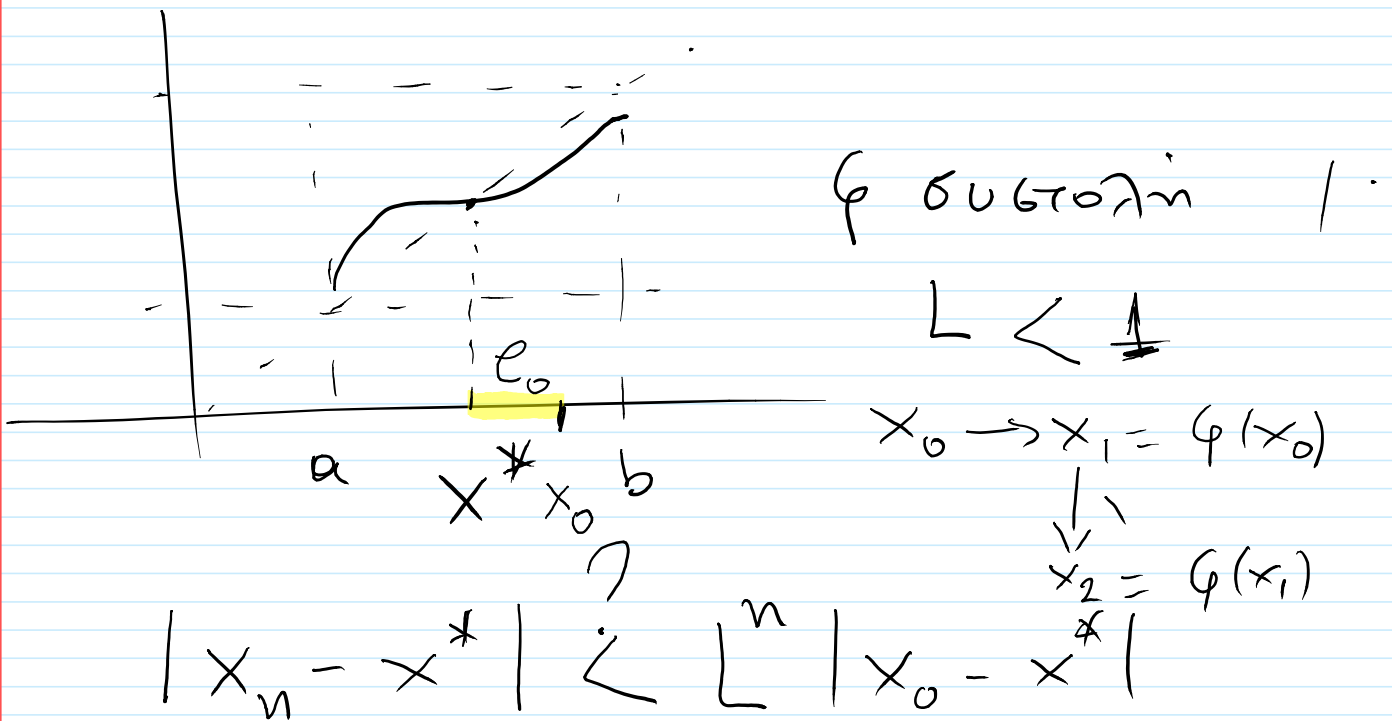
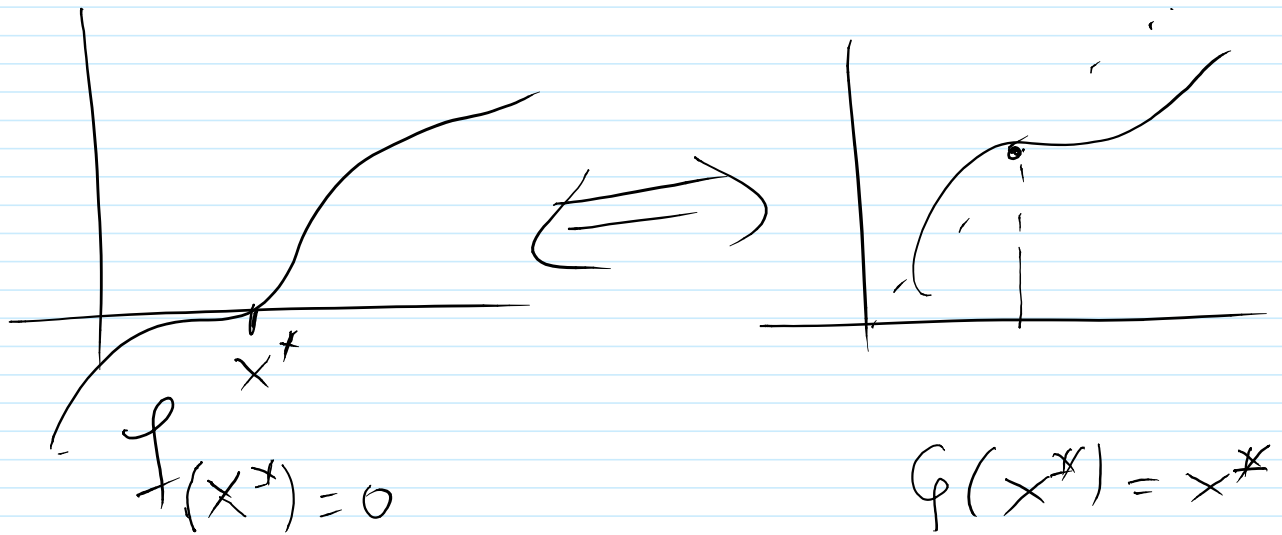


Non Linear Equations (2)

Τρίτη, 17 Φεβρουαρίου 2015 5:14 μμ



$$\left. \begin{aligned} &|x_n - x^*| \\ &x_n = \varphi(x_{n-1}) \\ &x^* = \varphi(x^*) \end{aligned} \right\} |x_n - x^*| = |\varphi(x_{n-1}) - \varphi(x^*)|$$

$$\begin{aligned}
 \varphi \text{ συστολιή} & \begin{cases} \leftarrow L |x_{n-1} - x^*| = \\ L | \varphi(x_{n-2}) - \varphi(x^*) | \\ \leftarrow L \cdot L |x_{n-2} - x^*| \\ \quad L^2 |x_{n-2} - x^*| \\ \vdots \\ \leftarrow L^n |x_0 - x^*| \\ \leftarrow L^n \max\{|x_0 - a|, |b - x_0|\} \end{cases}
 \end{aligned}$$

Π.χ.

$$a = 1, \quad b = 5, \quad x_0 = 4$$

$$L = 10^{-1}$$

$$n = 4 \Rightarrow |x_4 - x^*| < 10^{-4} \cdot 3$$

• Πόσες ενδιάμεσες ώρες το
 διάστημα $< 10^{-6}$ (n?)

$$|x_n - x^*| < L^n \cdot 3 < 10^{-6}$$

$$L^n < \frac{1}{3} 10^{-6}$$

$$\log_{10}(L^n) < \log_{10}\left(\frac{1}{3} 10^{-6}\right)$$

$$n \log_{10}(10^{-1}) < \log_{10}\frac{1}{3} + (-6)$$

(-1)

$$-n < -6 + \log_{10}\frac{1}{3}$$

$$n > 6 - \log_{10}\frac{1}{3}$$

$$n \geq 7$$

für $n \geq 7$ $|x_n - x^*| < 10^{-6}$

$$f(x) = x^2 - x - 2$$

↓

$$f(x) = x^2 - 2$$

$$x^2 - x - 2 = 0$$

$$x^2 - 2 = x$$

$$f(x) = x$$

φ συστολή ???

$$[\text{σημ. } |f(x) - f(y)| < L|x-y|, L < 1]$$

$$\frac{d\varphi}{dx}(x) = \varphi'(x) = 2x$$

$$|2x| < 1 \Rightarrow |x| < \frac{1}{2}$$

$$-\frac{1}{2} < x < \frac{1}{2}$$

Αν $[a, b] \subset (-\frac{1}{2}, \frac{1}{2})$ τότε μπορούμε να εφαρμόσουμε την $x_{n+1} = \varphi(x_n)$

$$\Rightarrow x^* = \varphi(x^*) \Leftrightarrow \varphi(x^*) - x^* = 0$$

Αν $[a, b] \not\subset (-\frac{1}{2}, \frac{1}{2}) \Rightarrow ?$

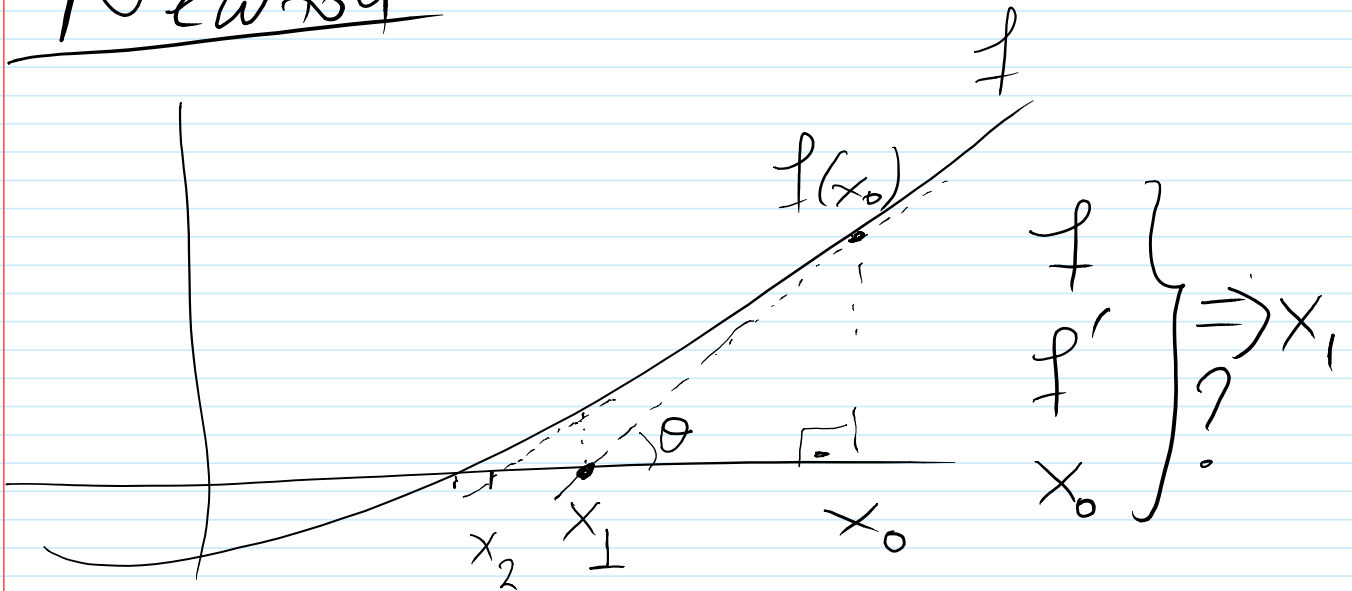
Άσκηση:

Για την f στη σελ. 17, υπολογίστε τις ρίζες της.

Βρείτε ποια g είναι συστολή κατά τις ρίζες

↑
αυοικτό είδ-
στήλο που
περιέχουν τις

Newton



Γεωμετρία

$$\frac{f(x_0)}{x_0 - x_1} = \tan(\theta) = f'(x_0)$$

$f'(x_0) \neq 0$

$$\frac{f(x_0)}{f'(x_0)} = x_0 - x_1 \quad (\Leftrightarrow) \quad x_1 = x_0 - \frac{f(x_0)}{f'(x_0)}$$

Όλοια

$$x_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)}{f'(x_n)}$$

x_0, f, f' (δεν μηδενίζονται)
 ωστε να είναι

Newton \Rightarrow x^*

$$f(x^*) = f(x_n) + (x^* - x_n) f'(x_n) + \frac{(x^* - x_n)^2}{2} f''(\xi_n)$$

**

$$0 = f(x_n) + (x^* - x_n) f'(x_n) + \frac{(x^* - x_n)^2}{2} f''(\xi_n)$$

$$x_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)}{f'(x_n)}$$

$$(x_{n+1} - x_n) f'(x_n) = -f(x_n)$$

$$f(x_n) = f'(x_n) (x_n - x_{n+1})$$

$$0 = f'(x_n) (x_n - x_{n+1}) + (x^* - x_n) f'(x_n) + \frac{(x^* - x_n)^2}{2} f''(\xi_n)$$

$$0 = f'(x_n) (x^* - \cancel{x_n} + \cancel{x_n} - x_{n+1}) + \frac{(x^* - x_n)^2}{2} f''(\xi_n)$$

$$0 = f'(x) e + (e_n)^2 f''(\xi)$$

$$c = \frac{|m| - |n+1|}{2} + |j_n|$$

$$\frac{e_{n+1}}{e_n^2} = -\frac{1}{2} \frac{f''(\xi_n)}{f'(\xi_n)} \xrightarrow{n \rightarrow \infty} c$$

f, f', f'' o larda

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{|e_{n+1}|}{|e_n|^2} = c \Leftrightarrow \text{Konvergenzgeschwindigkeit}$$

Güçordnungen

$$\frac{|e_{n+1}|}{e_n^2} \leq C^* \quad n > N$$

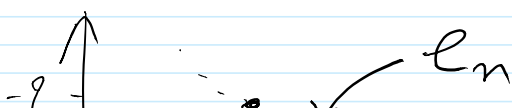
$$|e_{n+1}| \leq C^* e_n^2$$

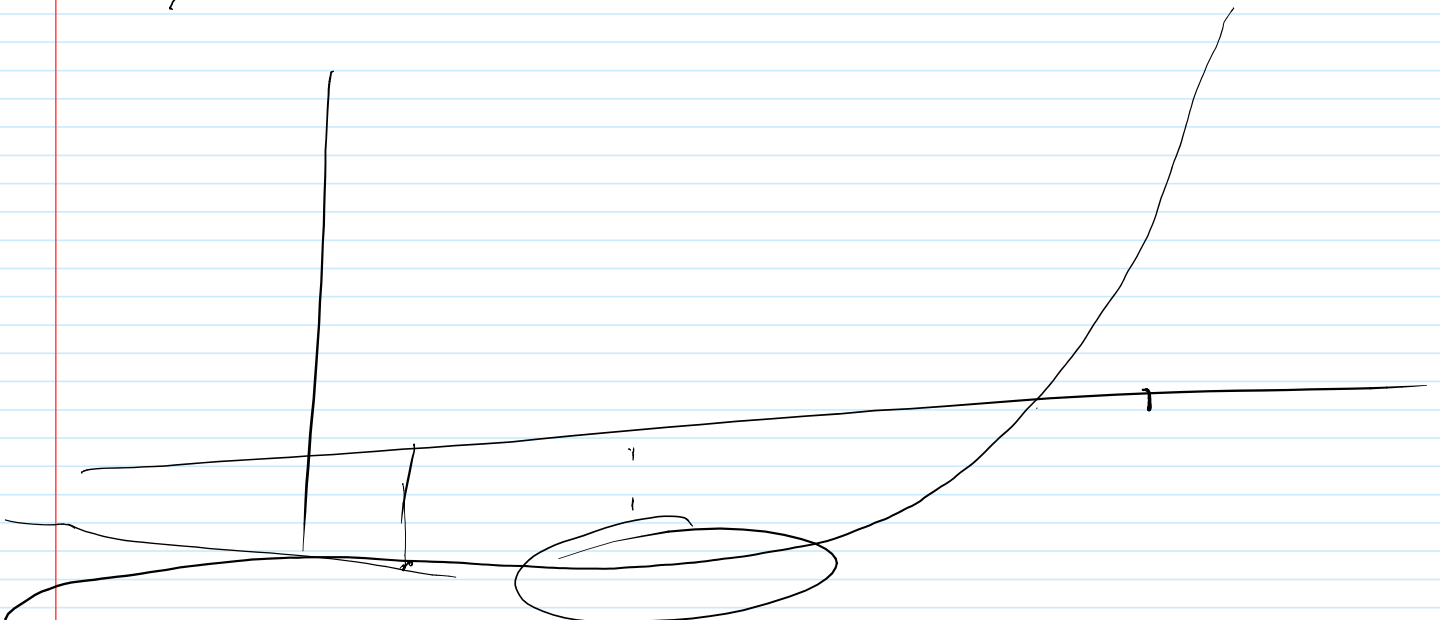
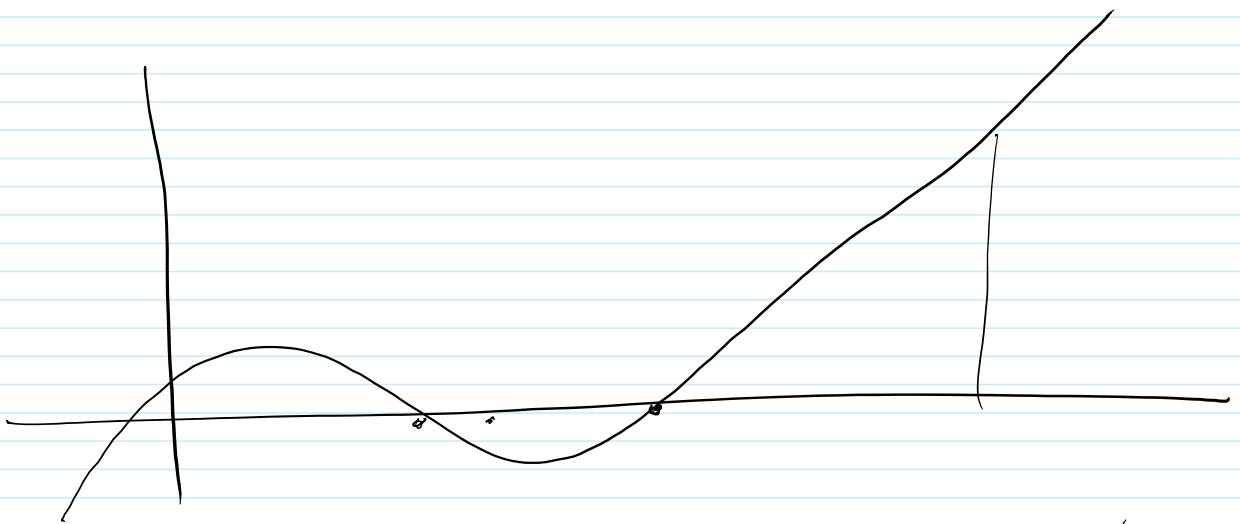
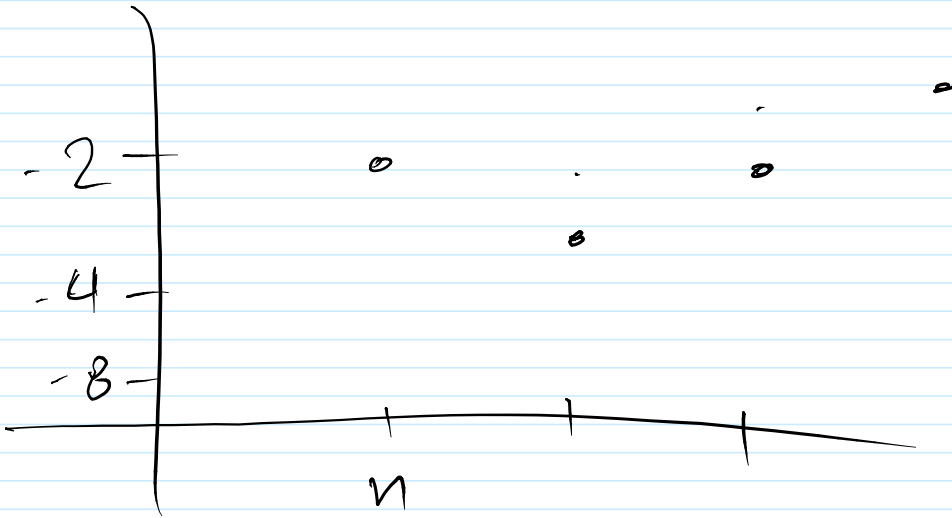
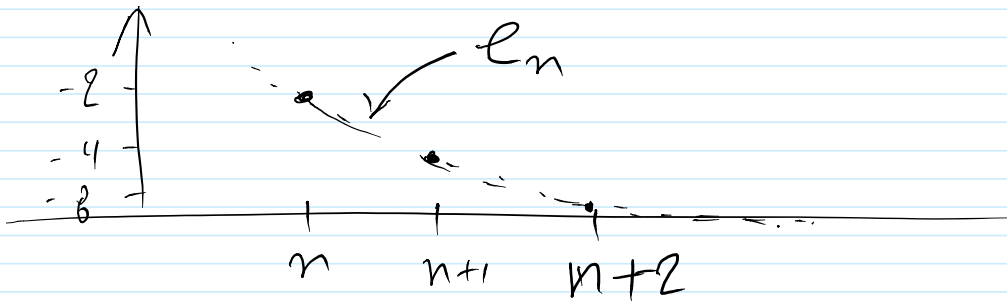
$$|e_{n+2}| \leq C^* e_{n+1}^2 \leq (C^*)^2 e_n^4$$

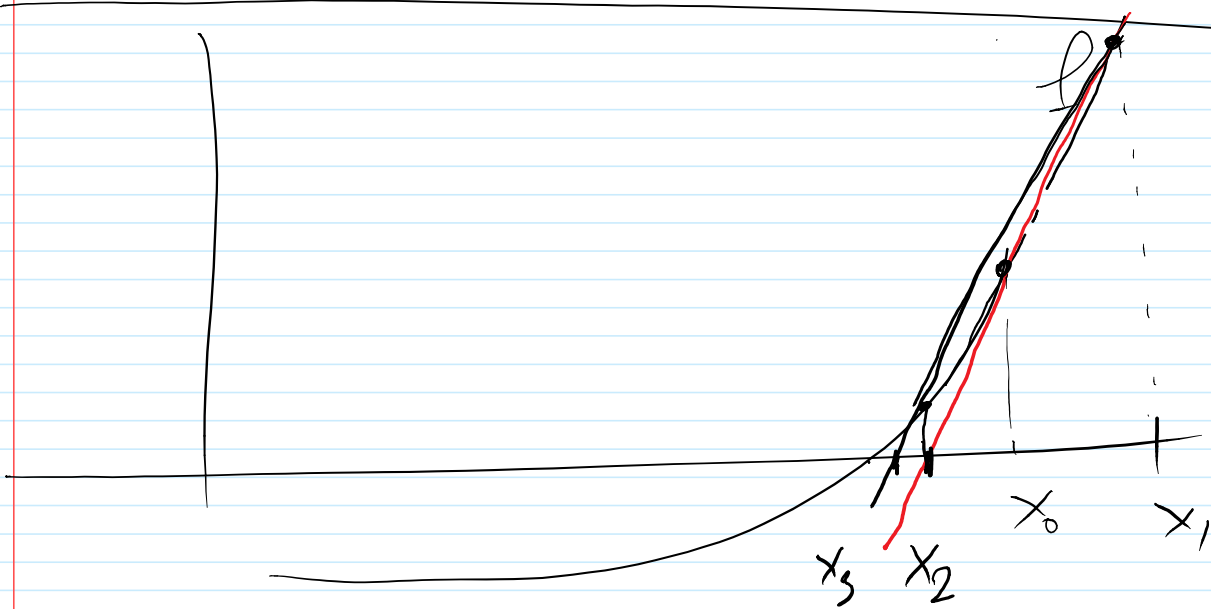
$$|e_n| \leq 10^{-2}$$

$$|e_{n+1}| \leq C^* (10^{-2})^2 = C^* 10^{-4}$$

$$|e_{n+2}| \leq \dots \leq C^* 10^{-8}$$







$$\left. \begin{array}{l} x_0, f(x_0) \\ x_1, f(x_1) \end{array} \right\} \Rightarrow x_2$$

$$\frac{y - y_1}{x - x_1} = \frac{y_0 - y_1}{x_0 - x_1} \Rightarrow$$

$$y = \dots$$

$$x_2 = x_1 - \frac{f(x_1)}{f'(x_1)} \quad || \int$$

$$x_2 = x_1 - \frac{f(x_1)}{\frac{f(x_1) - f(x_0)}{x_1 - x_0}} \quad \text{Ρέκινουσα}$$

Γενικός νόμος

Γενικός νόμος
Τελευταίος

$$x_{n+2} = x_{n+1} - \frac{f(x_{n+1})}{\frac{f(x_{n+1}) - f(x_n)}{x_{n+1} - x_n}}$$

$x_0, x_1,$

HY213. ΑΡΙΘΜΗΤΙΚΗ ΑΝΑΛΥΣΗ

ΕΠΙΛΥΣΗ ΜΗ ΓΡΑΜΜΙΚΩΝ
ΕΞΙΣΩΣΕΩΝ

Π. ΤΣΟΜΠΑΝΟΠΟΥΛΟΥ

ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ΘΕΣΣΑΛΙΑΣ

ΤΜΗΜΑ ΗΛΕΚΤΡΟΛΟΓΩΝ ΜΗΧ. & ΜΗΧ. ΥΠΟΛΟΓΙΣΤΩΝ

Βασικά σημεία

- ▶ Μη γραμμικές εξισώσεις με πραγματικές ρίζες.
 - ▶ Μέθοδος διχοτόμησης.
 - ▶ Επαναληπτικές μέθοδοι.
 - ▶ Newton.
 - ▶ Τέμνουσας (secant).
- ▶ Ρίζες πολυωνύμων.
- ▶ Ρίζες μιγαδικών εξισώσεων.
- ▶ Συστήματα μη γραμμικών εξισώσεων.

Επίλυση μη γραμμικών εξισώσεων

- ▶ Με δεδομένη μια συνάρτηση f , ψάχνουμε το x^* για το οποίο $f(x^*) = 0$.
- ▶ Το x^* ονομάζεται ρίζα της εξίσωσης ή το μηδέν της συνάρτησης f .
- ▶ Δυο βασικές κατηγορίες τέτοιων προβλημάτων:
 - ▶ Μια μη γραμμική εξίσωση με έναν άγνωστο,
 $f: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$
η λύση είναι αριθμός x τ.ω. $f(x) = 0$.
 - ▶ Σύστημα από n μη γραμμικές εξισώσεις με n αγνώστους,
 $f: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$
η λύση είναι διάνυσμα x τ.ω. κάθε συνιστώσα της f είναι 0.

Παραδείγματα:

- ▶ Μη γραμμική εξίσωση (1-D):

$$x^2 - 4 \sin(x) = 0 \Rightarrow x = 1.93375 \text{ μια από τις ρίζες}$$

- ▶ Σύστημα μη γραμμικών εξισώσεων (2-D):

$$\left. \begin{array}{l} x_1^2 - x_2 + 0.25 = 0 \\ -x_1 + x_2^2 + 0.25 = 0 \end{array} \right\} \Rightarrow x = \begin{bmatrix} 0.5 \\ 0.5 \end{bmatrix}$$

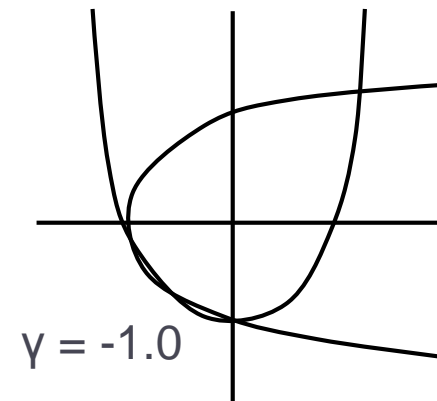
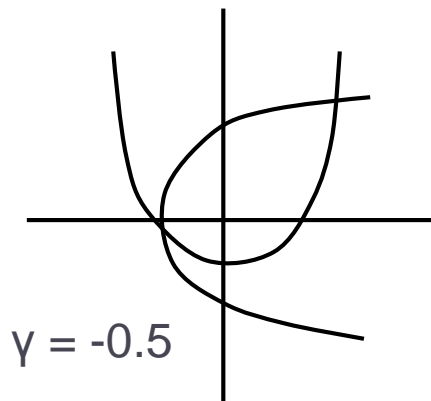
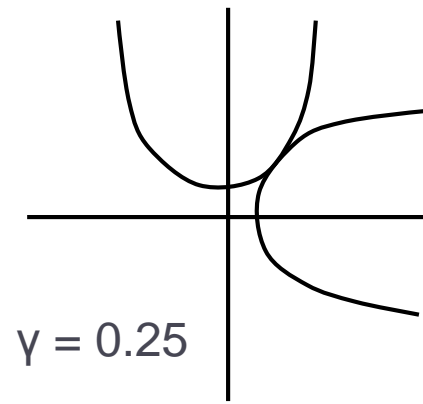
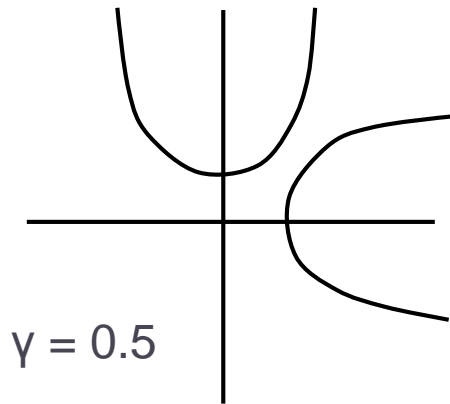
Παραδείγματα:

Οι μη γραμμικές εξισώσεις μπορούν να έχουν οποιοδήποτε πλήθος λύσεων:

- ▶ $\exp(x) + 1 = 0$, δεν έχει ρίζα.
- ▶ $x^2 - \sin(x) + 1 = 0$, δεν έχει ρίζα.
- ▶ $\exp(-x) - x = 0$, έχει μια ρίζα.
- ▶ $x^2 - 4 \sin(x) = 0$, έχει 2 ρίζες.
- ▶ $x^3 + 6x^2 + 11x - 6 = 0$, έχει 3 ρίζες.
- ▶ $\sin(x) = 0$, έχει άπειρες ρίζες.

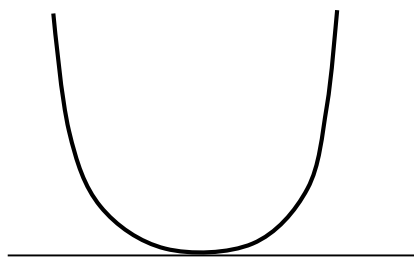
Παραδείγματα:

$$x_1^2 - x_2 + \gamma = 0$$
$$-x_1 + x_2^2 + \gamma = 0$$

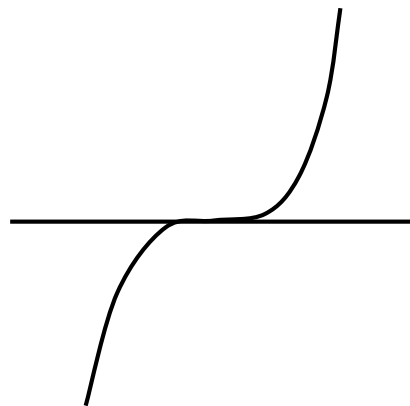


Παραδείγματα:

- ▶ Οι μη γραμμικές εξισώσεις μπορεί να έχουν πολλαπλές ρίζες, δηλαδή και η συνάρτηση και οι παράγωγοι της μηδενίζονται στο ίδιο σημείο, π.χ.: $f(x)=0$ και $f'(x)=0$.



$$x^2 - 2x + 1 = 0$$



$$x^3 - 3x^2 + 3x - 1 = 0$$

Υπαρξη και μοναδικότητα της λύσης.

- ▶ Αναλυτικοί τύποι για ρίζες πολυωνύμων μέχρι και 4ου βαθμού.
- ▶ Galois(1830): δεν μπορούν να βρεθούν αναλυτικοί τύποι για τις ρίζες πολυωνύμων βαθμού > 4 .
- ▶ Θεώρημα Bolzano (Ειδική Περίπτωση του Θεωρήματος Ενδιάμεσης Τιμής - Μόνο σε 1-D):
Αν f συνεχής στο $[a, b]$ και $\text{sign}(f(a)) \neq \text{sign}(f(b))$ τότε υπάρχει x^* στο $[a, b]$ τ.ω. $f(x^*)=0$.
- ▶ Δεν υπάρχει κάτι ανάλογο για περισσότερες διαστάσεις.
- ▶ Επαναληπτικές διαδικασίες για προσέγγιση ριζών.

Επαναληπτικές μέθοδοι και τάξη σύγκλισης.

- ▶ Στις επαναληπτικές μεθόδους υπολογίζουμε μια ακολουθία $\{x_k\}_k$ για να προσεγγίσουμε την πραγματική λύση x^* του προβλήματος.
- ▶ Το σφάλμα της προσέγγισης είναι $e_k = x_k - x^*$.
- ▶ Η ακολουθία συγκλίνει με τάξη r ανν:

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{\|e_{k+1}\|}{\|e_k\|^r} = C$$

όπου C σταθερά.

Π.χ.: $r=1$ γραμμική σύγκλιση,
 $r=2$ τετραγωνική σύγκλιση,
 $r>1$ υπεργραμμική σύγκλιση

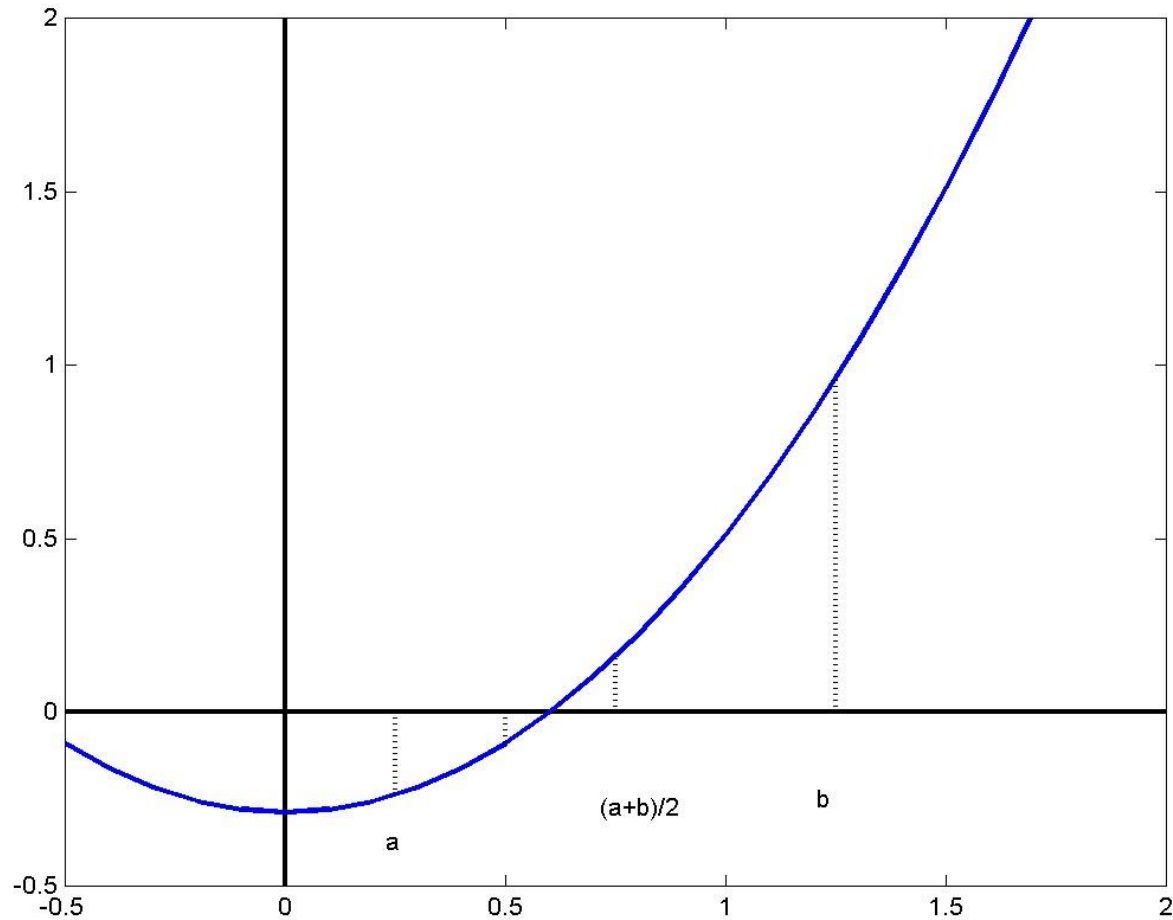
Μέθοδος διχοτόμησης

☹ Η $f:[a,b] \rightarrow \mathbb{R}$ πραγματική συνάρτηση μιας πραγματικής μεταβλητής.

😊 Αλγόριθμος:

1. $c := a, d := b, f(c), f(d)$
2. $e = (c+d)/2, f(e)$
3. if $|f(e)| < \text{tol} \rightarrow x^* = e, \text{stop}$
4. if $f(c)*f(e) > 0 \rightarrow c := e$
5. if $f(d)*f(e) > 0 \rightarrow d := e$
6. if $|c-d| < \text{tol} \rightarrow x^* = (c+d)/2, \text{stop}$
7. goto to step 2.

Μέθοδος διχοτόμησης



Παράδειγμα:

$$f(x) = x^2 - 4 \sin(x) = 0$$

α	$f(\alpha)$	b	$f(b)$
1.000000	-2.365884	3.000000	8.435520
1.000000	-2.365884	2.000000	0.362810
1.500000	-1.739980	2.000000	0.362810
1.750000	-0.873444	2.000000	0.362810
1.875000	-0.300718	2.000000	0.362810
1.875000	-0.300718	1.937500	0.019849
1.906250	-0.143255	1.937500	0.019849
1.921875	-0.062405	1.937500	0.019849
1.929688	-0.021454	1.937500	0.019849
1.933594	-0.000846	1.937500	0.019849
1.933594	-0.000846	1.935547	0.009491
1.933594	-0.000846	1.934570	0.004320
1.933594	-0.000846	1.934082	0.001736
1.933594	-0.000846	1.933838	0.000445
1.933716	-0.000201	1.933838	0.000445

Μέθοδος διχοτόμησης

😊 Πλεονεκτήματα:

- ▶ επιτυχής
- ▶ χρήση της f
- ▶ σε κάθε βήμα κερδίζουμε ένα δυαδικό ψηφίο σε ακρίβεια $\rightarrow t$ επαναλήψεις αν 2^{-t} το μηδέν της μηχανής (ή το ϵ του αλγόριθμου)

☹️ Μειονεκτήματα:

- ▶ αργή σύγκλιση

Σταθερό σημείο συναρτήσεων

- ▶ Ορισμός: Ένα σημείο x^* στο πεδίο ορισμού μιας συνάρτησης φ λέγεται **σταθερό** σημείο αν $\varphi(x^*)=x^*$.
- ▶ Πρόταση: $\varphi:[a,b]\rightarrow[a,b]$ συνεχής \rightarrow υπάρχει ένα τουλάχιστο σταθερό σημείο για την φ .
- ▶ Ορισμός: $\varphi:I\rightarrow\mathbb{R}$ ικανοποιεί συνθήκη Lipschitz, αν υπάρχει L τ.ω.

$$|\varphi(x) - \varphi(y)| \leq L|x - y|.$$

Αν $L < 1 \rightarrow \varphi$ **συστολή**.

Επαναληπτικές μέθοδοι

- ▶ Θεώρημα: Αν $\varphi:[a,b]\rightarrow[a,b]$ συνεχής, συστολή τότε η φ έχει ένα και μοναδικό σταθερό σημείο x^* . Για την ακολουθία $x_{n+1}=\varphi(x_n)$ ισχύουν:

$$|x_n - x^*| \leq L^n |x_0 - x^*| \leq L^n \max(x_0 - a, b - x_0)$$

$$|x_n - x^*| \leq \frac{L^n}{1-L} |x_1 - x_0|$$

$$|x_n - x^*| \leq \frac{L}{1-L} |x_n - x_{n-1}|$$

Παράδειγμα

Η συνάρτηση $f(x) = x^2 - x - 2$,
έχει ρίζα το σταθερό σημείο κάθε μιας από τις παρακάτω
συναρτήσεις:

$$g(x) = x^2 - 2$$

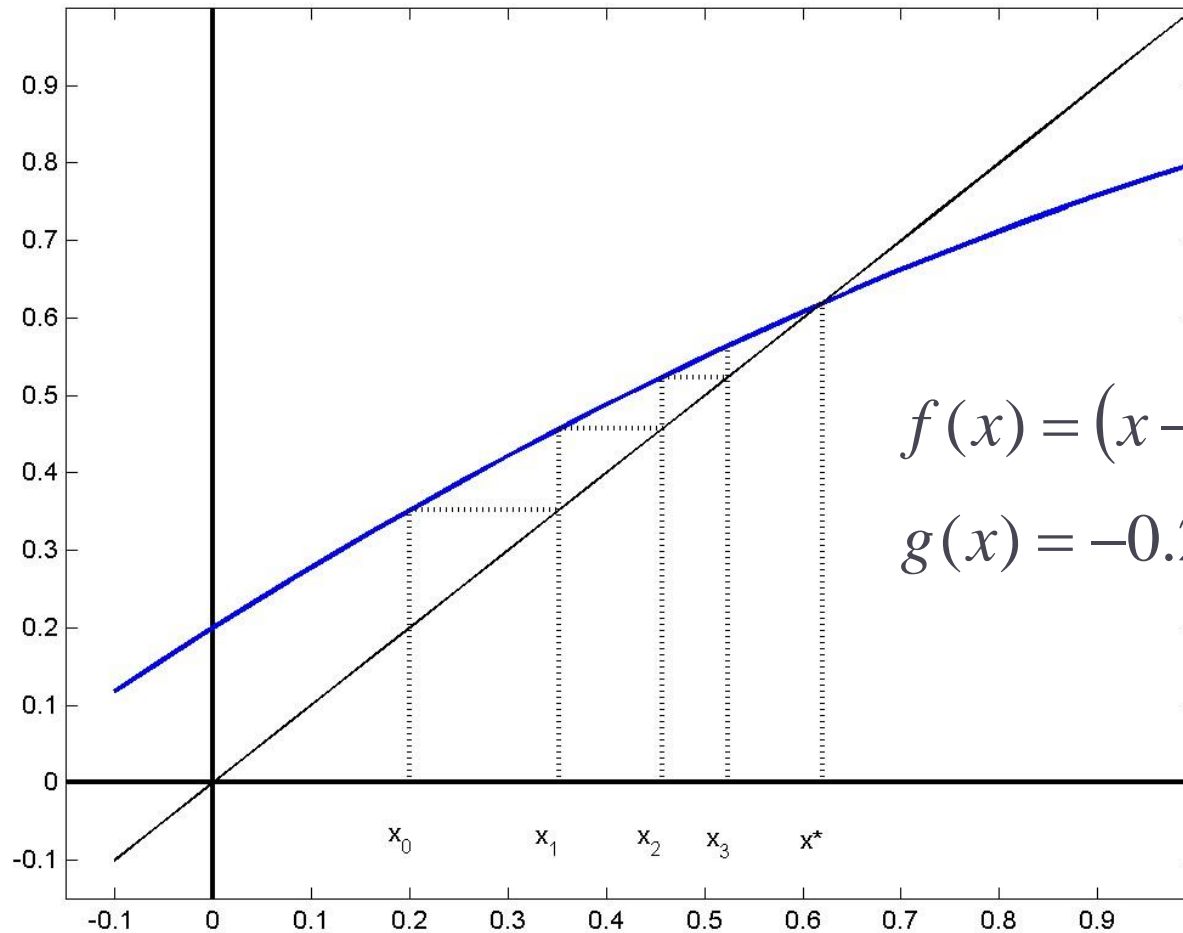
$$g(x) = \sqrt{x + 2}$$

$$g(x) = 1 + 2/x$$

$$g(x) = \frac{x^2 + 2}{2x - 1}$$

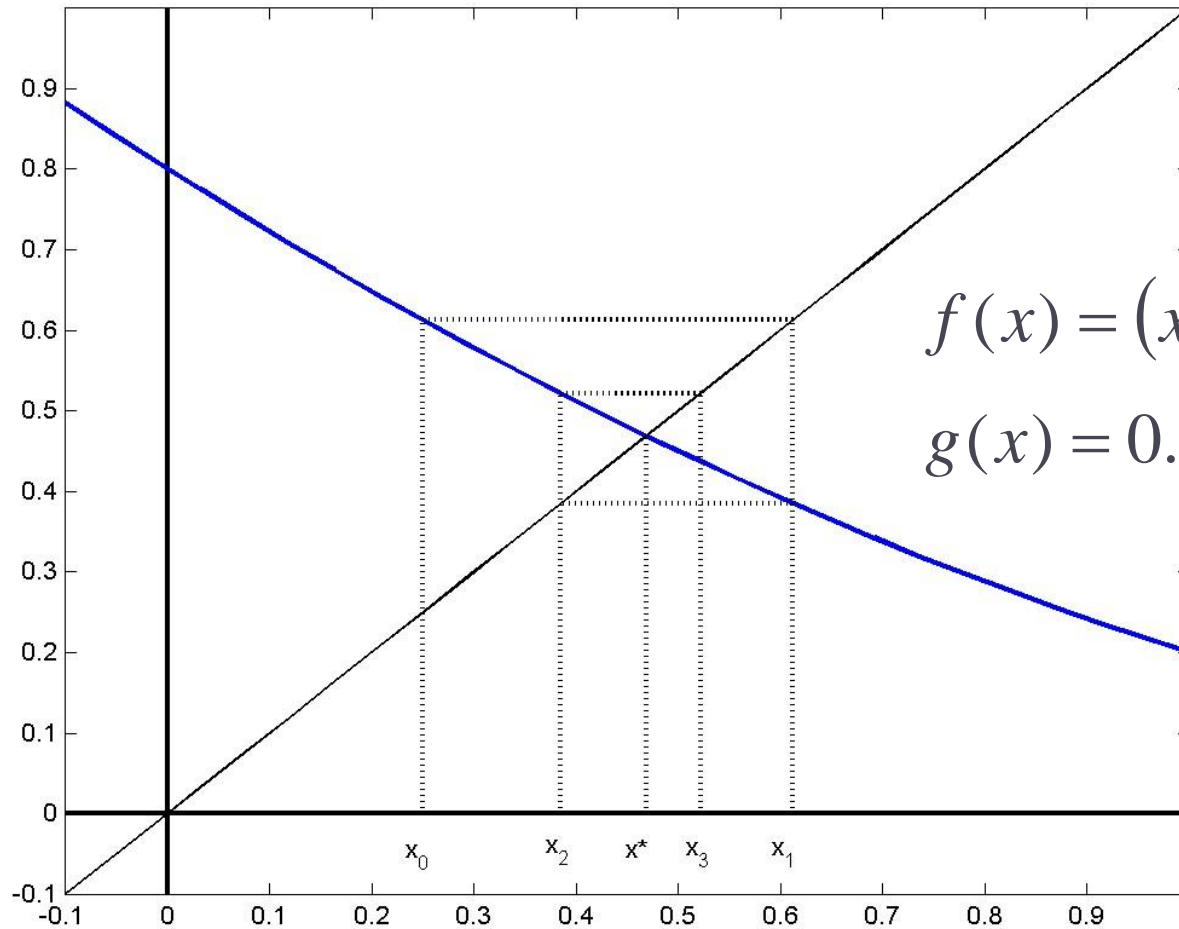
Επαναληπτικές μέθοδοι

(μονότονη σύγκλιση)



$$f(x) = (x-2)^2 + 5 \cdot x - 5 = 0$$
$$g(x) = -0.2 \cdot (x-2)^2 + 1, x_0 = 0.2$$

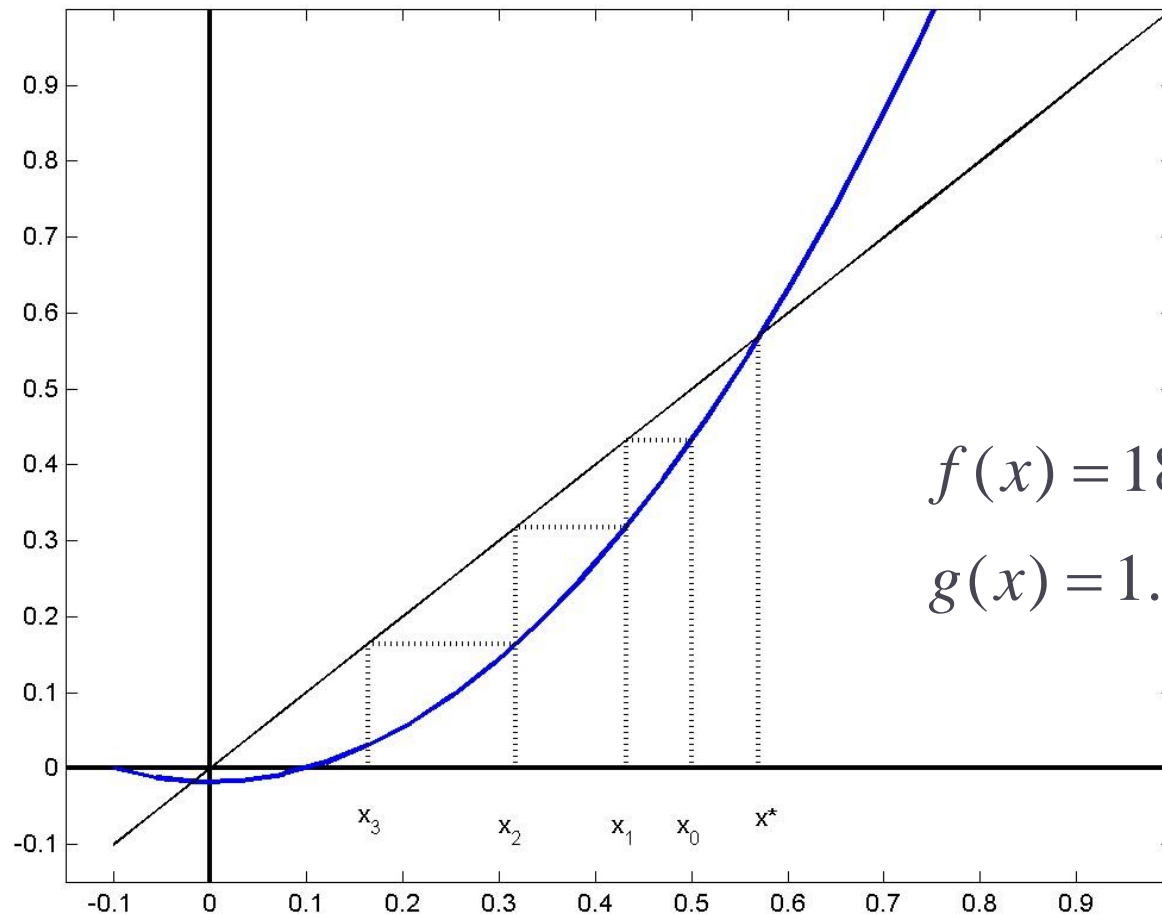
Επαναληπτικές μέθοδοι (ελικοειδής σύγκλιση)



$$f(x) = (x-2)^2 - 5 \cdot x = 0$$
$$g(x) = 0.2 \cdot (x-2)^2, x_0 = 0.25$$

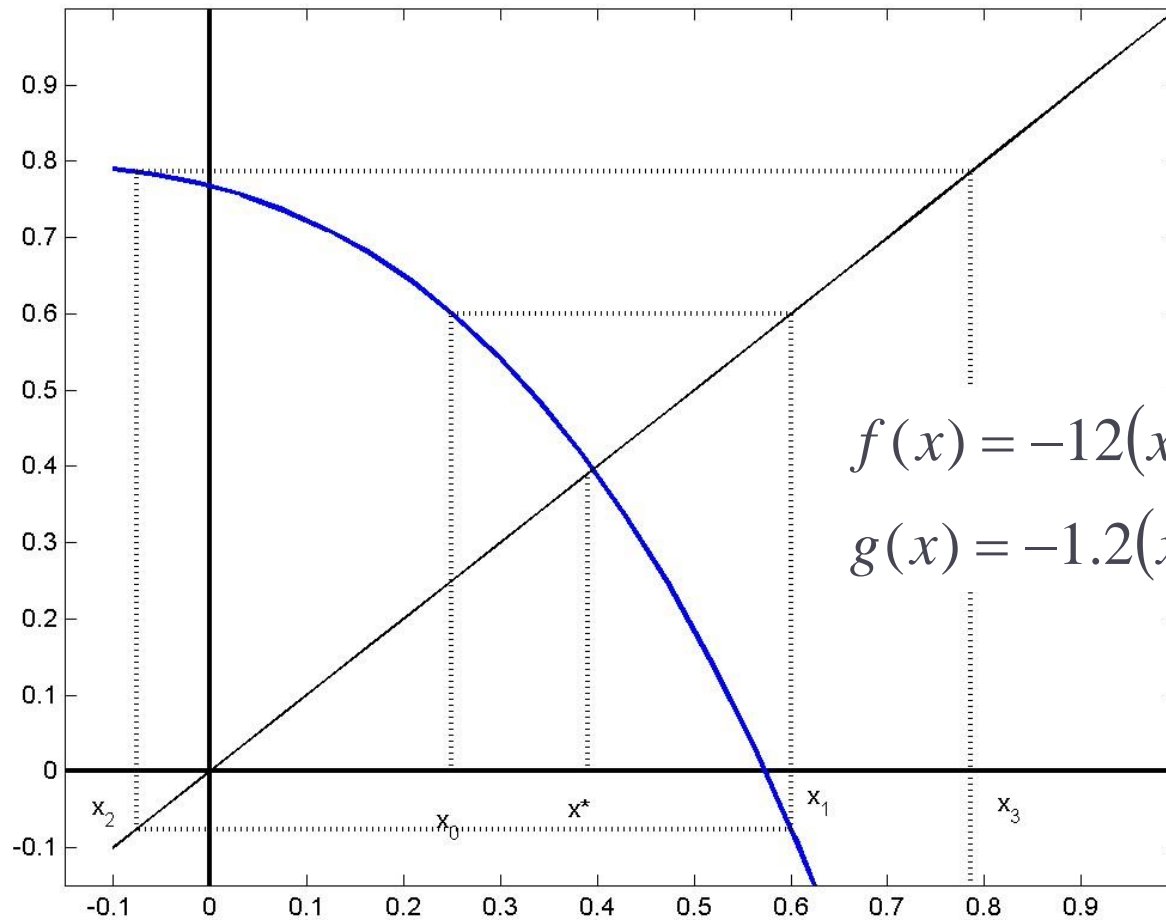
Επαναληπτικές μέθοδοι

(μονότονη απόκλιση)



$$f(x) = 18(x^2 - 0.01) - 10x = 0$$
$$g(x) = 1.8(x^2 - 0.01), \quad x_0 = 0.5$$

Επαναληπτικές μέθοδοι (ελικοειδής απόκλιση)



$$f(x) = -12(x + 0.3)^3 - 10x + 8 = 0$$
$$g(x) = -1.2(x + 0.3)^3 + 0.8, \quad x_0 = 0.25$$

HY213. ΑΡΙΘΜΗΤΙΚΗ ΑΝΑΛΥΣΗ

ΕΠΙΛΥΣΗ ΜΗ ΓΡΑΜΜΙΚΩΝ
ΕΞΙΣΩΣΕΩΝ

Π. ΤΣΟΜΠΑΝΟΠΟΥΛΟΥ

ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ΘΕΣΣΑΛΙΑΣ

ΤΜΗΜΑ ΗΛΕΚΤΡΟΛΟΓΩΝ ΜΗΧ. & ΜΗΧ. ΥΠΟΛΟΓΙΣΤΩΝ

Μέθοδος Newton

- ▶ Αρχικό πρόβλημα: $f(x^*)=0$
- ▶ Χρησιμοποιώντας τις σειρές Taylor

$$f(x+h) \approx f(x) + f'(x)h$$

δεύτερο μέλος είναι η γραμμική συνάρτηση που προσεγγίζει την f , και μηδενίζεται στο $h=-f(x)/f'(x)$

$$x_{n+1} := x_n - \frac{f(x_n)}{f'(x_n)}, \quad f'(x_n) \neq 0$$

- ▶ Έχουμε το ισοδύναμο πρόβλημα επίλυσης: $\varphi(x^*) = x^*$, με φ τ.ω.

$$\varphi(x) := x - \frac{f(x)}{f'(x)}.$$

Μέθοδος Newton

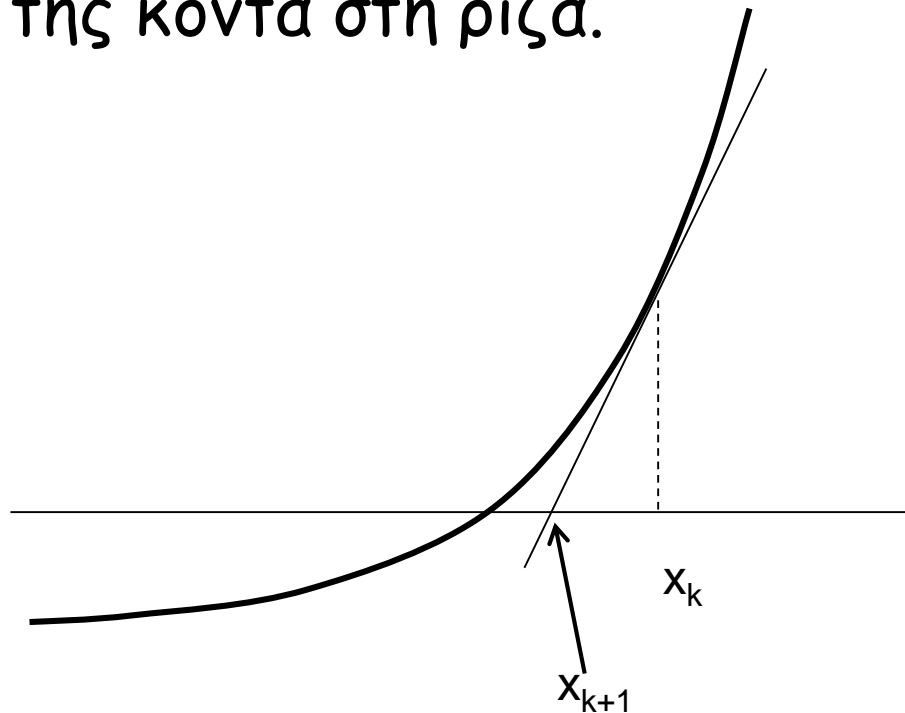
☹ Η $f:[a,b] \rightarrow \mathbb{R}$ πραγματική συνάρτηση μιας πραγματικής μεταβλητής.

😊 Αλγόριθμος:

1. Όρισε $x_0, n=0$
2. Υπολόγισε $f(x_n), f'(x_n)$
3. Υπολόγισε $h := -\frac{f(x_n)}{f'(x_n)}$
4. $x_{n+1} = x_n + h$
5. $n = n+1$
6. αν $h > \varepsilon \rightarrow$ βήμα 2

Μέθοδος Newton

- ▶ Προσεγγίζει τη συνάρτηση χρησιμοποιώντας την παράγωγο της κοντά στη ρίζα.



Μέθοδος Newton - παράδειγμα

$$f(x) = x^2 - 4\sin(x) = 0$$

$$f'(x) = 2x - 4\cos(x)$$

$$x_{k+1} = x_k - \frac{x_k^2 - 4\sin(x_k)}{2x_k - 4\cos(x_k)}, \quad x_0 = 3$$

x	f(x)	f'(x)	h
3.000000			

Μέθοδος Newton - παράδειγμα

$$f(x) = x^2 - 4 \sin(x) = 0$$

$$f'(x) = 2x - 4 \cos(x)$$

$$x_{k+1} = x_k - \frac{x_k^2 - 4 \sin(x_k)}{2x_k - 4 \cos(x_k)}, \quad x_0 = 3$$

x	f(x)	f'(x)	h
3.000000	8.435520	9.959970	-0.846942
2.153058	1.294772	6.505771	-0.199019
1.954039	0.108438	5.403795	-0.020067
1.933972	0.001152	5.288919	-0.000218
1.933754	0.000000	5.287670	0.000000

Μέθοδος Newton

- 😊 Τάξη σύγκλισης 1, αλλά τοπικά τάξη σύγκλισης 2.
- 😞 Χρειάζεται πολύ καλή αρχική τιμή x_0 .
- 😞 Η x^* πρέπει να είναι απλή ρίζα.
- 😞 Η f να είναι δυο φορές παραγωγίσιμη.

Μέθοδος Τέμνουσας

- ☹️ Αρχικό πρόβλημα: $f(x^*)=0$
- ☹️ Με τη μέθοδο Newton χρειάζεται να υπολογίζουμε και τη f' σε κάθε νέο σημείο.
- 😊 Η μέθοδος της τέμνουσας προσεγγίζει την παράγωγο με πεπερασμένες διαφορές.
- 😊 Ισοδύναμο πρόβλημα επίλυσης: $\varphi(x^*) = x^*$, με φ τ.ω.

$$x_{n+1} := x_n - \frac{f(x_n)}{\frac{f(x_n) - f(x_{n-1})}{x_n - x_{n-1}}}$$

Μέθοδος Τέμνουσας

☹ Η $f:[a,b] \rightarrow \mathbb{R}$ πραγματική συνάρτηση μιας πραγματικής μεταβλητής.

😊 Αλγόριθμος:

1. Όρισε $x_0, x_1, n=1$

2. Υπολόγισε $f(x_n), f(x_{n-1})$

3. Υπολόγισε
$$h := - \frac{f(x_n)}{\frac{f(x_n) - f(x_{n-1})}{x_n - x_{n-1}}}$$

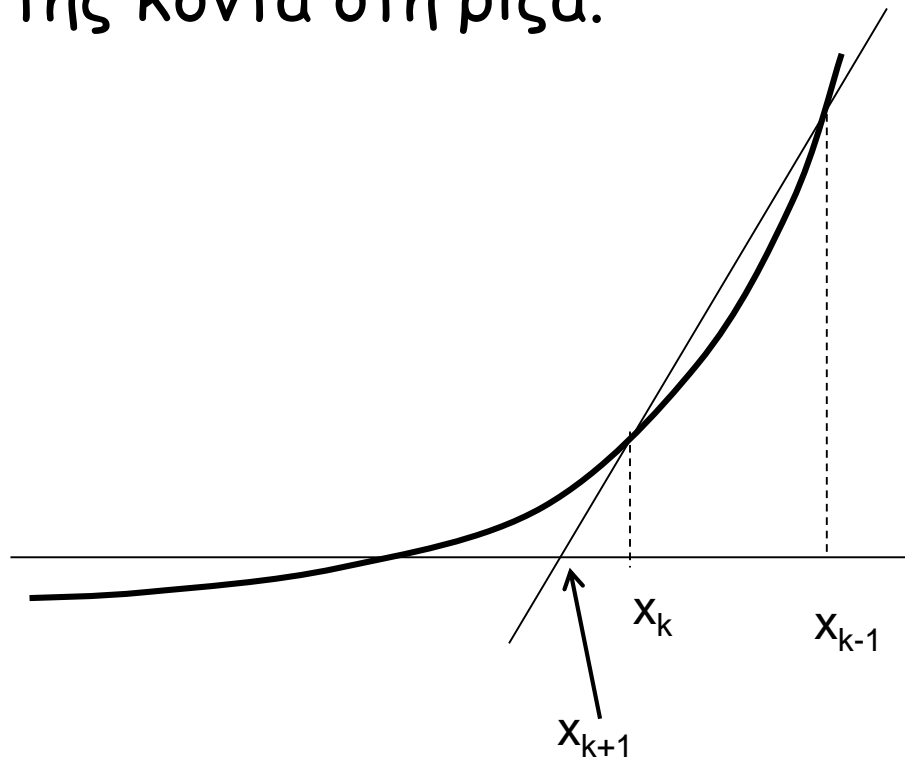
4. $x_{n+1} = x_n + h$

5. $n = n+1$

6. αν $h > \varepsilon \rightarrow$ βήμα 2

Μέθοδος Τέμνουσας

- ▶ Προσεγγίζει τη συνάρτηση χρησιμοποιώντας την παράγωγο της κοντά στη ρίζα.



Μέθοδος Τέμνουσας - παράδειγμα

$$f(x) = x^2 - 4\sin(x) = 0$$

$$x_{k+1} = x_k - \frac{(x_k^2 - 4\sin(x_k))(x_k - x_{k-1})}{x_k^2 - x_{k-1}^2 - 4(\sin(x_k) - \sin(x_{k-1}))}, \quad x_0 = 1 \text{ και } x_1 = 3$$

x	f(x)	h
1.000000	-2.365884	
3.000000	8.435520	

Μέθοδος Τέμνουσας - παράδειγμα

$$f(x) = x^2 - 4 \sin(x) = 0$$

$$x_{k+1} = x_k - \frac{(x_k^2 - 4 \sin(x_k))(x_k - x_{k-1})}{x_k^2 - x_{k-1}^2 - 4(\sin(x_k) - \sin(x_{k-1}))}, \quad x_0 = 1 \text{ και } x_1 = 3$$

x	f(x)	h
1.000000	-2.365884	
3.000000	8.435520	-1.561930
1.438070	-1.896774	0.286735
1.724805	-0.977706	0.305029
2.029833	0.534305	-0.107789
1.922044	-0.061523	0.011130
1.933174	-0.003064	-0.000583
1.933757	0.000019	-0.000004
1.933754	0.000000	0.000000

Μέθοδος Τέμνουσας

- 😊 Τάξη σύγκλισης $(1+\sqrt{5})/2 \sim 1.62$.
- 😞 Χρειάζεται πολύ καλές αρχικές τιμές (x_0, x_1) .
- 😞 Η x^* να είναι απλή ρίζα.
- 😞 Η f να είναι δυο φορές παραγωγίσιμη.
- 😊 Δεν χρειάζεται να γνωρίζουμε την f' .