

ITERAČNÍ METODY ŘEŠENÍ NELINEÁRNÍCH ROVNIC

- řešení nelineární rovnice $f(x) = 0$,
- separace kořenů = hledání intervalu $\langle a, b \rangle$, ve kterém se nachází právě jeden kořen,
- předpoklady: f spojitá na intervalu $\langle a, b \rangle$ + musí být splněna podmínka $f(a) \cdot f(b) < 0$

METODA PŮLENÍ INTERVALU (METODA BISEKCE)

- v každém kroku konstrukce intervalu $\langle a_0, b_0 \rangle \supset \langle a_1, b_1 \rangle \supset \dots \supset \langle a_n, b_n \rangle$,
- střed intervalu:

$$s_i = \frac{1}{2}(a_i + b_i), \quad i = 0, 1, \dots, n$$

- odhad chyby:

$$d_i = \frac{1}{2}(b_i - a_i), \quad i = 0, 1, \dots, n$$

- odhad počtu kroků:

$$\frac{b_0 - a_0}{2^{i+1}} < \varepsilon$$

- $f(a_i) \cdot f(s_i) < 0 \implies a_{i+1} = a_i, b_{i+1} = s_i$
- $f(s_i) \cdot f(b_i) < 0 \implies a_{i+1} = s_i, b_{i+1} = b_i$
- STOP podmínky: $d_i < \varepsilon$

METODA PROSTÉ ITERACE

- $f(x) = 0 \Leftrightarrow x = g(x)$
- ekvivalence úlohy: hledání kořene rovnice $f(x) = 0$ odpovídá hledání pevného bodu funkce $g(x)$
- podmínky:

1. $g(x) \in C(I)$
2. zobrazení do sebe: $g : I \rightarrow I$
3. $|g'(x)| < 1 \quad \forall x \in I$

- konstrukce: $x_{i+1} = g(x_i), i = 0, 1, \dots$
- geometrický význam: řešit rovnici $x = g(x)$ znamená hledat průsečík přímky $y = x$ s křivkou $y = g(x)$
- STOP podmínky: $|x_{i+1} - x_i| < \varepsilon$

NEWTONOVA METODA

- $f(x) = 0 \Leftrightarrow x = g(x)$
- konstrukce:

$$x_{i+1} = x_i - \frac{f(x_i)}{f'(x_i)}, \quad f'(x_i) \neq 0, \quad i = 0, 1, \dots$$

- geometrický význam: bod x_{i+1} je průsečík tečny ke grafu funkce $f(x)$ v bodě $[x_i, f(x_i)]$ s osou x
- Fourierovy podmínky = podmínky konvergence:

1. $f(x) \in C^2(I)$
2. $f'(x), f''(x)$ nemění znaménko na I
3. volba počáteční aproximace: x_0 tak, aby $f(x_0) \cdot f''(x_0) > 0$

- STOP podmínky: $|x_{i+1} - x_i| < \varepsilon$

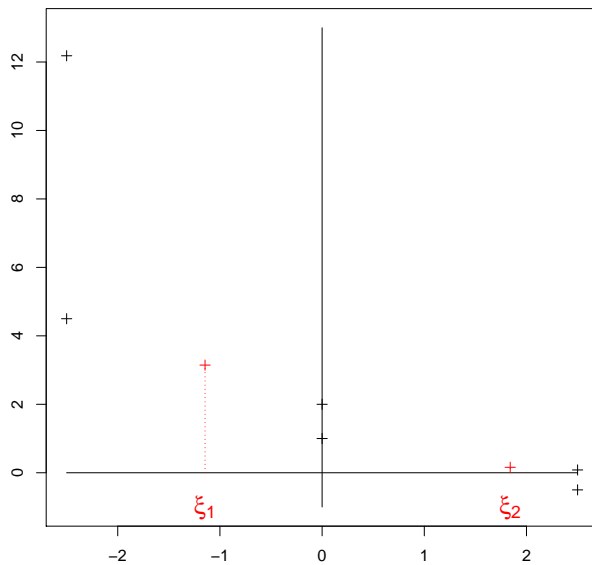
Příklad 1. Najděte všechna řešení rovnice $x + e^{-x} - 2 = 0$ s přesností 0.01

- metodou bisekce,
- metodou prosté iterace,
- Newtonovou metodou.

Řešení.

- hrubý odhad intervalu, určení počátečních aproximací:

$$x + e^{-x} - 2 = 0$$



$$f(x) = x + e^{-x} - 2$$

- interval pro odhad záporného kořene:

$$\xi_1 \in \langle -2, -1 \rangle$$

$$\left. \begin{array}{l} f(-2) = \\ f(-1) = \end{array} \right\} f(-2) \cdot f(-1) < 0$$

- interval pro odhad kladného kořene:

$$\xi_2 \in \langle 0, 2 \rangle$$

$$\left. \begin{array}{l} f(0) = \\ f(2) = \end{array} \right\} f(0) \cdot f(2) < 0$$

a) **metoda bisekce:**

$$s_i = \frac{1}{2}(a_i + b_i)$$

$$d_i = \frac{1}{2}(b_i - a_i)$$

STOP kritérium: $d_i < \varepsilon$

- odhad **záporného** kořene:

odhad počtu kroků:

$$\frac{b_0 - a_0}{2^{i+1}} < \varepsilon$$

tabulka hodnot:

i	a_i	b_i	s_i	d_i	$f(a_i)$	$f(b_i)$	$f(s_i)$
0							
1							
2							
3							
4	-1.1875	-1.125	-1.1563	0.0313	0.0914	-0.0448	0.0217
5	-1.1563	-1.125	-1.1406	0.0156	0.0217	-0.0448	-0.0119
6	-1.1563	-1.1406	-1.1484	0.0078 < 0.01	0.0217	-0.0119	0.0048

odhad záporného kořene:

$$\hat{x}_1 = -1.1484 \pm 0.0078$$

• odhad **kladného** kořene:
odhad počtu kroků:

$$\begin{aligned} \frac{b_0 - a_0}{2^{i+1}} &< \varepsilon \\ \frac{2}{2^{i+1}} &< 0.01 \\ \frac{2}{0.01} &< 2^{i+1} \\ 200 &< 2^{i+1} \\ \log_2 200 &< i + 1 \\ i &> 7.6439 - 1 \\ i &= 7 \end{aligned}$$

tabulka hodnot:

i	a_i	b_i	s_i	d_i	$f(a_i)$	$f(b_i)$	$f(s_i)$
0	0	2	1	1	-1	0.1353	-0.6321
1	1	2	1.5	0.5	-0.6321	0.1353	-0.2769
2	1.5	2	1.75	0.25	-0.2769	0.1353	-0.0762
3	1.75	2	1.875	0.125	-0.0762	0.1353	0.0284
4	1.75	1.875	1.8125	0.0625	-0.0762	0.0284	-0.0243
5	1.8125	1.875	1.8438	0.0313	-0.0243	0.0284	0.0020
6	1.8125	1.8438	1.8281	0.0156	-0.0243	0.0020	-0.0112
7	1.8281	1.8438	1.8359	0.0078 < 0.01	-0.0112	0.0020	-0.0046

odhad kladného kořene:

$$\hat{x}_2 = 1.8359 \pm 0.0078$$

b) metoda prosté iterace:

$$x_{i+1} = g(x_i), \quad i = 0, 1, \dots$$

STOP kritérium: $|x_{i+1} - x_i| < \varepsilon$

• odhad **záporného** kořene:
volba iterační funkce:

$$1. \quad x + e^{-x} - 2 = 0$$

$$g(x) = x =$$

, podmínky:

2. $x + e^{-x} - 2 = 0$

$g(x) = x =$, podmínky:

i	x_i	$x_{i+1} = g(x_i)$	$ x_{i+1} - x_i $
0			
1			
2			
3	-1.1693	-1.1535	0.0158
4	-1.1535	-1.1485	0.0050 < 0.01

odhad záporného kořene:

$\hat{x}_1 = -1.1485 \pm 0.0050$

Pozn. Tabulka hodnot pro jinou volbu počáteční aproximace:

i	x_i	$x_{i+1} = g(x_i)$	$ x_{i+1} - x_i $
0	-1	-1.0986	0.0986
1	-1.0986	-1.1310	0.0323
2	-1.1310	-1.1413	0.0104
3	-1.1413	-1.1446	0.0033 < 0.01

odhad záporného kořene:

$\hat{x}_1 = -1.1446 \pm 0.0033$

- odhad **kladného** kořene:

volba iterační funkce:

$$x + e^{-x} - 2 = 0$$

$$g(x) = x = 2 - e^{-x}, \text{ podmínky:}$$

1. $g(x) \in C\langle 0, 2 \rangle$
2. $g(0) = 1 \in \langle 0, 2 \rangle$
 $g(2) = 1.8647 \in \langle 0, 2 \rangle$
 extrém? $g'(x) = e^{-x} \dots$ nemá extrém na $\langle 0, 2 \rangle$
3. $|g'(0)| = 1 \rightarrow$ posunout levý krajní bod intervalu do 0.1 \rightarrow nový interval $\langle 0.1, 2 \rangle$ + dodatečné ověření podmínek:
 $g(0.1) = 1.0952 \in \langle 0.1, 2 \rangle$, $|g'(0.1)| = 0.9048 < 1$
 $|g'(2)| = 0.1353 < 1$
 extrém? $g''(x) = -e^{-x} \dots$ nemá extrém na $\langle 0.1, 2 \rangle$

i	x_i	$x_{i+1} = g(x_i)$	$ x_{i+1} - x_i $
0	0.1	1.0952	0.9952
1	1.0952	1.6655	0.5704
2	1.6655	1.8109	0.1454
3	1.8109	1.8365	0.0256
4	1.8365	1.8406	0.0041 < 0.01

odhad kladného kořene:

$$\hat{x}_2 = 1.8406 \pm 0.0041$$

Pozn. Tabulka hodnot pro jinou volbu počáteční aproximace:

i	x_i	$x_{i+1} = g(x_i)$	$ x_{i+1} - x_i $
0	2	1.8647	0.1353
1	1.8647	1.8451	0.0196
2	1.8451	1.8420	0.0031 < 0.01

odhad kladného kořene:

$$\hat{x}_2 = 1.8420 \pm 0.0031$$

c) Newtonova metoda

$$x_{i+1} = x_i - \frac{f(x_i)}{f'(x_i)}, \quad i = 0, 1, \dots$$

STOP kritérium: $|x_{i+1} - x_i| < \varepsilon$

- odhad **záporného** kořene:

Fourierovy podmínky:

iterační proces:

i	x_i	x_{i+1}	$ x_{i+1} - x_i $
0			
1			0.2622
2	-1.2073	-1.1488	0.0585
3	-1.1488	-1.1462	0.0026 < 0.01

odhad záporného kořene:

$$\hat{x}_1 = -1.1462 \pm 0.0026$$

- odhad **kladného** kořene

Fourierovy podmínky:

- $f(x) = x + e^{-x} - 2 \in C(\langle 0, 2 \rangle)$
 $f'(x) = 1 - e^{-x} \in C(\langle 0, 2 \rangle)$
 $f''(x) = e^{-x} \in C(\langle 0, 2 \rangle)$
- $f'(0) = 0$
 $f'(2) = 0.8647$
 extrém? $f''(x) = e^{-x}$ nemá extrém na $\langle 0, 2 \rangle$
 $f''(0) = 1$
 $f''(2) = 0.1353$
 extrém? $f'''(x) = -e^{-x}$ nemá extrém na $\langle 0, 2 \rangle$
- volba počáteční aproximace x_0 :
 $f(0) = -1$
 $f(2) = 0.1353 \rightarrow f(2) \cdot f''(2) > 0 \rightarrow x_0 = 2$

iterační proces:

i	x_i	$x_{i+1} = g(x_i)$	$ x_{i+1} - x_i $
0	2	1.8435	0.1565
1	1.8435	1.8414	0.0021 < 0.01

odhad kladného kořene:

$$\hat{x}_2 = 1.8414 \pm 0.0021$$

Řešený příklad z praxe. [1]

Parašutista padá z klidového stavu. Jeho rychlost v je dána v závislosti na čase rovnicí

$$v(t) = \frac{gm}{c} (1 - e^{-\frac{c}{m}t}),$$

kde $g = 9.8 \text{ m}\cdot\text{s}^{-2}$ a $c = 13 \text{ kg}\cdot\text{s}^{-1}$. Předpokládejme, že parašutista váží $m = 95 \text{ kg}$. Odhadněte dobu, po které parašutista dosáhne rychlosti $35 \text{ m}\cdot\text{s}^{-1}$



Zdroj: [2]

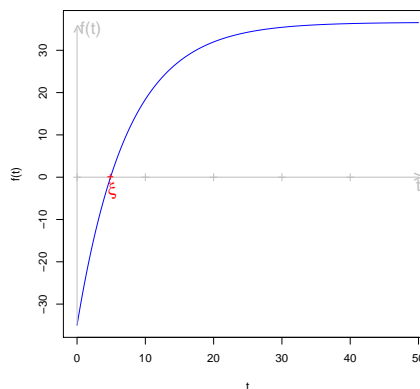
- analyticky,
- metodou bisekce (s přesností $\varepsilon < 10^{-3}$),
- metodou prosté iterace (s přesností $\varepsilon < 10^{-3}$),
- Newtonovou metodou (s přesností $\varepsilon < 10^{-3}$).

Řešení.

- a) **analytické řešení:**

Řešíme nelineární rovnici $f(t) = 0$, kde $f(t) = \frac{gm}{c} (1 - e^{-\frac{c}{m}t}) - v$:

$$\begin{aligned} v &= \frac{gm}{c} (1 - e^{-\frac{c}{m}t}) \\ \frac{cv}{gm} &= 1 - e^{-\frac{c}{m}t} \\ e^{-\frac{c}{m}t} &= 1 - \frac{cv}{gm} \\ -\frac{c}{m}t &= \ln\left(1 - \frac{cv}{gm}\right) \\ t &= -\frac{m}{c} \ln\left(1 - \frac{cv}{gm}\right) \\ t &\doteq 4.9023 \text{ s} \end{aligned}$$



- b) **metoda bisekce:** např. $I = \langle 3, 6 \rangle$

i	a_i	b_i	s_i	d_i	$f(a_i)$	$f(b_i)$	$f(s_i)$
0	3.0000	6.0000	4.5000	1.5000	-10.8872	5.1069	-2.0723
1	4.5000	6.0000	5.2500	0.7500	-2.0723	5.1069	1.7014
2	4.5000	5.2500	4.8750	0.3750	-2.0723	1.7014	-0.1371
3	4.8750	5.2500	5.0625	0.1875	-0.1371	1.7014	0.7939
4	4.8750	5.0625	4.9688	0.0938	-0.1371	0.7939	0.3314
5	4.8750	4.9688	4.9219	0.0469	-0.1371	0.3314	0.0979
6	4.8750	4.9219	4.8984	0.0234	-0.1371	0.0979	-0.0194
7	4.8984	4.9219	4.9102	0.0117	-0.0194	0.0979	0.0393
8	4.8984	4.9102	4.9043	0.0059	-0.0194	0.0393	0.0100
9	4.8984	4.9043	4.9014	0.0029	-0.0194	0.0100	-0.0047
10	4.9014	4.9043	4.9028	0.0015	-0.0047	0.0100	0.0027
11	4.9014	4.9028	4.9021	0.0007	-0.0047	0.0027	-0.0010

odhad kořene:

$$\hat{t} = 4.9021 \pm 0.0007$$

c) **metoda prosté iterace:**Volba iterační funkce: $g(t) = \frac{gm}{gm - cv} te^{-\frac{c}{m}t}$, $I = \langle 3, 6 \rangle$

Ověření podmínek:

1. $g(t) \in C(\langle 3, 6 \rangle)$

2. $g(3) \doteq 3.8920 \in \langle 3, 6 \rangle$

$g(6) \doteq 5.1632 \in \langle 3, 6 \rangle$

Má funkce $g(t)$ na intervalu $\langle 3, 6 \rangle$ extrém?

$$g'(t) = \frac{gm}{gm - cv} e^{-\frac{c}{m}t} \left(1 - \frac{c}{m}t\right) = 0$$

$$\Rightarrow e^{-\frac{c}{m}t} = 0 \vee 1 - \frac{c}{m}t = 0$$

může nastat pouze 2. situace: $1 - \frac{c}{m}t = 0 \Rightarrow t = \frac{m}{c} \doteq 7.3077 \notin \langle 3, 6 \rangle$ \Rightarrow jedná se o zobrazení do sebe

3. $g'(3) \doteq 0.7647 < 1$

$g'(6) \doteq 0.1540 < 1$

Má funkce $g'(t)$ na intervalu $\langle 3, 6 \rangle$ extrém?

$$g''(t) = \frac{gm}{gm - cv} \left(e^{-\frac{c}{m}t} \cdot \frac{-c}{m} \left(1 - \frac{c}{m}t\right) + e^{-\frac{c}{m}t} \cdot \frac{-c}{m} \right) = 0$$

$$\frac{gm}{gm - cv} \cdot \frac{-c}{m} \left(2 - \frac{c}{m}t\right) e^{-\frac{c}{m}t} = 0$$

$$2 - \frac{c}{m}t = 0 \vee e^{-\frac{c}{m}t} = 0$$

může nastat pouze 1. situace: $2 - \frac{c}{m}t = 0 \Rightarrow t = 2\frac{m}{c} \doteq 14.6154 \notin \langle 3, 6 \rangle$ \Rightarrow platí $|g'(t)| < 1 \quad \forall t \in \langle 3, 6 \rangle$

Výpočet:

i	t_i	$t_{i+1} = g(t_i)$	$ t_{i+1} - t_i $
0	3.0000	3.8920	0.8920
1	3.8920	4.4691	0.5770
2	4.4691	4.7420	0.2730
3	4.7420	4.8472	0.1052
4	4.8472	4.8839	0.0367
5	4.8839	4.8962	0.0123
6	4.8962	4.9003	0.0041
7	4.9003	4.9016	0.0013
8	4.9016	4.9021	0.0004 < 0.01

odhad kořene:

$\hat{t} = 4.9021 \pm 0.0004$

d) **Newtonova metoda:**

Vycházíme z rovnice

$$v = \frac{gm}{c} (1 - e^{-\frac{c}{m}t})$$

a řešíme $f(t) = 0$, kde

$$f(t) = \frac{gm}{c} (1 - e^{-\frac{c}{m}t}) - v.$$

Volíme interval $I = \langle 3, 6 \rangle$.

Ověření Fourierových podmínek:

$$1. f(t) = \frac{gm}{c} (1 - e^{-\frac{c}{m}t}) - v \in C(\langle 3, 6 \rangle)$$

$$f'(t) = \frac{gm}{c} (-e^{-\frac{c}{m}t}) \cdot \frac{-c}{m} = \dots = ge^{-\frac{c}{m}t} \in C(\langle 3, 6 \rangle)$$

$$f''(t) = -\frac{cg}{m} e^{-\frac{c}{m}t} \in C(\langle 3, 6 \rangle)$$

$$2. f'(3) = 6.5004$$

$$f'(6) = 4.3117$$

extrém? exponenciála monotónní funkce \Rightarrow nemá extrém na I

$$f''(3) = -0.8895$$

$$f''(6) = -0.5900$$

extrém? exponenciála monotónní funkce \Rightarrow nemá extrém na I 3. volba počáteční aproximace x_0 :

$$f(3) = -10.8872$$

$$f(6) = 5.1069 \rightarrow f(3) \cdot f''(3) > 0 \rightarrow x_0 = 3$$

iterační proces:

i	x_i	$x_{i+1} = g(x_i)$	$ x_{i+1} - x_i $
0	3.0000	4.6749	1.6749
1	4.6749	4.8988	0.2239
2	4.8988	4.9023	0.0035
3	4.9023	4.9023	0.00000084 < 0.001

odhad kořene:

$$\hat{t} = \mathbf{4.9023} \pm \mathbf{0.0000}$$

Zdroje:[1] Chapra, S. C., Canale, R. *Numerical Methods for Engineers*. USA, 5 ed. 2006.[2] <http://www.shapesticker.eu/Samolepka-Parasutista-d49.htm?tab=description> (září 2017)