

工程数学基础复习重点（仅供参考）

一、矩阵理论部分（约 40%）

1、常用矩阵范数

定理 2.2.5 $A = (a_{ij}) \in R^{n \times n}$, 则

$$\|A\|_{\infty} = \max_{1 \leq i \leq n} \sum_{j=1}^n |a_{ij}|;$$

$$\|A\|_2 = \sqrt{\lambda_1} \text{ (其中 } \lambda_1 \text{ 为 } A^T A \text{ 的最大特征值)}$$

$$\|A\|_1 = \max_{1 \leq j \leq n} \sum_{i=1}^n |a_{ij}|$$

$$\|A\|_F = \sqrt{\sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n |a_{ij}|^2} = \sqrt{\text{tr}^{[1]}(A^H A)} = \sqrt{(A^H A) \text{ 所有特征值之和}}$$

分别称之为矩阵A的**行范数**、**谱范数**、**列范数**、**F 范数**。

2、矩阵的减号逆、加号逆的求法及性质，利用相关性质解题

$$AA^-A = A, \quad \text{rank}(AA^-) = \text{rank}(A^-A) = \text{rank}(A),$$

$$AA^+A = A, \quad \text{rank}(AA^+) = \text{rank}(A^+A) = \text{rank}(A) = \text{rank}(A^+),$$

$$(A^-A)^2 = A^-A, \quad (AA^-)^2 = AA^-, \quad (A^+A)^2 = A^+A, \quad (AA^+)^2 = AA^+$$

定义 1.4.1 设 $A \in C^{m \times n}$, 矩阵 $G \in C^{n \times m}$, 若 G 满足如下方程

$$AGA = A, \quad GAG = G, \quad (AG)^H = AG, \quad (GA)^H = GA$$

则称 G 为 A 的**加号逆**，或极小范数最小二乘逆，记作 A^+ 。

矛盾方程 $Ax = b$ 的最小二乘解中范数最小的一个称为方程 $Ax = b$ 的**极小范数最小二乘解**。

定理 1.4.3 设 $A \in C^{m \times n}$, $\text{rank}(A) = r > 0$, $A = BC$ 为 A 的满秩分解，则

$$A^+ = C^H(CC^H)^{-1}(B^HB)^{-1}B^H.$$

定理 1.4.5 方程 $Ax = b$ 的极小范数最小二乘解 x 唯一存在, 且 $x = A^+b$.

求如下方程组

$$\begin{cases} x_1 + 2x_2 - x_3 + 2x_4 = 1 \\ 2x_1 + 4x_2 + x_3 + x_4 = 5 \\ -x_1 - 2x_2 - 2x_3 + x_4 = 4 \end{cases}$$

的极小范数最小二乘解。

3、子空间的结构及基与维数

7、 $(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4)$ 是线性空间 V 的基, $V_1 = \text{span}(\alpha_1 - \alpha_2 + \alpha_4, \alpha_2 - \alpha_3)$,

$V_2 = \text{span}(\alpha_1 + \alpha_4, \alpha_2 + \alpha_3, \alpha_1 + \alpha_2 + \alpha_3 + \alpha_4)$, 则 $V_1 + V_2$ 的维数是_____。

A = `>> rref(A)`

$$\begin{array}{ccccc|ccccc} 1 & 0 & 1 & 0 & 1 & 1 & 0 & 0 & -2 & -2 \\ -1 & 1 & 0 & 1 & 1 & 0 & 1 & 0 & -1 & -1 \\ 0 & -1 & 0 & 1 & 1 & 0 & 0 & 1 & 2 & 3 \\ 1 & 0 & 1 & 0 & 1 & 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{array}$$

二、 (15 分) 设 $V_1 = \text{span}\{1+2t+t^2, -1+t+t^2+t^3\}$, $V_2 = \text{span}\{2-t+t^3, 1-t+3t^2+7t^3\}$,

(1) 求 $V_1 + V_2$ 和 $V_1 \cap V_2$ 的基与维数;

(2) $V_1 + V_2$ 是否为直和, 如果是, 说明理由, 如果不是, 将 $V_1 + V_2$ 的基扩充成 $R_3(t)$ 的基。

(1) $\dim(V_1 + V_2) = 3$, $\{a_1, a_2, b_1\}$, (注: $b_2 = -a_1 + 4a_2 + 3b_1$)

$\dim(V_1 \cap V_2) = 1$, $\{a_1 - 4a_2 = 3b_1 - b_2\}$

(2) 不是直和, 扩充 t^3 (不唯一)

4、矩阵最小多项式、矩阵的 Jordan 标准型、矩阵函数及其 Jordan 标准型的求法

定理 3.3.3 n 阶矩阵 A 的最小多项式 $\psi(\lambda)$ 唯一存在, 且等于特征矩阵

$\lambda E - A$ 的第 n 个不变因子 $d_n(\lambda)$ 。

矩阵的 Jordan 标准型 (秩是关键), 矩阵函数的 Jordan 标准型的求法,

矩阵函数的求法 (待定系数法, 关键弄清楚函数与矩阵的谱)

三、设 $A = \begin{pmatrix} 4 & 3 & -4 \\ -1 & 0 & 2 \\ 1 & 1 & 0 \end{pmatrix}$

(1) (4 分) 求 A 的最小多项式

(2) (4 分) 求 A 的 Jordan 标准型。

(3) (4 分) 求 $\sin(2A)$ 。

(1) $|\lambda E - A| = (\lambda - 2)(\lambda - 1)^2, r(E - A) = 2, \varphi(\lambda) = (\lambda - 2)(\lambda - 1)^2$

(2) $\begin{pmatrix} 2 & & \\ & 1 & 1 \\ & & 1 \end{pmatrix}$

(3) $\sin(2A) = a_0 + a_1(2A) + a_2(2A)^2$

$a_0 = -4\cos(2) + \sin(4), a_1 = 3\cos(2) - \sin(4) + \sin(2), a_2 = -1/2\cos(2) + 1/4\sin(4) - 1/4\sin(2)$

5、内积空间抽象向量的长度及向量间的夹角

一、设 $A = \begin{pmatrix} 1 & -1 & 0 & 0 \\ -1 & 4 & 3 & 0 \\ 0 & 3 & 12 & 9 \\ 0 & 0 & 9 & 12 \end{pmatrix}, b = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 12 \\ 9 \end{pmatrix}$ 。

(1) (6 分) 设内积空间 V 在基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4$ 下的度量矩阵是 A ,

求 $\alpha_1 - \alpha_2 + 2\alpha_3$ 与 $2\alpha_2 - \alpha_3 + 3\alpha_4$ 的夹角。

$(b_1, b_2) = 35, (b_1, b_1) = 43, (b_2, b_2) = 70,$

6、线性变换的表示矩阵及其值域和核空间的结构、不变子空间的求法

三、已知 $A = \begin{pmatrix} 2 & 1 & 0 & 0 \\ 1 & 3 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & \lambda+1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & \lambda(\lambda+1) \end{pmatrix}$.

(1)、(7 分) 若 A 是内积空间 V 在一组基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4$ 下的度量矩阵, 则 λ 需满足什么条件?

此时, 求 $\alpha_1 - \alpha_2$ 与 $\alpha_2 + \alpha_3 + 3\alpha_4$ 的夹角。

(2)、(8 分) 设 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4$ 线性空间 V 的一组基. V 上的线性变换 T 在基 $\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4$ 下的表示矩阵是 A , 若 $R(T)$ 的维数是 3, 则 λ 需满足什么条件? 此时求 $N(T)$ 。

(2) $R(T) = R(A), \lambda = 0$

$N(T): AX=0$ 的解空间 $= \text{span}\{a_4\}$

$R(T) = \text{span}\{2a_1 + a_2, a_1 + 3a_2, a_3\}$

7、矩阵的 LU 分解。

二、数值分析部分 (约 40%)

1、线性方程组迭代格式构造及收敛判定

设 $A \in R^{n \times n}$ 非奇异, 解方程组 $Ax = b$, 可将方程组改写成同解的方程组

$$x = Bx + f, \quad (4.1.1)$$

并由此构造迭代法

$$x^{(k+1)} = Bx^{(k)} + f, \quad (4.1.2)$$

定理4.1.1 迭代法 $x^{(k+1)} = Bx^{(k)} + f, \forall x^{(0)} \in R^n$ 收敛的充分必要条件是 $\rho(B) < 1$, 其中 $\rho(B)$ 为矩阵 B 的谱半径。

由于计算 $\rho(B)$ 较困难, 可先利用充分条件 $\rho(B) \leq \|B\| < 1$ 判断迭代法的收敛性。

定义4.1.2 称 $R(B) = -\ln \rho(B)$ 为迭代法 $x^{(k+1)} = Bx^{(k)} + f$ 的渐近收敛速度。

2、非线性方程全局和局部迭代格式构造及收敛判定

将非线性方程 $f(x)=0$ 化为等价形式 $x=\varphi(x)$, 构造迭代格式 $x_{k+1}=\varphi(x_k)$, $k=0,1,\dots$

定理4.3.2 若迭代函数 $\varphi(x)$ 在有限区间 $[a,b]$ 上满足下列两个条件:

(1) 对任意的 $x \in [a,b]$, 有 $a \leq \varphi(x) \leq b$;

(2) $\varphi'(x)$ 在 $[a,b]$ 上存在, 且 $\varphi'(x) \neq 0, |\varphi'(x)| \leq L < 1$, 则对任意初值 $x_0 \in [a,b]$,

序列 $\{x_k\}$ 收敛到方程 $x=\varphi(x)$ 的根 x^* , 且有估计式

$$|x^* - x_k| \leq \frac{L}{1-L} |x_k - x_{k-1}|, \quad |x^* - x_k| \leq \frac{L^k}{1-L} |x_1 - x_0|.$$

定理4.3.3 (p阶收敛的判定定理)

设 $\{x_k\}$ 是由迭代格式 $x_{k+1}=\varphi(x_k)$ ($k=0,1,\dots$) 产生的序列,

x^* 是方程 $x=\varphi(x)$ 的根。若迭代函数 $\varphi(x)$ 在 x^*

邻近有连续的 p 阶导数, 且满足条件:

(1) $|\varphi'(x^*)| < 1$;

(2) $\varphi^{(m-1)}(x^*)=0, m=2,3,\dots,p$, 但 $\varphi^{(p)}(x^*) \neq 0$;

则序列 $\{x_k\}$ 是 p 阶收敛的, 其中 $p(p \geq 1)$ 是整数。

练习 2: 求解方程 $x^2 - 5 = 0$, 可以构造一个迭代格式

$$x_{k+1} = x_k + c(x_k^2 - 5), \quad k=0,1,2,\dots$$

其中 c 为非零的常数,

(1) 当 c 取何值时, 由 $x_{k+1} = x_k + c(x_k^2 - 5)$, $k=0,1,2,\dots$ 产生的迭代序列收敛到 $\sqrt{5}$.

(2) c 取何值时收敛最快?

3、函数最佳平方逼近定义及最佳平方逼近多项式的构造, 正交多项式

在内积空间 $C[a,b]$ 中, 取 $n+1$ 个线性无关函数 $\varphi_0(x), \varphi_1(x), \dots, \varphi_n(x)$ 张成 $C[a,b]$ 的子空间

$$\Phi = \text{span}\{\varphi_0(x), \varphi_1(x), \dots, \varphi_n(x)\} \subset C[a,b]$$

设 $f(x) \in C[a,b]$, 但 $f(x) \notin \Phi$, 在 Φ 中寻找一个函数 $s^*(x) = \sum_{j=0}^n c_j \varphi_j(x) \in \Phi$

使得 $\|f(x) - s^*(x)\|_2^2 = \min_{\varphi(x) \in \Phi} \|f(x) - \varphi(x)\|_2^2$

若 $s^*(x)$ 存在, 则称其为 $f(x)$ 在 $[a,b]$ 上的最佳平方逼近函数。

如何具体构造 $s^*(x)$: 设 $s^*(x) = \sum_{j=0}^n c_j \varphi_j(x)$

$$\text{记 } h(c_0, c_1, \dots, c_n) = \|f(x) - s^*(x)\|_2^2 = \int_a^b \rho(x) \left(f(x) - \sum_{j=0}^n c_j \varphi_j(x) \right)^2 dx$$

求解 $s^*(x) \in \Phi$, 使 $\|f(x) - s^*(x)\|_2^2 = \min \Leftrightarrow$ 求多元函数 $h(c_0, c_1, \dots, c_n)$ 的极小值。

\Leftrightarrow 解法方程 $GC = F$

$$\text{其中 } G = \begin{bmatrix} (\varphi_0, \varphi_0) & (\varphi_0, \varphi_1) & \dots & (\varphi_0, \varphi_n) \\ (\varphi_1, \varphi_0) & (\varphi_1, \varphi_1) & \dots & (\varphi_1, \varphi_n) \\ \dots & \dots & \dots & \dots \\ (\varphi_n, \varphi_0) & (\varphi_n, \varphi_1) & \dots & (\varphi_n, \varphi_n) \end{bmatrix} \in R^{(n+1) \times (n+1)} \quad \begin{matrix} F = ((f, \varphi_0), (f, \varphi_1), \dots, (f, \varphi_n))^T \in R^{n+1} \\ C = (c_0, c_1, \dots, c_n)^T \in R^{n+1} \end{matrix}$$

设 $\{\varphi_j(x)\}(j=0,1,\dots,n)$ 是区间 $[a,b]$ 上带权 $\rho(x)$ 的正交多项式组,取 Φ 为

$$\Phi = \text{span}\{\varphi_0(x), \varphi_1(x), \dots, \varphi_n(x)\}$$

则法方程为

$$\begin{bmatrix} (\varphi_0, \varphi_0) & & & \\ & (\varphi_1, \varphi_1) & & \\ & & \dots & \\ & & & (\varphi_n, \varphi_n) \end{bmatrix} \begin{bmatrix} c_0 \\ c_1 \\ \dots \\ c_n \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} (f, \varphi_0) \\ (f, \varphi_1) \\ \vdots \\ (f, \varphi_n) \end{bmatrix}$$

练习:

$f(x) = x^3$ 在 $[-1,1]$ 上关于 $\rho(x) = 1$ 的一次最佳平方逼近多项式是_____。

4、数值积分公式的代数精度，利用代数精度构造数值积分公式，数值微分公式
误差分析方法

定义5.3.2 如果当 $f(x) = x^k (k=0,1,\dots,m)$ 时, $\int_a^b x^k dx = \sum_{i=0}^n A_i x_i^k$ 精确成立;

而当 $f(x) = x^{m+1}$ 时, $\int_a^b x^{m+1} dx \neq \sum_{i=0}^n A_i x_i^{m+1}$, 那么称该求积公式**具有 m 次代数精度**。

Newton-Cotes 求积公式 ($n+1$ 个节点)

$$\int_a^b f(x)dx = (b-a) \sum_{i=0}^n C_i^{(n)} f(x_i^{(n)}) + E_n(f)$$

$$1^\circ \quad n \text{ 为偶数} \quad E_n(f) = C_n h^{n+3} f^{(n+2)}(\eta), h = \frac{b-a}{n} \quad \eta \in [a,b]$$

$$2^\circ \quad n \text{ 为奇数} \quad E_n(f) = C_n h^{n+2} f^{(n+1)}(\eta), \quad \eta \in [a,b]$$

由此可以看出,

1° n 为偶数时, Newton-Cotes 求积公式的代数精度为 $n+1$.

例如: Simpson 公式的代数精度为 3.

2° n 为奇数时, Newton-Cotes 求积公式的代数精度为 n .

例如: 梯形公式的代数精度为 1.

知乎 @Reechooo
https://blog.csdn.net/q_41773234

七、(10 分) 确定求积公式 $\int_{-1}^1 f(x)dx \approx [f(-1) + 2f(x_1) + 3f(x_2)]/3$ 中的待定参数, 使其代数精度尽量高, 并指明所构造出的求积公式所具有的代数精度。

数值微分

$$f'(x_i) - \frac{f(x_i+h) - f(x_i)}{h} = -\frac{h}{2} f''(x_i + \theta_1 h), 0 \leq \theta_1 \leq 1.$$

$$f'(x_i) - \frac{f(x_i) - f(x_i-h)}{h} = \frac{h}{2} f''(x_i - \theta_2 h), 0 \leq \theta_2 \leq 1.$$

$$f'(x_i) - \frac{f(x_i+h) - f(x_i-h)}{2h} = -\frac{h^2}{6} f^{(3)}(x_i - \theta_3 h), -1 \leq \theta_3 \leq 1.$$

5、拉格朗日插值多项式构造及其余项、插值基性质

拉格朗日插值多项式

$$L_n(x) = \sum_{i=0}^n l_i(x) f(x_i), \quad \text{其中 } l_i(x) = \frac{(x-x_0) \cdots (x-x_{i-1})(x-x_{i+1}) \cdots (x-x_n)}{(x_i-x_0) \cdots (x_i-x_{i-1})(x_i-x_{i+1}) \cdots (x_i-x_n)}, i=0,1,\dots,n.$$

定理5.1.2 设 $f(x) \in C^{n+1}[a,b]$, 且节点 $a \leq x_0 < x_1 < \cdots < x_{n-1} < x_n \leq b$, 则满足条件 $p_n(x_i) = y_i, i=0,1,2,\dots,n$ (5.1.7)

的插值多项式 $p_n(x)$ 有

$$R_n(x) = f(x) - p_n(x) = \frac{f^{(n+1)}(\xi)}{(n+1)!} w_{n+1}(x), \quad a < \xi < b. \quad (5.1.8)$$

这里 $w_{n+1}(x)$ 由下式所定义,

$$w_{n+1}(x) = \prod_{k=0}^n (x-x_k) = (x-x_0)(x-x_1) \cdots (x-x_n). \quad (5.1.9)$$

牛顿插值插值多项式构造及其余项、均差性质

牛顿插值多项式

$$N_n(x) = f(x_0) + f[x_0, x_1](x-x_0) + \cdots + f[x_0, x_1, \dots, x_n](x-x_0)(x-x_1) \cdots (x-x_{n-1}),$$

牛顿插值余项

$$R_n(x) = f(x) - N_n(x) = f[x, x_0, x_1, \dots, x_n](x-x_0)(x-x_1) \cdots (x-x_n),$$

均差表

埃尔米特插值多项式构造及其余项

用重节点差商构造Hermite插值。

(建议用此方法)

例 求一个四次插值多项式 $H(x)$ ，使
 $x=0$ 时， $H(0)=-1$ ， $H'(0)=-2$;
 $x=1$ 时， $H(1)=0$ ， $H'(1)=10$ ， $H''(1)=40$.
并写出插值余项的表达式。

6、常微分方程初值问题简单数值算法，及其局部收敛阶判定

我们考虑一阶常微分方程初值问题

$$\begin{cases} \frac{dy}{dx} = f(x, y), \\ y(x_0) = y_0 \end{cases} \quad (6.1.1)$$

设节点为 $a=x_0 < x_1 < x_2 < \cdots < x_n = b$. 初值问题(6.1.1)的显式欧拉方法为

$$\begin{cases} y_{n+1} = y_n + h_n f(x_n, y_n), \\ y_0 = y(x_0), \quad n = 0, 1, 2, \cdots, \end{cases}$$

隐式欧拉法为

$$\begin{cases} y_{n+1} = y_n + h_n f(x_{n+1}, y_{n+1}), \\ y_0 = y(x_0), \quad n = 0, 1, 2, \cdots, \end{cases}$$

其中 $h_i = x_{i+1} - x_i$.

若数值公式的局部截断误差 $E_{n+1} = O(h^{p+1})$ ，则称此数值公式是 p 阶的， p 是正整数。

以等距节点为例，欧拉法的局部截断误差,由 Taylor 展开:

$$\begin{aligned} E_{n+1} &= y(x_{n+1}) - y_{n+1} \\ &= [y(x_n) + hy'(x_n) + \frac{h^2}{2} y''(x_n) + O(h^3)] - [y_n + hf(x_n, y_n)] \\ &= \frac{h^2}{2} y''(x_n) + O(h^3) \end{aligned}$$

欧拉法具有 1 阶精度；改进欧拉法具有 2 阶精度。

7、其他

三、线性和非线性规划部分（约 20%）

1、求线性规划的单纯形法、包括人工变量的 M 法

用单纯形法求解如下线性规划问题：

$$\begin{aligned} \min \quad & -3x_1 - x_2 \\ \text{s. t.} \quad & 3x_1 + 3x_2 + x_3 = 30, \\ & 4x_1 - 4x_2 + x_4 = 16, \\ & 2x_1 - x_2 \leq 12, \\ & x_j \geq 0, \quad j=1,2,3,4. \end{aligned}$$

引入松弛变量 x_5 , 化成标准形式：

$$\begin{aligned} \min \quad & -3x_1 - x_2 \\ \text{s. t.} \quad & 3x_1 + 3x_2 + x_3 = 30, \\ & 4x_1 - 4x_2 + x_4 = 16, \\ & 2x_1 - x_2 + x_5 = 12, \\ & x_j \geq 0, j=1,2,\dots,5. \end{aligned}$$

用单纯形方法求解过程如下：

	x_1	x_2	x_3	x_4	x_5	
x_3	3	3	1	0	0	30
x_4	④	-4	0	1	0	16
x_5	2	-1	0	0	1	12
	3	1	0	0	0	0

x_3	0	⑥	1	$-\frac{3}{4}$	0	18
x_1	1	-1	0	$\frac{1}{4}$	0	4
x_5	0	1	0	$-\frac{1}{2}$	1	4
	0	4	0	$-\frac{3}{4}$	0	-12

	x_1	x_2	x_3	x_4	x_5	
x_2	0	1	$\frac{1}{6}$	$-\frac{3}{24}$	0	3
x_1	1	0	$\frac{1}{6}$	$\frac{3}{24}$	0	7
x_5	0	0	$-\frac{1}{6}$	$\frac{3}{8}$	1	1
	0	0	$-\frac{2}{3}$	$-\frac{1}{4}$	0	-24

最优解 $\bar{x} = (7, 3, 0, 0, 1)$, 最优值 $f_{\min} = -24$.

2、线性规划问题的对偶问题、对偶性质

七、对下列线性规划问题：

$$\begin{aligned} \min z = & 4x_1 + x_2 + 2x_3 + 3x_4 \\ \begin{cases} 6x_1 + x_2 + 2x_3 + 5x_4 \geq 15 \\ -2x_1 + 7x_2 - x_3 + x_4 \geq 2 \\ x_1 + 5x_2 + 4x_3 + 2x_4 \geq 0 \\ x_1, x_2, x_3, x_4 \geq 0 \end{cases} \end{aligned}$$

写出其对偶模型,

3、原问题与其对偶问题的最优解的关系

8、已知线性规划问题 $\max z = 3x_1 + x_2 + 5x_3$
 $\begin{cases} 6x_1 + 3x_2 + 5x_3 \leq 45 \\ 3x_1 + 4x_2 + 5x_3 \leq 30 \\ x_j \geq 0 (j=1,2,3) \end{cases}$ 的最优表如下，其中 x_4, x_5 是松弛变量。

c_j			3	1	5	0	0
c_B	X_B	b	x_1	x_2	x_3	x_4	x_5
0	x_4	15	3	-1	0	1	-1
5	x_3	6	3/5	4/5	1	0	1/5
$\sigma_j = c_j - z_j$			0	-3	0	0	-1

由此表可得其对偶问题的最优解是_____。

对偶松弛 或者 检验数行

$$6y_1 + 3y_2 - y_3 = 3$$

$$3y_1 + 4y_2 - y_4 = 1$$

$$5y_1 + 5y_2 - y_5 = 5$$

$\Rightarrow y_1 = 0, y_2 = 1$ (松弛变量检验数的相反数)

$y_3 = 0, y_4 = 3$ (非基变量检验数的相反数)

$y_5 = 0$ (基变量检验数的相反数)

4、梯度法求非线性规划问题

用最速下降法求解

$$\min x_1^2 - 2x_1x_2 + 4x_2^2 + x_1 - 3x_2$$

取初始点 $X^{(0)} = (1, 1)^T$ ，迭代一次。

解 第1次迭代, 从 $x^{(1)}$ 出发沿最速下降方向搜索。

设 $f(x) = x_1^2 - 2x_1x_2 + 4x_2^2 + x_1 - 3x_2$, 则

$$\nabla f(x) = \begin{bmatrix} 2x_1 - 2x_2 + 1 \\ -2x_1 + 8x_2 - 3 \end{bmatrix},$$

故

$$\nabla f(x^{(1)}) = \begin{bmatrix} 1 \\ 3 \end{bmatrix}, \quad d^{(1)} = \begin{bmatrix} -1 \\ -3 \end{bmatrix}, \quad x^{(1)} + \lambda d^{(1)} = \begin{bmatrix} 1 - \lambda \\ 1 - 3\lambda \end{bmatrix}.$$

取

$$\varphi(\lambda) = f(x^{(1)} + \lambda d^{(1)}) = (1 - \lambda)^2 - 2(1 - \lambda)(1 - 3\lambda) + 4(1 - 3\lambda)^2 + (1 - \lambda) - 3(1 - 3\lambda),$$

令

$$\varphi'(\lambda) = -2(1 - \lambda) + 2(1 - 3\lambda) + 6(1 - \lambda) - 24(1 - 3\lambda) - 1 + 9 = 0,$$

解得

$$\lambda_1 = \frac{5}{31}, \quad x^{(2)} = x^{(1)} + \lambda_1 d^{(1)} = \begin{bmatrix} \frac{26}{31} \\ \frac{16}{31} \end{bmatrix}.$$

5、如何用 K-T 条件求解非线性规划问题

$$\begin{cases} \min \left(x_1 - \frac{9}{4} \right)^2 + (x_2 - 2)^2 \\ s.t. \quad x_2 - x_1^2 \geq 0 \\ \quad \quad x_1 + x_2 \leq 6 \\ \quad \quad x_1, x_2 \geq 0 \end{cases}$$

KKT必要条件为

$$\begin{cases} \begin{pmatrix} 2\left(x_1 - \frac{9}{4}\right) \\ 2(x_2 - 2) \end{pmatrix} - w_1 \begin{pmatrix} -2x_1 \\ 1 \end{pmatrix} - w_2 \begin{pmatrix} -1 \\ -1 \end{pmatrix} - w_3 \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix} - w_4 \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \end{pmatrix} = 0 \\ w_1(x_2 - x_1^2) = 0 \\ w_2(-x_1 - x_2 + 6) = 0 \\ w_3 x_1 = 0 \\ w_4 x_2 = 0 \\ x_2 - x_1^2 \geq 0 \\ -x_1 - x_2 + 6 \geq 0 \\ x_1, x_2, w_1, w_2, w_3, w_4 \geq 0 \end{cases}$$

$$x_1 = \frac{3}{2}, x_2 = \frac{9}{4}, w_1 = \frac{1}{2}, w_2 = w_3 = w_4 = 0, \text{凸规划}$$