	1.2e - 06	1.1e - 07		
1.2e - 01	3.1e - 03	3.2e - 06	1.9e - 08	4.6e - 10	4.2e - 11	
6.2e - 02	7.7e - 04	2.0e - 07	3.0e - 10	1.8e - 12	4.5e - 14	4.0e - 15

Tabella 2: Errori nel calcolo dell'integrale  $\int_{-1}^1 \exp(x)dx = \exp(1) - \exp(-1)$ , mediante la formula dei trapezi composta, con passo 2, 1, 1/2, ..., 1/16, e successiva estrapolazione.

$h$	$i = 0$	$i = 1$	$i = 2$	$i = 3$	$i = 4$	$i = 5$
2.0e + 00	6.0e - 01					
1.0e + 00	1.4e - 01	1.1e - 02				
5.0e - 01	3.5e - 02	6.0e - 04	6.4e - 05			
2.5e - 01	8.8e - 03	3.7e - 05	9.0e - 07	1.0e - 07		
1.2e - 01	2.2e - 03	2.3e - 06	1.4e - 08	3.5e - 10	3.9e - 11	
6.2e - 02	5.5e - 04	1.4e - 07	2.1e - 10	1.3e - 12	3.5e - 14	3.1e - 15

Tabella 3: Errori nel calcolo dell'integrale  $\int_{-1}^1 \cos(x)dx = \sin(1) - \sin(-1)$ , mediante la formula dei trapezi composta, con passo 2, 1, 1/2, ..., 1/16, e successiva estrapolazione.

$h$	$i = 0$	$i = 1$	$i = 2$	$i = 3$	$i = 4$	$i = 5$
1.6e + 00	1.3e + 00					
7.9e - 01	3.1e - 01	2.4e - 03				
3.9e - 01	7.8e - 02	2.4e - 04	9.9e - 05			
2.0e - 01	1.9e - 02	1.6e - 05	1.3e - 06	2.6e - 07		
9.8e - 02	4.9e - 03	1.0e - 06	1.9e - 08	9.1e - 10	1.2e - 10	
4.9e - 02	1.2e - 03	6.6e - 08	3.0e - 10	3.5e - 12	1.1e - 13	1.2e - 14

Tabella 4: Errori nel calcolo dell'integrale  $\int_0^{\pi/2} (x^2 + x + 1) \cos(x)dx = -2 + \frac{\pi}{2} + \frac{\pi^2}{4}$ , mediante la formula dei trapezi composta, con passo 2, 1, 1/2, ..., 1/16, e successiva estrapolazione.

e riarrangiando i termini, visto che  $f \in C^3([a, b])$ ,

$$\delta_+(f, x, h) = \frac{f(x+h) - f(x)}{h} = \underbrace{f^{(1)}(x)}_{\alpha} + \underbrace{f^{(2)}(x)}_c h + O(h^2),$$

con  $\xi_x \in (x, x+h)$ . Quindi,

$$\delta_+(f, x, h) = \alpha + ch^p + O(h^q)$$

per  $\alpha = f'(x)$ ,  $c = 1$ ,  $p = 1$ ,  $q = 2$ .

Di seguito, mostriamo alcune tabelle che mostrano tale metodo per calcolare

1.  $D \exp(x)$  in  $x = 0$ ,
2.  $D \frac{1}{1+x^2}$  in  $x = 5$ ,
3.  $D \sin(x)$  in  $x = \pi/4$ .

In ognuna di esse,

- la prima colonna è il passo utilizzato,
- la seconda colonna è quella della formula  $\delta_+$  con passo  $h_k$ , in cui si valutano vari  $\phi_0(h_k)$ ,
- le colonne successive sono gli errori di  $|\phi_j(h_k) - I|$  dove  $I$  è l'integrale da approssimare.

Nei casi in questione è evidente il miglioramento dei risultati ottenuto nell'ultima colonna.

$h$	$i = 0$	$i = 1$	$i = 2$	$i = 3$	$i = 4$	$i = 5$
$1.0e - 02$	$5.0e - 03$					
$5.0e - 03$	$2.5e - 03$	$8.4e - 06$				
$2.5e - 03$	$1.3e - 03$	$2.1e - 06$	$5.2e - 09$			
$1.3e - 03$	$6.3e - 04$	$5.2e - 07$	$6.5e - 10$	$1.3e - 12$		
$6.3e - 04$	$3.1e - 04$	$1.3e - 07$	$8.1e - 11$	$5.6e - 13$	$5.1e - 13$	
$3.1e - 04$	$1.6e - 04$	$3.3e - 08$	$1.0e - 11$	$1.1e - 13$	$1.5e - 13$	$1.7e - 13$

Tabella 5: Errori nel calcolo della derivata di  $\exp(x)$  in  $x = 0$ , mediante il rapporto incrementale, con passo  $1/100, 1/200, 1/400, \dots, 1/3200$ , e successiva estrapolazione.

$h$	$i = 0$	$i = 1$	$i = 2$	$i = 3$	$i = 4$	$i = 5$
$1.0e - 02$	$4.2e - 05$					
$5.0e - 03$	$2.1e - 05$	$5.2e - 08$				
$2.5e - 03$	$1.1e - 05$	$1.3e - 08$	$3.0e - 11$			
$1.3e - 03$	$5.3e - 06$	$3.3e - 09$	$3.8e - 12$	$1.3e - 14$		
$6.3e - 04$	$2.6e - 06$	$8.2e - 10$	$4.5e - 13$	$2.8e - 14$	$3.1e - 14$	
$3.1e - 04$	$1.3e - 06$	$2.1e - 10$	$6.5e - 14$	$1.1e - 14$	$1.3e - 14$	$1.5e - 14$

Tabella 6: Errori nel calcolo della derivata di  $1/(1 + x^2)$  in  $x = 5$ , mediante il rapporto incrementale, con passo  $1/100, 1/200, 1/400, \dots, 1/3200$ , e successiva estrapolazione.

$h$	$i = 0$	$i = 1$	$i = 2$	$i = 3$	$i = 4$
$1.0e - 02$	$3.5e - 03$				
$5.0e - 03$	$1.8e - 03$	$5.9e - 06$			
$2.5e - 03$	$8.8e - 04$	$1.5e - 06$	$3.7e - 09$		
$1.3e - 03$	$4.4e - 04$	$3.7e - 07$	$4.6e - 10$	$9.3e - 13$	
$6.3e - 04$	$2.2e - 04$	$9.2e - 08$	$5.8e - 11$	$6.6e - 15$	$5.5e - 14$

Tabella 7: Errori nel calcolo della derivata di  $\sin(x)$  in  $x = \pi/4$ , mediante il rapporto incrementale, con passo  $1/100, 1/200, 1/400, \dots, 1/1600$ , e successiva estrapolazione.