

с начальными и граничными условиями двух видов:

$$\left. \begin{aligned} u(x,0) &= \varphi(x), \\ u_t(x,0) &= \psi(x) \end{aligned} \right\} \quad (2)$$

$$\left. \begin{aligned} 0 < x < \infty, \\ u(0,t) &= 0, \quad t > 0; \\ u(x,0) &= \varphi(x), \\ u_t(x,0) &= \psi(x) \end{aligned} \right\} \quad (3)$$

$$\left. \begin{aligned} 0 \leq x \leq l, \\ u(0,t) &= \mu_1(t), \\ u(l,t) &= \mu_2(t) \end{aligned} \right\}$$

$$t \geq 0.$$

Здесь $C = \sqrt{\frac{T_0}{\rho}}$, где T_0 - натяжение струны, ρ - плотность.

Решение уравнения (1) запишем в виде:

$$U = [A_1(d_x)sh(tCd_x)] * f_1(x) + [A_2(d_x)ch(tCd_x)] * f_2, \quad (4)$$

где $d_x = \frac{d}{dx}$, t - время.

Построенное таким образом решение тождественно удовлетворяет уравнению (1) при произвольных бесконечно дифференцируемых функциях $f_1(x)$ и $f_2(x)$. Звёздочкой обозначено операторное дифференцирование.

Если в (4) положить A_1 и $A_2 = \text{const}$, то с учетом

$$\exp(\pm tCd_x) * f(x) = f(x \pm tC),$$

получим известное решение Даламбера [л.с.52] для бесконечной струны:

$$u(x,t) = \frac{\varphi(x+Ct) + \varphi(x-Ct)}{2} + \frac{1}{2C} \int_{x-Ct}^{x+Ct} \psi(\alpha) d\alpha.$$

Если в (4) положить $A_1(d_x) = \frac{A_n l}{\pi n} d_x$, $A_2(d_x) = B_n$, то получим решение Фурье [л.с.86] для закреплённой ($0 \leq x \leq l$; $u(0,t) = u(l,t) = 0$) струны:

$$u(x,t) = \sum_{n=1}^{\infty} \left(A_n \cos \frac{\pi n}{l} Ct + B_n \sin \frac{\pi n}{l} Ct \right) \sin \frac{\pi n}{l} x,$$

где $A_n = \frac{2}{l} \int_0^l \varphi(\xi) \sin \frac{\pi n}{l} \xi d\xi$, $B_n = \frac{2}{\pi n C} \int_0^l \psi(\xi) \sin \frac{\pi n}{l} \xi d\xi$.

Проведём исследование нового решения, когда

$$f_1(x) = \sum_{k=-\infty}^{\infty} a_k x^k \quad \text{и} \quad f_2(x) = \sum_{k=-\infty}^{\infty} b_k x^k$$

в нашем случае оно имеет следующий вид:

$$U = (tCd_x^2 + \frac{1}{3!} t^3 C^3 d_x^4) (a_3 x^3 + a_5 x^5) + (1 + \frac{1}{2!} t^2 C^2 d_x^2) (b_1 x + b_3 x^3).$$

Данное решение

$$U(x,t)=6a_3 tCx+20a_3 tCx^3+20a_5 t^3 C^3x+b_1x+b_3x^3+3b_3 t^2C^2x$$

тождественно удовлетворяет уравнению (1).

Для первого случая получим:

$$U(x,0) = b_1x + b_3x^3,$$

$$U'_x(x,0) = 6Ca_3x.$$

Для второго случая получим:

$$U(0,t) = \mu_1(t) = 0,$$

$$U(l,t)=\mu_2(t)=b_1l+b_3l^3+2(3a_3l+10a_5l^3)tC+3b_3C^2lt^2+20a_5C^3lt^3.$$

Итак, получим новое решение известной задачи, удобное для проведения численного анализа.

Литература

1. Тихонов А.Н., Самарский А.А. Уравнения математической физики. Изд. 5-е, -М.: Наука, 1977. -736 с.

СРАВНИТЕЛЬНЫЙ АНАЛИЗ РОБАСТНОСТИ ДВУХ АЛГОРИТМОВ МНОГОМЕРНОГО БАЙЕСОВСКОГО ПРОГНОЗИРОВАНИЯ

Шлык П. А., БГУ, Минск

В данной работе приводятся результаты сравнительного численного анализа робастности двух алгоритмов байесовского прогнозирования [1] при искажениях априорной плотности распределения вектора параметров, введенных в рассмотрение П.Густафсоном (1994). Компоненты прогнозируемого вектора могут быть стохастически зависимыми.

Математическая модель байесовского прогнозирования.

Характеристики робастности прогнозирования

Пусть на вероятностном пространстве (Ω, F, P) заданы три случайных элемента:

I. Наблюдаемый вектор параметров θ , истинное значение которого неизвестно и является случайным с априорной гипотетической плотностью распределения вероятностей (п.р.в.) $\pi^0(\theta), \theta \in \Theta \subseteq R^m$;

II. Стохастически зависящий от θ вектор наблюдений $x = (x_t)_{t=1}^T \in X \subseteq R^{n \times T}$ с гипотетической условной п.р.в. $p^0(x|\theta)$;

III. Неизвестный, подлежащий прогнозированию, вектор $y \in Y \subseteq R^n$, стохастически зависящий от x и от θ , с гипотетической п.р.в. $g^0(y|x, \theta)$.

Рассмотрим модель искажений, предложенную П.Густафсоном [2]. Пусть п.р.в. вектора параметров θ равна $\tilde{\pi}(\theta)$ из множества $\Gamma_\varepsilon^p(\pi^0)$: