

非线性方程

第一章小结

- 误差理论的基本概念
- 误差在近似值运算中的传播规律及其估算方法
- 数值稳定性的概念。
- 过失误差
- 非过失误差
 - ▣ 模型误差、观测误差、截断误差、舍入误差。
- 绝对误差和相对误差。
- 有效数字，其与误差之间的密切关联。

▣ 减少计算误差的措施：

- ✓ 减少运算次数
- ✓ 避免相近数相减
- ✓ 避免小除数、大乘数和“溢出”
- ✓ 注意运算顺序（如若干数相加时先加绝对值较小的数，避免大数吃小数）
- ✓ 防止误差影响扩大（采用稳定算法）

第2章 一元非线性方程的解法

求 $f(x) = 0$ 的根

2.1 引例及问题综述

2.2 二分法

2.3 简单迭代法

2.4 牛顿迭代法

2.5 弦截法

本章作业：1,3,5,11 (P159-160)

2.1 引例及问题综述

2.1.1 引例

在解决实际问题的过程中，经常遇到求解一元非线性方程根的数学问题。

天文学中用开普勒方程 $x = q \sin x + a$ ($0 < q < 1, a$ 是常数)

来确定行星在轨道上的位置。

2.1.2 问题综述

设 $f(x)$ 为一元连续函数，称方程 $f(x) = 0$ 为函数方程

- $f(x)$ 是单变量 x 的函数，当 $f(x)$ 不是 x 的线性函数时，称对应的函数方程为非线性方程。
- $f(x)$ 可以是代数多项式：

$$f(x) = a_n x^n + a_{n-1} x^{n-1} + \dots + a_1 x + a_0 \quad (a_n \neq 0)$$

称 $f(x) = 0$ 为 n 次代数方程，

当 $n > 1$ 时，方程是非线性的。

- 当 $f(x)$ 包含指数函数或三角函数等特殊函数时，即不能表为代数多项式的形式时称为超越函数，则 $f(x) = 0$ 称为超越方程。

- 满足方程 $f(x)=0$ 的 x 值通常叫做方程的根或解，也叫函数 $f(x)$ 的零点。
- 如果 $f(x) = (x-x^*)^m g(x)$ 且 $g(x^*) \neq 0$ ，则称 x^* 为 $f(x)=0$ 的 m 重根。
 $m=1$ 称为单根， $m>1$ 称为重根。

阅读

- 远在公元前1700年的古巴比伦人就已有关于一、二次方程的解法。《九章算术》(公元前50-100年)其中“方程术”有联立一次方程组的一般解法。
- 1535年意大利数学家坦特格里亚(TorTaglia)发现了三次方程的解法, 卡当(H·Cardano)从他那里得到了这种解法, 于1545年在其名著《大法》中公布了三次方程的公式解, 称为卡当算法。
- 后来卡当的学生弗瑞里(Ferrari)又提出了四次方程的解法。此成果更激发了数学家们的情绪, 但在以后的二个世纪中, 求索工作始终没有成效, 导致人们对高次代数方程解的存在性产生了怀疑。

阅读

- 1799年，高斯证明了代数基本定理，并由此可以立刻推理 n 次代数方程必有 n 个实根或复根。
- 但在以后的几十年中仍然没有找出高次代数方程的公式解。一直到18世纪，法国数学家拉格朗日用根置换方法统一了二、三、四方程的解法。但求解五次方程时未能如愿，开始意识到有潜藏其中的奥妙。
- 在继续探索5次以上方程解的艰难历程中，第一个重大突破的是挪威数学家阿贝尔(N·Abel 1802-1829) 1824年阿贝尔发表了“五次方程代数解法不可能存在”的论文，但并未受到重视，连数学大师高斯也未理解这项成果的重要意义。

阅读

- 1828年17岁的法国数学家伽罗华(E·Galois 1811-1832)写出了划时代的论文“关于五次方程的代数解法问题”，指出即使在公式中容许用 n 次方根，并用类似算法求五次或更高次代数方程的根是不可能的
- 文章呈交法兰西科学院后，因辈份太低遭到冷遇，且文稿丢失。1830年伽罗华再进科学院递稿，得到泊松院士的判词“完全不能理解”。
- 后来伽罗华命运不佳，投考名校巴黎工科大学落榜，屈就高等师院，并卷入政事两次入狱，被开除学籍，又决斗受伤，死于1832年。决斗前，他把关于五次代数求解的研究成果写成长信，留了下来。

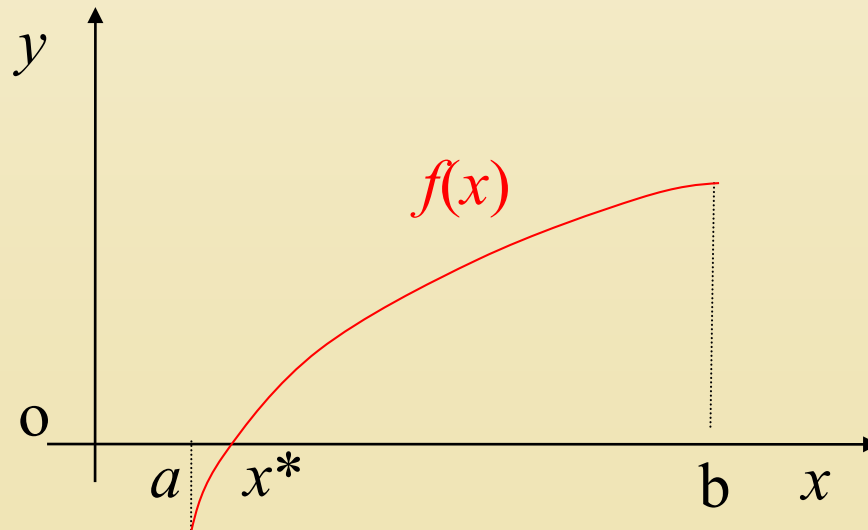
- 十四年后，法国数学家刘维尔(J·Liouville)整理并发表了伽罗华的遗作，人们才意识到这项近代数学发展史上的重要成果的宝贵。
- 38年后，即1870年，法国数学家若当(C·Jordan)在专著《论置换与代数方程》中阐发了伽罗华的思想，一门现代数学的分支——群论诞生了。
- 在前几个世纪中，曾开发出一些求解代数方程的有效算法，它们构成了数值分析中的古典算法。
- 鉴于五次以上的代数方程和一般超越方程都不能解析求出，因此本章只介绍方程的数值解法，它既可以用来求解代数方程，也可以用来解超越方程，但仅限于求方程的实根。

两个基本定理

定理I (代数基本定理)

设 $f(x)=0$ 为具有复系数的 n 次代数方程, 则 $f(x)=0$ 于复数域上恰有 n 个根 (r 重根计算 r 个)。如果 $f(x)=0$ 为实系数代数方程, 则复数根成对出现, 即当 $\alpha+i\beta$ ($\beta \neq 0$) $f(x)=0$ 是复根, 则 $\alpha-i\beta$ 亦是 $f(x)=0$ 根。

定理2 设函数 $f(x)$ 在 $[a, b]$ 内连续, 严格单调, 且有 $f(a)f(b) < 0$, 则在 $[a, b]$ 内方程 $f(x) = 0$ 有且仅有一个实根。



方程的求根问题一般分三步进行:

1.判定根的存在性, 即方程**有没有根?**

如果有根, **有几个根?**



利用闭区间上连续函数的零点定理

2.确定根的分布范围 (根的隔离(分离))

确定根所在的区间,使**方程在这个小区间内有且仅有一个根**,这一过程称为**根的隔离**,

做好根的隔离工作,实际上就可以获得方程各个根的初始近似值。

3.**根的精确化** 得到一个根的初始近似值后, 再用一种方法把此近似值精确化, 使其满足给定的精度要求。

确定根的分布范围（求根的初值）可以采用如下方法：

(1)通过研究函数 $f(x)$ 的单调性，极值等性质，就可以描绘出函数的略图，通过观察曲线与横轴交点的大致位置来确定根的隔离区间。——描图法

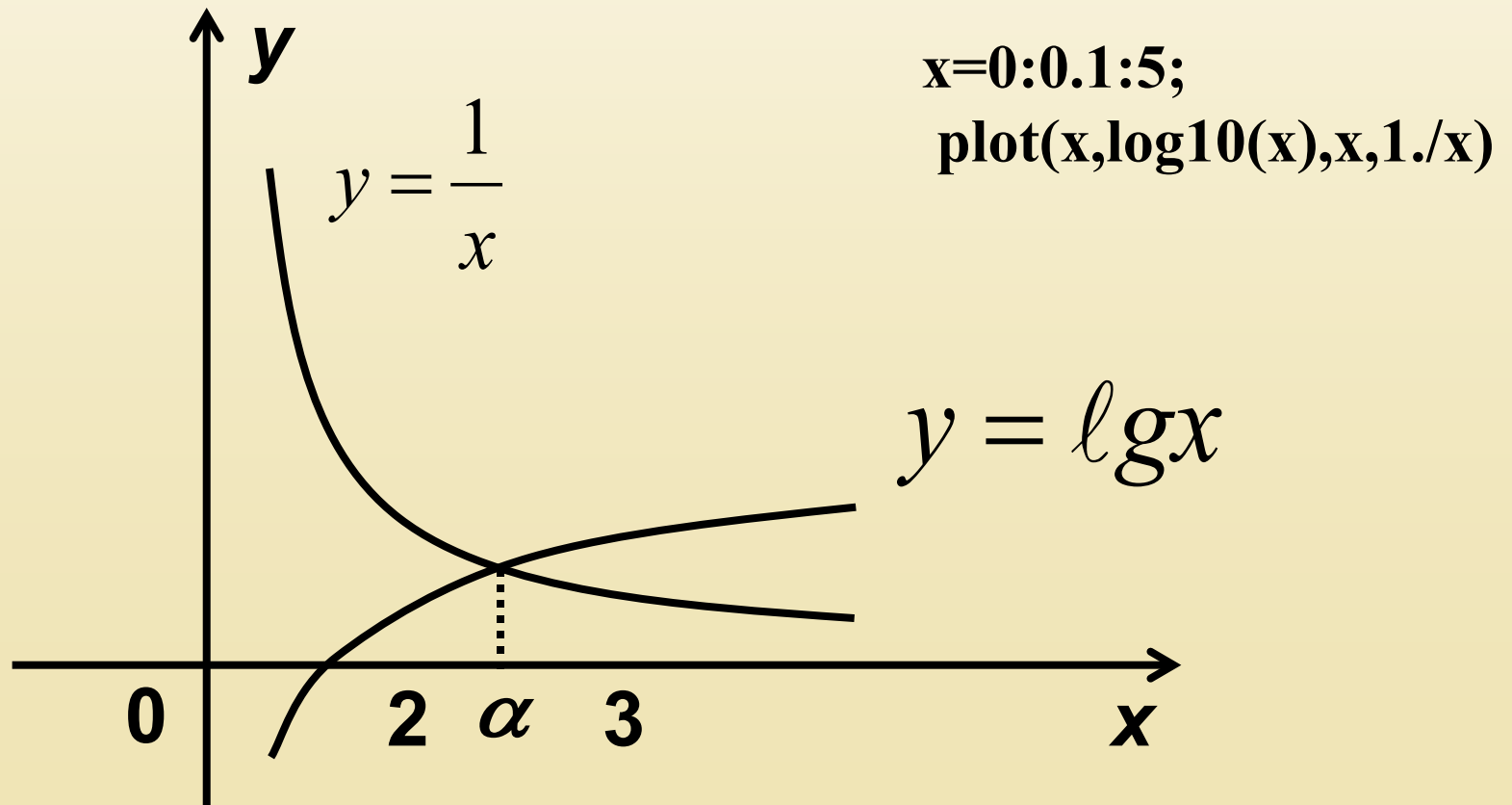
(1) 画图法

- + 画出 $y = f(x)$ 的草图，从而看出**曲线与x轴交点**的大致位置。
- + 也可将 $f(x) = 0$ 分解为 $\varphi_1(x) = \varphi_2(x)$ 的形式， **$\varphi_1(x)$ 与 $\varphi_2(x)$ 两曲线交点的横坐标**所在的子区间即为含根区间。

例如 $x(\lg x) - 1 = 0$

可以改写为 $\lg x = 1/x$

画出对数曲线 $y = \lg x$ ，与双曲线 $y = 1/x$ ，它们交点的横坐标位于区间 $[2, 3]$ 内

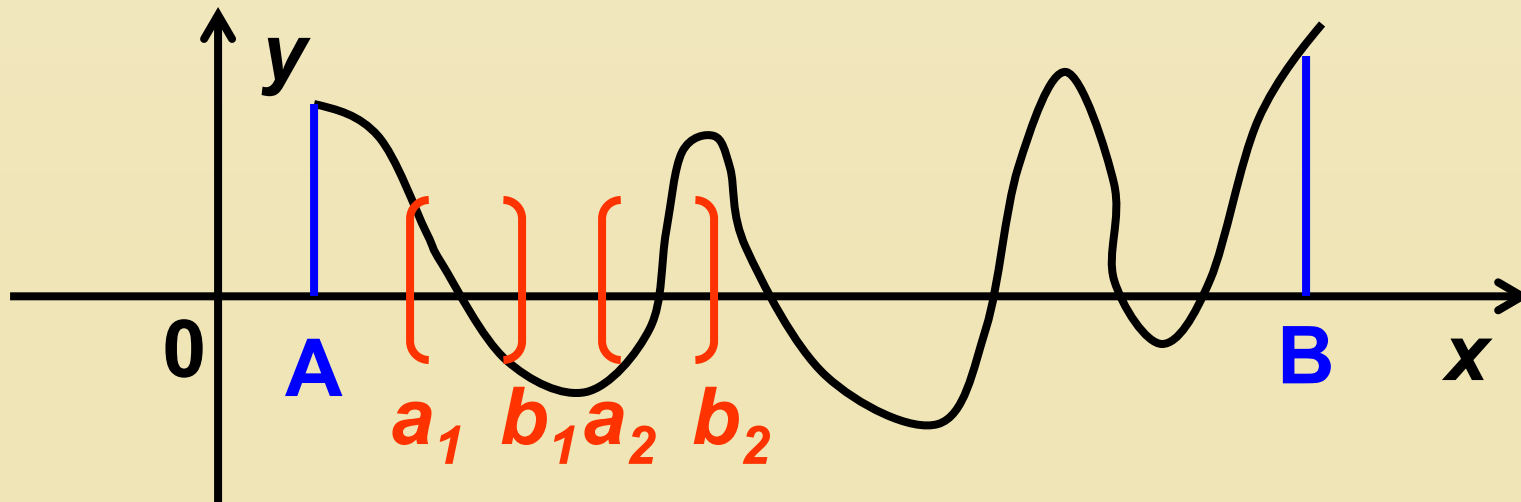


求根的隔离区间可以采用如下方法：

(1) 作 $y = f(x)$ 的草图，由 $f(x)$ 与横轴交点的大致位置来确定根的隔离区间。—— **画图法**

(2) **搜索法**，在连续区间 $[a, b]$ 内，选择一系列的 x 值（等步长或不等步长），当出现两个相邻点上函数值反号时，在此小区间内至少有一个实根。

搜索法：对于给定的 $f(x)$ ，设有根区间为 $[A, B]$ ，从 $x_0=A$ 出发，以**步长** $h=(B-A)/n$ (n 是正整数)，在 $[A, B]$ 内取定节点： $x_i = x_0 + ih$ ($i=0, 1, 2, \dots, n$)，从左至右检查 $f(x_i)$ 的符号，如发现 x_i 与端点 x_0 的函数值异号，则得到一个缩小的有根子区间 $[x_{i-1}, x_i]$ 。

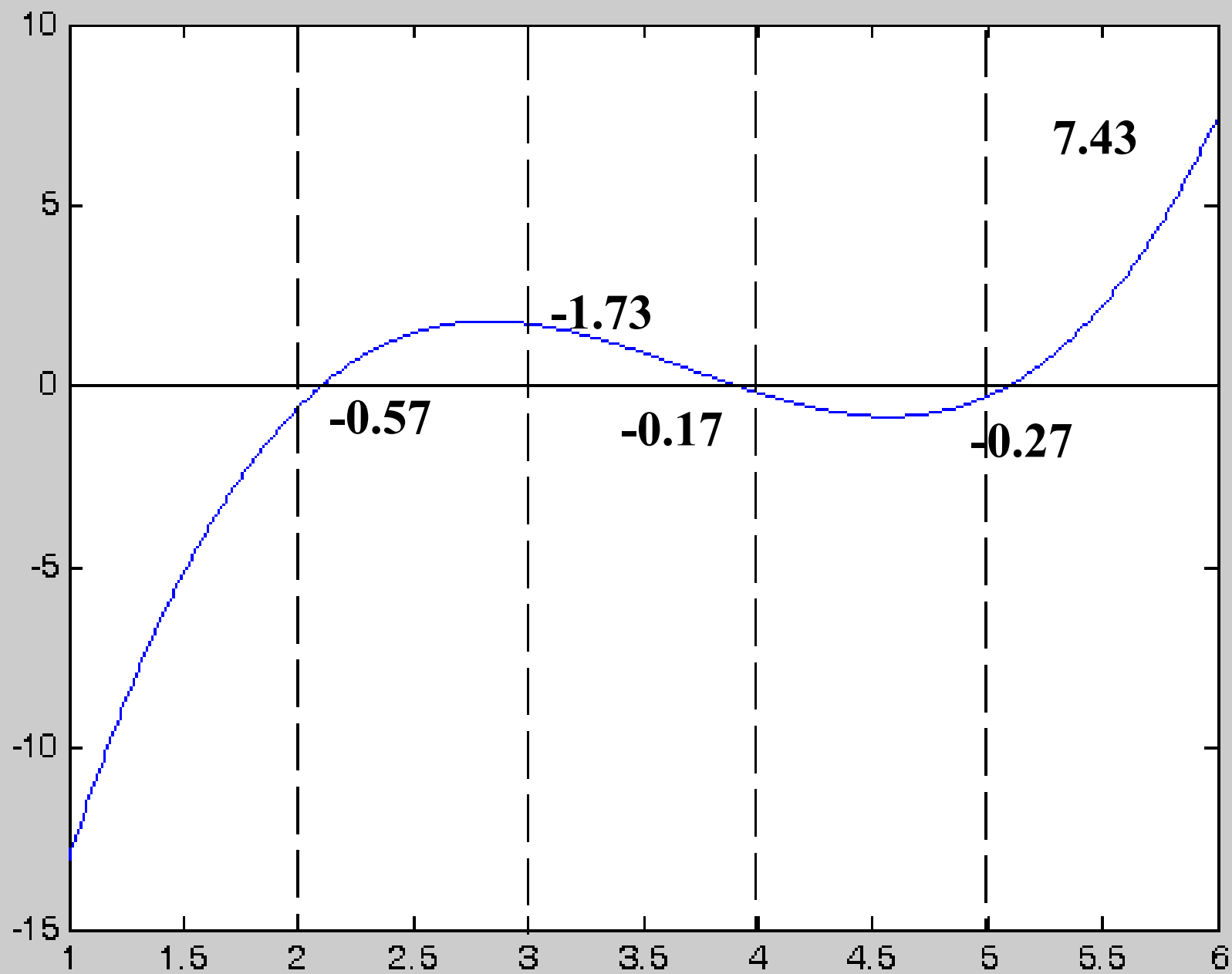


例 2.1 求方程 $f(x) = x^3 - 11.1x^2 + 38.8x - 41.77 = 0$ 的有根区间。

取步长 $h=1$ 对 $f(x)=0$ 的根进行搜索，计算结果为：

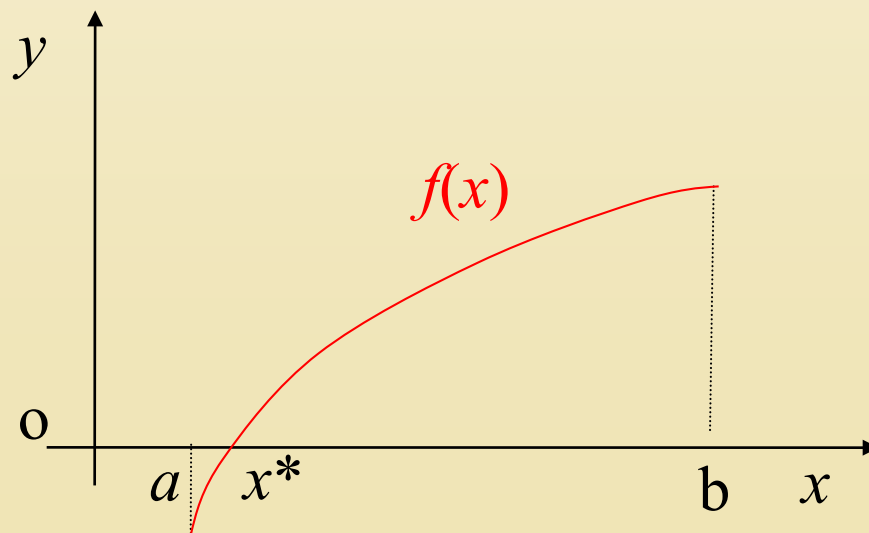
x	0	1	2	3	4	5	6
$f(x)$ 的符号	-	-	-	+	-	-	+

可知方程的有根区间为：[2, 3]，[3, 4]，[5, 6]。



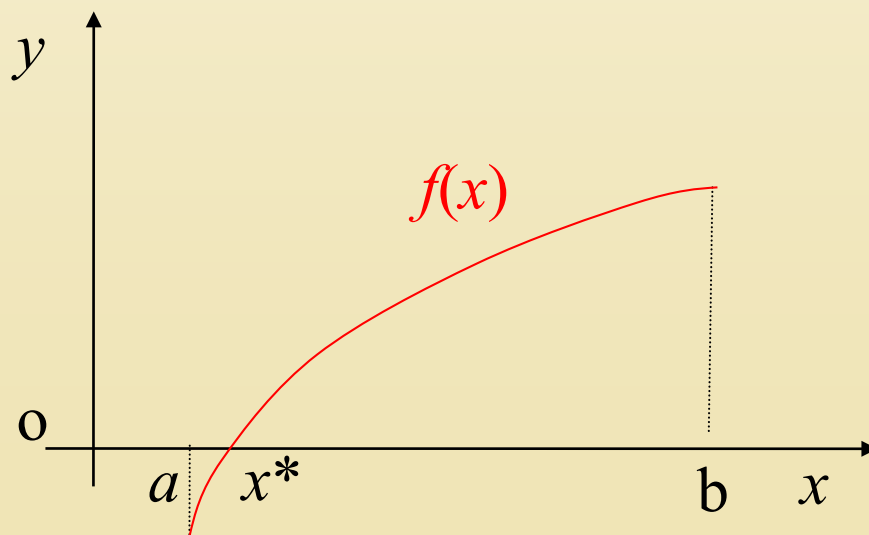
2.2 二分法

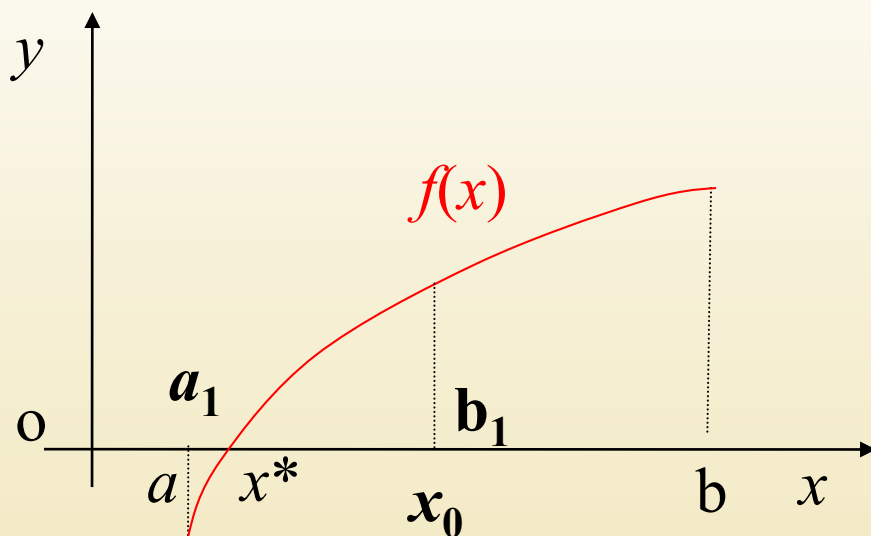
定理2 设函数 $f(x)$ 在 $[a, b]$ 内**连续**，**严格单调**，且有 $f(a) \cdot f(b) < 0$ ，则在 $[a, b]$ 内方程 $f(x) = 0$ 有且仅有一个实根。



2.2.1 二分法的构造原理

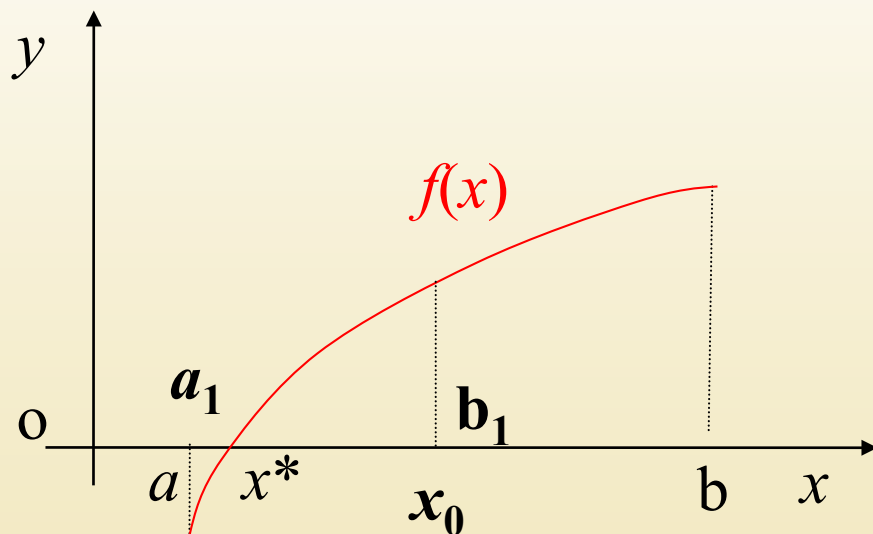
二分法的基本思想：用对分区间的方法，通过判别函数 $f(x)$ 的符号，逐步将有根区间缩小，使在足够小的区间内，方程有且仅有一根。





$$x_0 = \frac{a+b}{2}$$

考察有根的区间 $[a, b]$ ，取中点 x_0 将它分为两半，
 然后进行根的搜索，即检查 $f(x_0)$ 与 $f(a)$ 是否同号：
 如果确系同号，说明所求的根 x^* 在 x_0 的右侧，
 这时令 $a_1 = x_0, b_1 = b$ ；
 否则 x^* 必在 x_0 的左侧，这时令 $a_1 = a, b_1 = x_0$ ；
 不管出现哪一种情形，新的有根区间 $[a_1, b_1]$ 的长度仅为 $[a, b]$
 的一半。



对压缩了的有根区间 $[a_1, b_1]$ 又可以施行同样的手续，即用中点 $x_1 = (a_1 + b_1)/2$ 将区间 $[a_1, b_1]$ 再分为两半，然后通过根的搜索判定所求的根在 x_1 的哪一侧，从而又确定一个新的有根区间 $[a_2, b_2]$ ，其长度是 $[a_1, b_1]$ 的一半。

如此反复二分下去，即可得出一系列有根区间

$$[a, b] \supset [a_1, b_1] \supset [a_2, b_2] \supset \cdots \supset [a_k, b_k] \supset \cdots$$

$$[a, b] \supset [a_1, b_1] \supset [a_2, b_2] \supset \cdots \supset [a_k, b_k] \supset \cdots$$

其中每个区间都是前一个区间的一半，因此二分 k 次后的有根区间 $[a_k, b_k]$ 的长度

$$b_k - a_k = \frac{1}{2^k} (b - a)$$

可见，如果二分过程无限地继续下去，这些有根区间最终必收缩于一点 x^* ，该点显然就是所求的根。

k次二分后，设取有根区间的中点 $x_k = \frac{1}{2}(b_k + a_k)$ 作为根的近似值，

则在二分过程中可以获得一个近似根的序列 $x_0, x_1, \dots, x_k, \dots$ ，该序列以根 x^* 为极限。

在实际计算中，不可能完成这种无穷过程；
对这种无穷过程的截断就会产生截断误差。
数值计算结果允许带有一定的误差。

2.2.2 误差估计与分析:



因为根 $x^* \in [a_k, b_k]$, 所以

$$|x^* - x_k| \leq \frac{1}{2}(b_k - a_k) = \frac{b - a}{2^{k+1}}$$

对于给定的精度 $\varepsilon > 0$, 可估计二分法所需的步数 k :

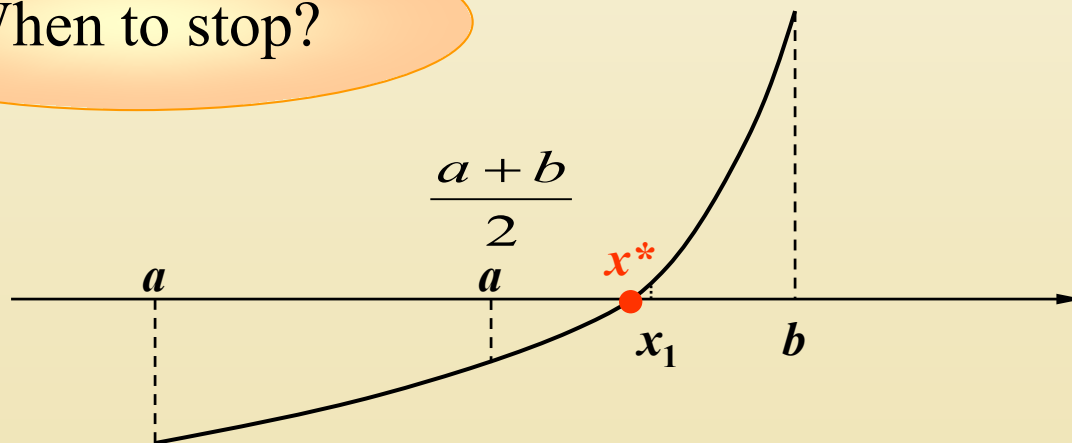
$$\begin{aligned} |x^* - x_k| < \varepsilon &\Rightarrow \frac{b - a}{2^{k+1}} \leq \varepsilon \\ \Rightarrow k &\geq \frac{\lceil \ln(b - a) - \ln \varepsilon \rceil}{\ln 2} - 1 \end{aligned}$$

算到**第 $k+1$ 次**二分, 计算得到的 x_k 就是满足精度要求的近似根。

一般情况下，由 $k \geq \frac{\lceil \ln(b-a) - \ln \varepsilon \rceil}{\ln 2} - 1$ 确定 k 的往往偏大。

在程序中一般不用此式来决定二分区间的次数。

When to stop?



$$|x_k - x_{k-1}| < \varepsilon_1 \quad \text{或} \quad |a_k - b_k| < \varepsilon_1$$

或 $|f(x)| < \varepsilon_2$

不能保证 x 的精度

2.2.3 二分法的计算步骤:

$$a \leftarrow a_k; b \leftarrow b_k; x \leftarrow x_k$$

- 1) 输入有根区间的端点 a, b 及预先给定的精度 ε 。
- 2) $\frac{a+b}{2} \Rightarrow x$
- 3) 若 $f(x) = 0$ ，则计算结束；否则转向4)
- 4) 若 $f(a)f(x) < 0$ ， $x \rightarrow b$ ，转向5)；
否则 $x \rightarrow a$ ，转向5)
- 5) $b - a < \varepsilon$ ，则输出方程满足精度的根 x ，结束；
否则转向2)

例 2.2 用二分法求方程 $f(x)=x^3-x-1=0$ 在区间 $[1,1.5]$ 内的一个实根，要求用四位小数计算，误差不超过 0.005。

解 因为在 $[1,1.5]$ 上，

$$3x^2 - 1 > 0, f(1) = -1 < 0, f(1.5) = 0.875 > 0$$

所以方程 $f(x)=x^3-x-1=0$ 在区间 $[1,1.5]$ 内有唯一实根，计得

$$k \geq \frac{\lceil \ln(b-a) - \ln \varepsilon \rceil}{\ln 2} - 1 = \frac{\ln 0.5 - \ln 0.005}{\ln 2} - 1 = 5.64$$

取 $k=6$ ，即只要二分 7 次，便能到达所要求的精度。

$$f(1) = -1 < 0, f(1.5) = 0.875 > 0$$

k	a_k	b_k	x_k	$f(x)$ 的符号
0	1.000	1.5000	1.2500	-
1	1.2500	1.500	1.3750	+
2	1.2500	1.3750	1.3125	-
3	1.3125	1.3750	1.3438	+
4	1.3125	1.3438	1.3282	+
5	1.3125	1.3282	1.3204	-
6	1.3204	1.3282	1.3243	-

$$f(1.3243) = -0.0018; x^* = 1.3247$$

二分法的特点



1. 计算简单，方法可靠；
2. 对 $f(x)$ 要求不高(只要连续即可)；
3. 收敛性总能得到保证。



1. 无法求复根及偶重根
2. 收敛慢

一般常用来为其它方法求近似根时提供初值。

2.3 简单迭代法

简单迭代法是方程求根最常用的方法，也是其他各类迭代法的基础。

2.3.1 迭代原理

迭代法的基本思想：

迭代法是一种逐次逼近的方法，首先给定一个粗糙的初始值，然后用同一个迭代公式，反复校正这个初值，直到满足预先给定的精度要求为止。

迭代法的关键在于如何构造一个合适的迭代公式。

简单迭代法:

$$f(x) = 0 \xleftrightarrow{\text{等价变换}} x = \varphi(x)$$

$f(x)=0$ 的根

$y=x$ 与 $y= \varphi(x)$ 的交点

$f(x)=0$ 的根 x^* 必满足 $x^* = \varphi(x^*)$, 即函数 $\varphi(x)$ 作用在 x^* 上, 其值不发生变化。

称 x^* 为函数 $\varphi(x)$ 的不动点。

求不动点方程可采用如下方法:

1) 从一个初值 x_0 出发,

计算序列: $\{x_k\}$

$$x_1 = \varphi(x_0),$$

$$x_2 = \varphi(x_1), \quad \longrightarrow \quad \text{迭代过程}$$

...

$$x_{k+1} = \varphi(x_k),$$

...

$\varphi(x)$: 迭代函数

$x_{k+1} = \varphi(x_k)$: 迭代公式

(2) 如果由迭代法产生的序列 $\{x_k\}$ 有极限存在, 即存在 x^* , 使 $\lim_{k \rightarrow \infty} x_k = x^*$, 称**迭代公式** $x_{k+1} = \varphi(x_k)$ **收敛**。

若 $\varphi(x)$ 连续, 且 $\lim_{k \rightarrow \infty} x_k = x^*$, 则有 $x^* = \varphi(x^*)$, 即 x^* 为方程 $f(x) = 0$ 的根。

对迭代过程两边取极限, 则有

$$x^* = \lim_{k \rightarrow \infty} x_{k+1} = \lim_{k \rightarrow \infty} \varphi(x_k) = \varphi(\lim_{k \rightarrow \infty} x_k) = \varphi(x^*)$$

如果由迭代法产生的序列 x_k 没有极限存在, 称**迭代公式发散**

在由方程 $f(x) = 0$ 转化为等价的方程 $x = \varphi(x)$ 时, **选择不同的迭代函数 $\varphi(x)$, 就会产生不同的序列 $\{x_k\}$** (即使初始值 x_0 选择一样), 这些序列的收敛情况也不会相同。

例 用简单迭代法求区间[2,3]内方程 $x^3 - 2x$ 的根 0

解一 将方程两边同加 $2x+5$ ，再开三次方，得

$$x = \sqrt[3]{2x + 5}$$

作迭代序列 $x_{k+1} = \sqrt[3]{2x_k + 5}, \quad k = 0, 1, \dots$

取 $x_0=2.5$ ，迭代得

$$\begin{aligned} x_1 &= 2.154434690, & x_2 &= 2.103612029, & x_3 &= 2.095927410, \\ x_4 &= 2.094760545, & x_5 &= 2.094583250, & x_6 &= 2.094556309, \\ x_7 &= 2.094552215, & x_8 &= 2.094551593, & x_9 &= 2.094551498, \\ x_{10} &= 2.094551484, & x_{11} &= 2.094551482 = x_{12}, \end{aligned}$$

由于 $x_{11}=x_{12}$ ，再迭代无变化，取根 $\alpha \approx x_{11}$



解二 将方程 $x^3-2x-5=0$ 两边同加 $2x^3+5$, 再同除 $3x^2-2$, 得

$$x = (2x^3 + 5) / (3x^2 - 2)$$

作迭代序列 $x_{k+1} = (2x_k^3 + 5) / (3x_k^2 - 2)$

取 $x_0=2.5$, 迭代得

$$x_1 = 2.164179104, \quad x_2 = 2.097135356, \quad x_3 = 2.094555232, \\ x_4 = 2.094551481 = x_5$$

取根 $\alpha \approx x_4$

解三 将方程 $x^3-2x-5=0$ 两边同加 $2x$ ，再同除2，得

$$x = (x^3 - 5) / 2$$

作迭代序列 $x_{k+1} = (x_k^3 - 5) / 2$

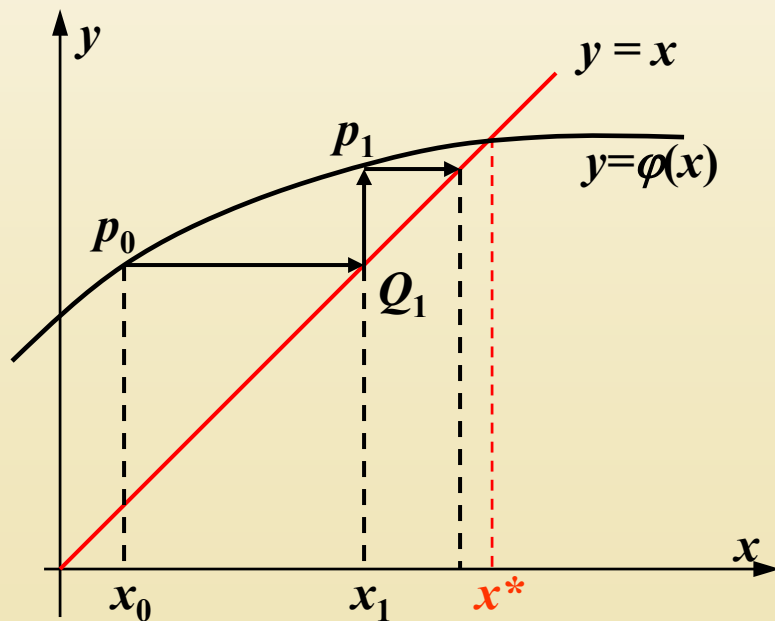
取 $x_0=2.5$ ，迭代得

$$x_1 = 5.312500000, \quad x_2 = 72.46643066, \quad x_3 = 190272.0118, \\ x_4 = 3.444250536 \times 10^{15}, \quad x_5 = 2.042933398 \times 10^{46}, \quad \text{不收敛}$$

由计算看出，选取的三个迭代函数，分别构造的序列 $\{x_k\}$ 收敛情况不一样（初值都取为2.5），在解一、解二情况下 $\{x_k\}$ 收敛且解二比解一收敛快，在解三情况下， $\{x_k\}$ 不收敛。可见，**迭代序列是否收敛和收敛的快慢，同迭代函数 $\varphi(x)$ 有关。**

迭代法的几何意义：

从几何上解释，求方程 $x = \varphi(x)$ 根的问题，是求曲线 $y = \varphi(x)$ 与直线 $y = x$ 交点 P^* 的横坐标 x^* 。



迭代序列

$$x_1 = \varphi(x_0),$$

$$x_2 = \varphi(x_1),$$

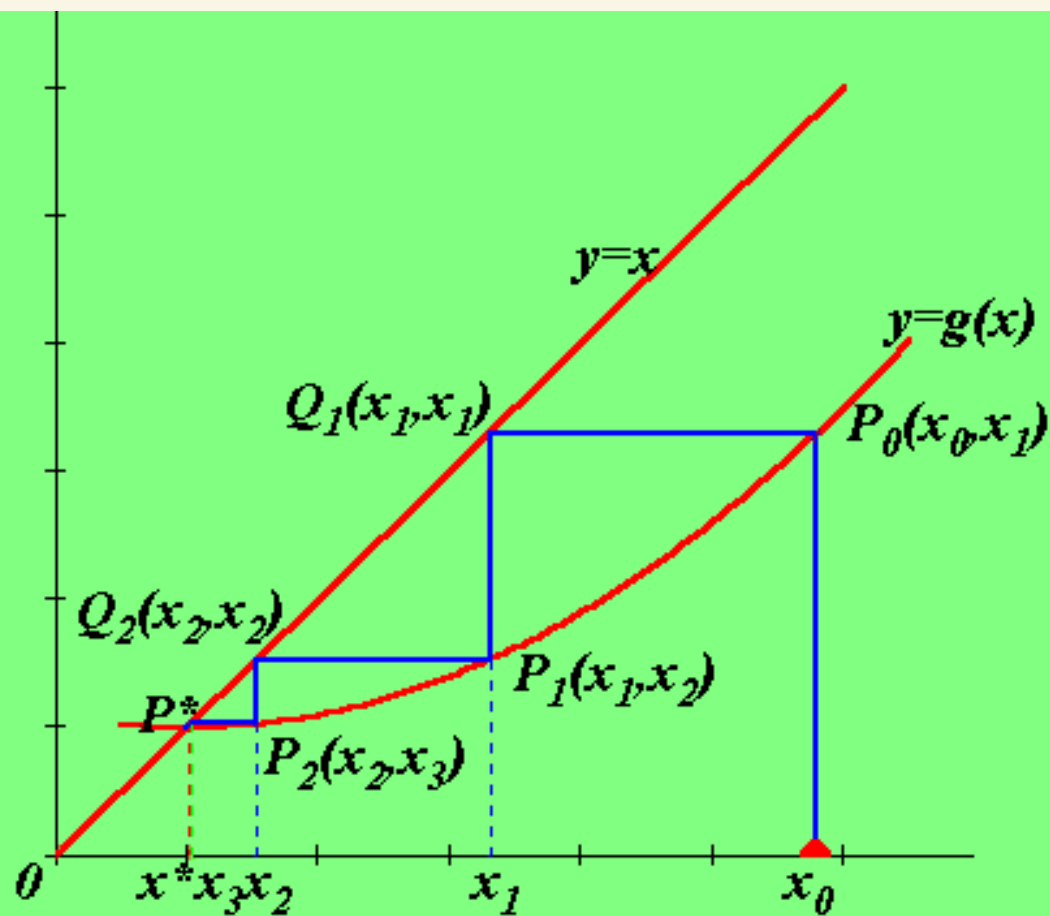
...

$$x_{k+1} = \varphi(x_k),$$

...

由 x_0 求 x_1 , 相当与从曲线 $y = \varphi(x)$ 上一点 $P_0(x_0, \varphi(x_0))$ 出发, 沿着平行于 x 轴方向前进交 $y = x$ 于一点 Q_1 , 再从 Q_1 点沿平行于 y 轴方向前进交 $y = \varphi(x)$ 于 P_1 点, 显然, P_1 的横坐标就是 $x_1 = \varphi(x_0)$ 。继续这个过程就得到序列 $\{x_k\}$ 。

**迭代函数 $\varphi(x)$ 的导数 $\varphi'(x)$ 在根 x^* 处满足几种条件时,
从几何上来考查迭代过程 $x_{k+1} = \varphi(x_k)$ 的收敛情况**



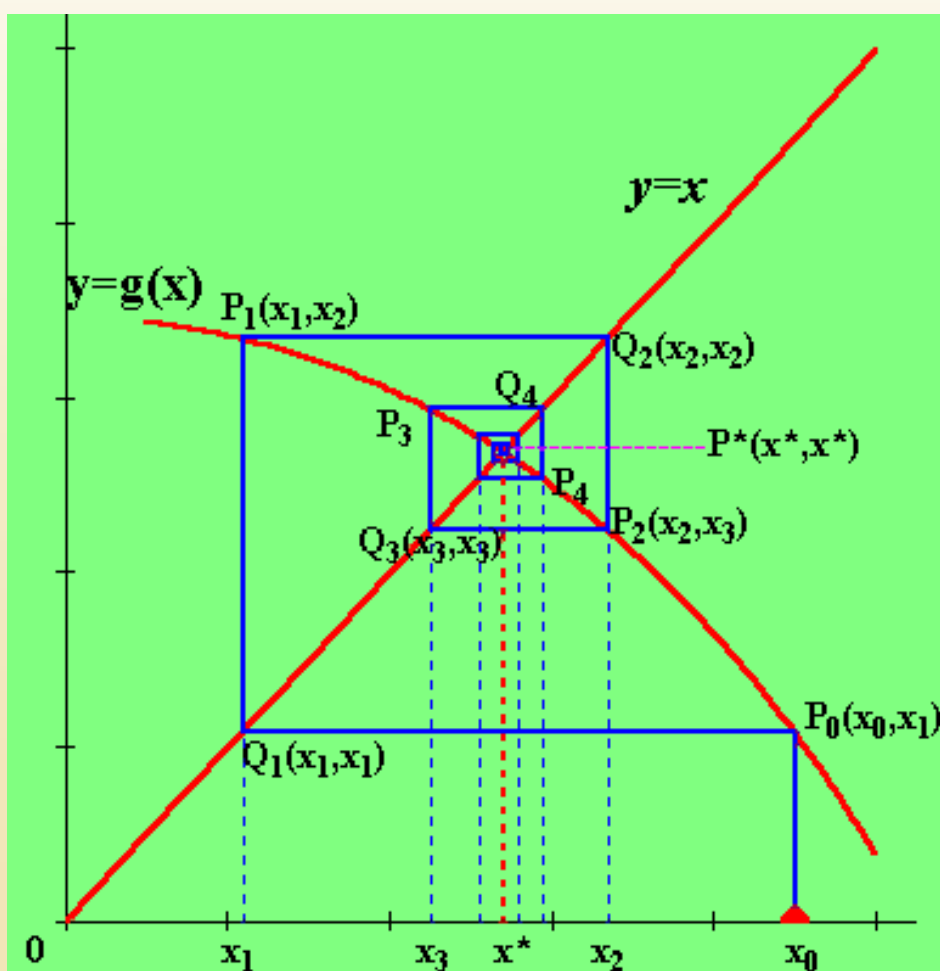
当 $0 < g'(x) < 1$ 时
迭代公式

$$x_{k+1} = g(x_k)$$

$k=0, 1, 2, \dots$

收敛

WZZ



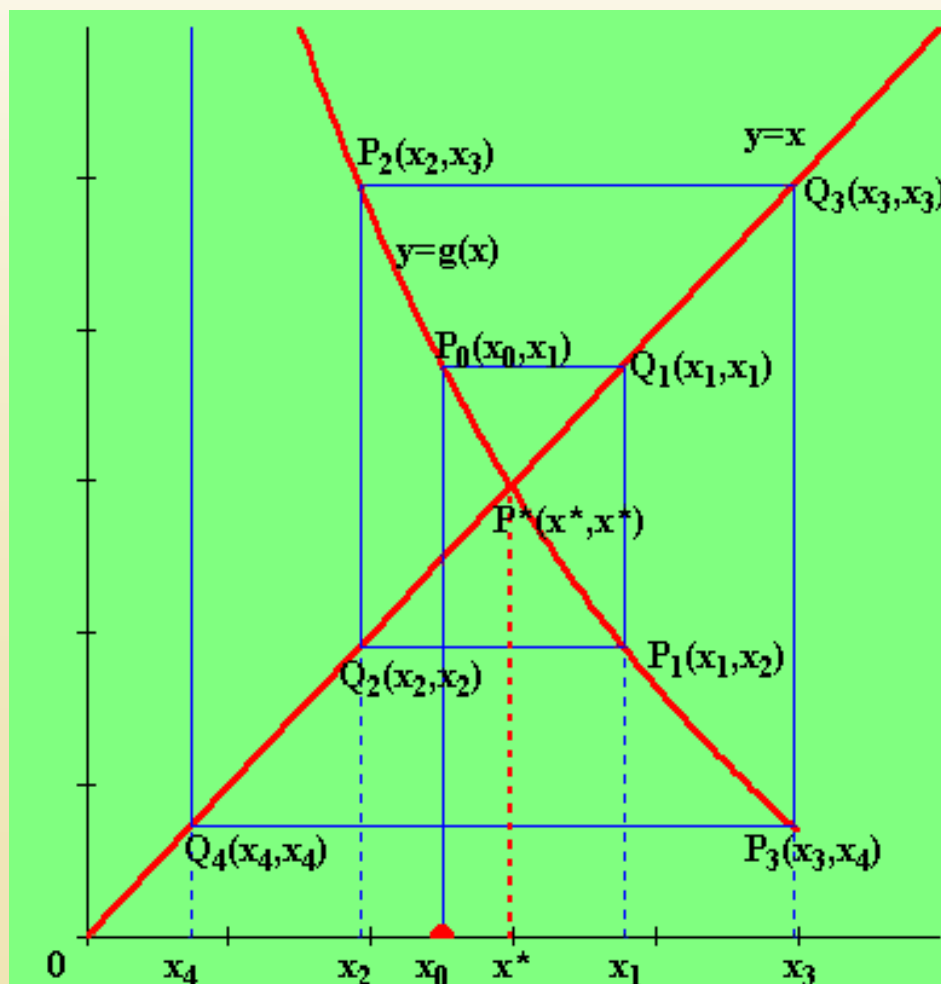
当 $-1 < g'(x) < 0$ 时
迭代公式

$$x_{k+1} = g(x_k)$$

$k=0, 1, 2, \dots$

收敛

WZZ



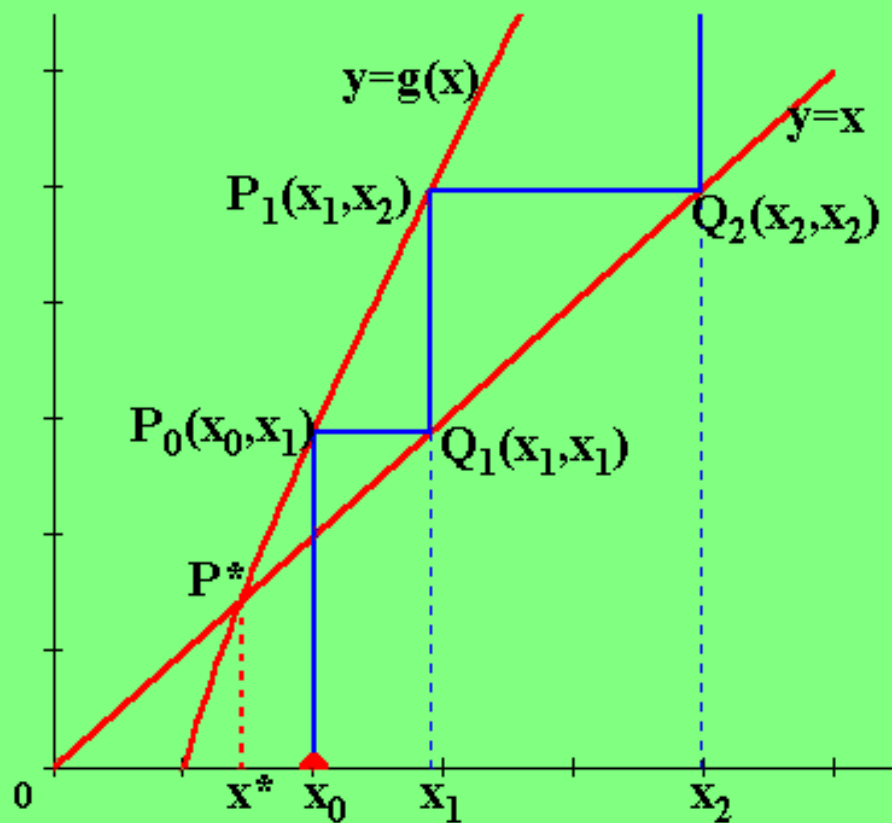
当 $g'(x) < -1$ 的情形
迭代公式

$$x_{k+1} = g(x_k)$$

$k=0, 1, 2, \dots$

发散

WZZ



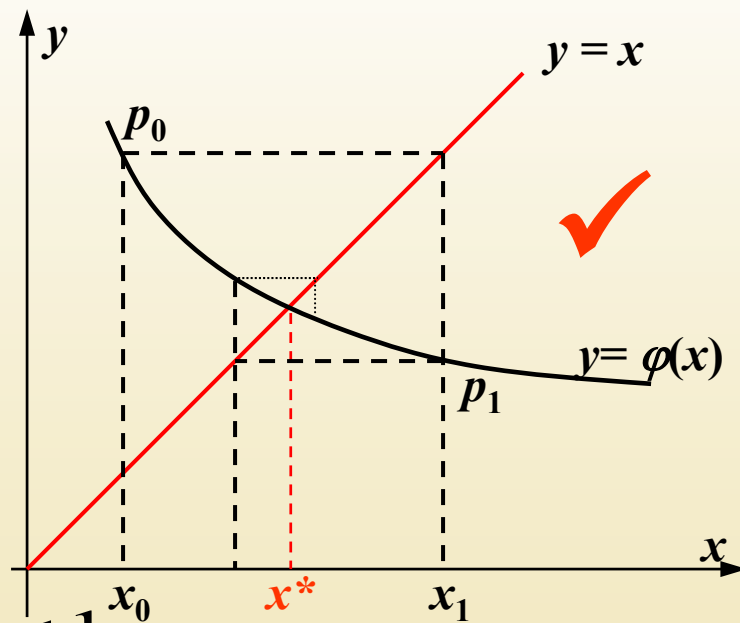
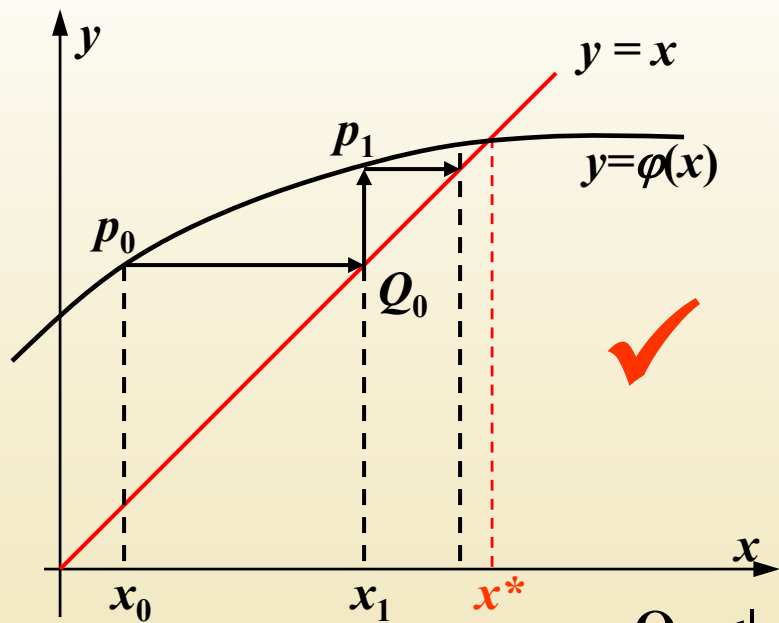
当 $g'(x) > 1$ 时
迭代公式

$$x_{k+1} = g(x_k)$$

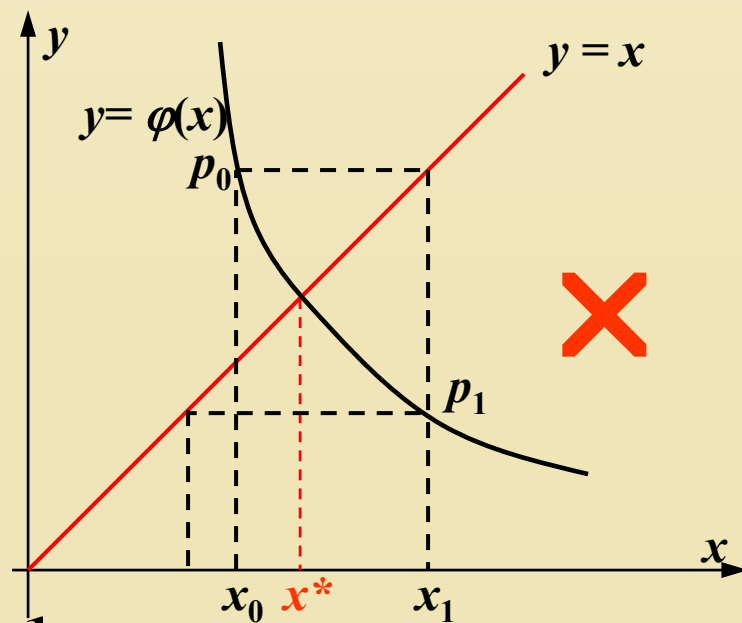
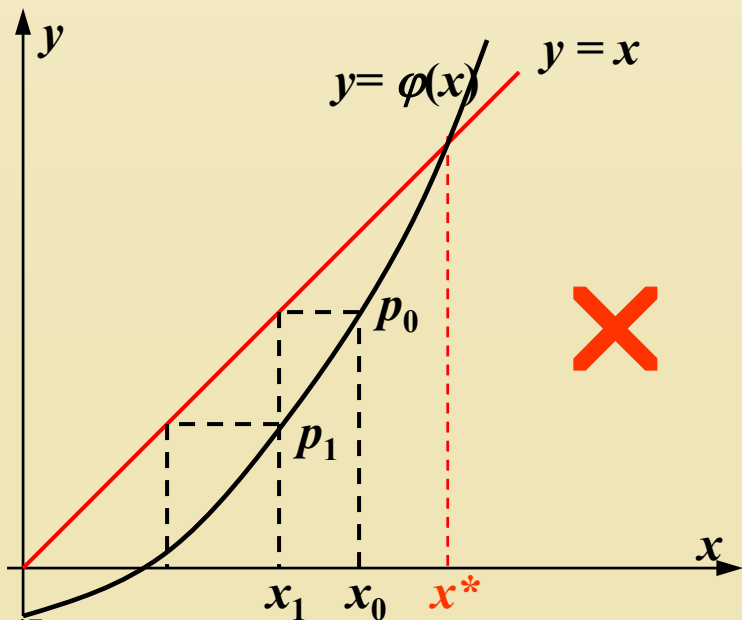
$k=0, 1, 2, \dots$

发散

WZZ



$$0 < |\varphi'(x)| < 1$$



$$|\varphi'(x)| > 1$$

2.3.2 迭代公式的收敛性与误差估计

对于用迭代法求方程 $f(x)=0$ 近似根需要研究下述问题：

- (1) 如何选取迭代函数 $\varphi(x)$ 使迭代过程 $x_{k+1}=\varphi(x_k)$ 收敛。
- (2) 若 $\{x_k\}$ 收敛较慢时，怎样加速 $\{x_k\}$ 收敛。

迭代法收敛定理2.1

考虑方程 $x = \varphi(x)$, $\varphi(x) \in [a, b]$, 若

(I) 当 $x \in [a, b]$ 时, $\varphi(x) \in [a, b]$;

(II) 存在 $0 \leq L < 1$ 使得 $|\varphi'(x)| \leq L < 1$ 对任意 $x \in [a, b]$ 成立。

则 (1) $x = \varphi(x)$ 在 $[a, b]$ 上有唯一解 x^* ;

(2) 任取 $x_0 \in [a, b]$, 由 $x_{k+1} = \varphi(x_k)$ 得到的序列 $\{x_k\}$ 收敛于 x^* , 并且有误差估计式:

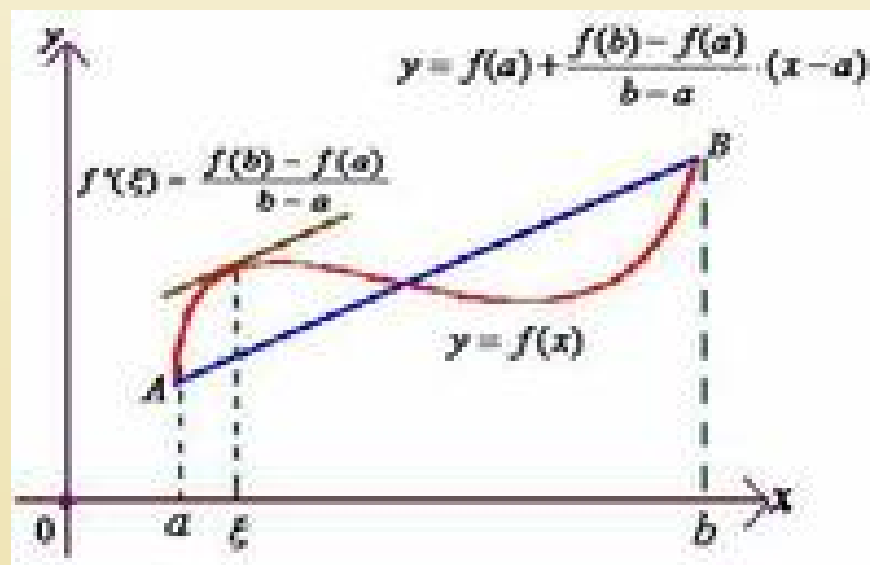
$$\textcircled{1} \quad |x^* - x_k| \leq \frac{L}{1-L} |x_k - x_{k-1}|$$

$$\textcircled{2} \quad |x^* - x_k| \leq \frac{L^k}{1-L} |x_1 - x_0|$$

($k = 1, 2, \dots$)

拉格朗日中值定理

如果函数 $f(x)$ 在 (a, b) 上可导, $[a, b]$ 上连续, 则必有一 $\xi \in [a, b]$, 使得 $f'(\xi) \cdot (b-a) = f(b) - f(a)$



若连续曲线 $y=f(x)$ 在 $A(a, f(a)), B(b, f(b))$ 两点间的每一点处都有不垂直于 x 轴的切线, 则曲线在 A, B 间至少存在1点 $P(c, f(c))$, 使得该曲线在 P 点的切线与割线 AB 平行。

证:

①先证 $x = \varphi(x)$ 在 $[a, b]$ 有解 x^* ✓

构造: $g(x) = x - \varphi(x)$, 因 $\varphi'(x)$ 存在, 故 $\varphi(x)$ 连续, 则 $g(x)$ 连续。

由条件 (I) 知 $g(a) = a - \varphi(a) \leq 0$, $g(b) = b - \varphi(b) \geq 0$, 故存在

$x^* \in [a, b]$, 使 $g(x^*) = 0$, 即 $x^* = \varphi(x^*)$, 证明了方程 $x = \varphi(x)$ 有根。

② 解唯一? ✓

假定还有根 $x^{**} \neq x^*$, 则由拉格朗日中值定理及条件 (II) 得

$$\begin{aligned} 0 < |x^{**} - x^*| &= |\varphi(x^{**}) - \varphi(x^*)| = |\varphi'(\xi)(x^{**} - x^*)| \\ &\leq L |x^{**} - x^*| < |x^{**} - x^*| \end{aligned}$$

即正数 $|x^{**} - x^*|$ 小于其自身。这是不可能的。证明了方程 $x = \varphi(x)$ 在 $[a, b]$ 内只有一根。

③证明序列 $\{x_k\}$ 收敛于 x^* 

由定理假设条件 (I) , 当取 $x_0 \in [a, b]$ 时, 则有 $x_k \in [a, b]$,
 $(k=1, 2, \dots)$ 。记误差 $e_k = x^* - x_k$, 由拉格朗日中值定理

$$x^* - x_{k+1} = \varphi(x^*) - \varphi(x_k) = \varphi'(c)(x^* - x_k)$$

其中 c 在 x^* 与 x_k 之间, 即 $c \in [a, b]$ 。又利用 $|\varphi'(x)| \leq L < 1$ 得到
 误差的递推关系

$$|x^* - x_{k+1}| = |\varphi'(c)| |x^* - x_k| \leq L |x^* - x_k| \quad (k = 0, 1, 2, \dots)$$

反复利用上式, 得到

$$|x^* - x_k| \leq L |x^* - x_{k-1}| \leq L^2 |x^* - x_{k-2}| \leq \dots \leq L^k |x^* - x_0| \rightarrow 0 \quad (\text{当 } k \rightarrow \infty)$$

即

$$\lim_{k \rightarrow \infty} x_k = x^*$$

利用误差估计式，在给定精度 $\varepsilon > 0$ 后，要使 $|x^* - x_k| < \varepsilon$ ，只要计算到：

$$\textcircled{1} \quad |x^* - x_k| \leq \frac{L}{1-L} |x_k - x_{k-1}| < \varepsilon$$

$$\text{或 } \textcircled{2} \quad |x^* - x_k| \leq \frac{L^k}{1-L} |x_1 - x_0| < \varepsilon$$

利用②式可以得到迭代次数 k 的值，但**这样得到的 k 值往往偏大**；而①式利用刚算出来的数值来估计误差，可用较少的迭代运算得到满足精度要求的近似解。

特别

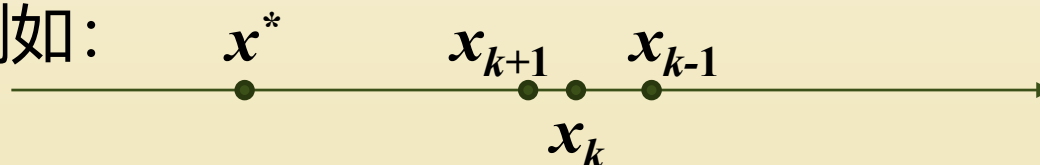
$$L \leq \frac{1}{2} \Rightarrow |x^* - x_k| \leq \frac{L}{1-L} |x_k - x_{k-1}| \leq |x_k - x_{k-1}|$$

可用 $|x_k - x_{k-1}|$ 来控制收敛精度

利用 $|x_k - x_{k-1}| < \varepsilon$ 控制迭代终止，简单易处理

一般不管 $L \leq 1/2$ 是否成立，都用 $|x_k - x_{k-1}| < \varepsilon$ 来控制迭代终止，它通常也能求出满足精度要求的根。

但是要注意，当 $L \approx 1$ 时，即使 $|x_k - x_{k-1}|$ 很小，但误差 $|x^* - x_k|$ 还可能较大，例如：



定理2.1给出了迭代数列 $\{x_k\}$ 在区间 $[a, b]$ 上的收敛性，通常称为**全局收敛性**。

有时不易检验定理2.1的条件，实际应用时通常只在不动点 x^* 的邻近考察其收敛性，即**局部收敛性**。

► 迭代法的局部收敛性:

定义: 对于方程 $x = \varphi(x)$, 若在不动点 x^* 的某个邻域

$$U = \{x \mid |x - x^*| \leq \delta\}$$

内, 对任意初值 $x_0 \in U$, 迭代格式

$$x_{k+1} = \varphi(x_k) \quad k = 0, 1, 2, \dots$$

产生的数列 $\{x_k\}$ 都收敛于 x^* , 则称该迭代格式在不动点 x^* 的附近是局部收敛的。

定理2.2 设方程 $x = \varphi(x)$ 有根 x^* , 且在 x^* 的某个邻域

$U = \{x \mid |x - x^*| \leq \delta\}$ 内 $\varphi(x)$ 存在一阶连续导数, 则

(1) 当 $|\varphi'(x^*)| < 1$ 时, 迭代格式局部收敛;

(2) 当 $|\varphi'(x^*)| > 1$ 时, 迭代格式发散。

对于前例中三种解法的迭代函数，因 $x^* \approx 2.094551482$ ，可知

$$\varphi_1(x) = \sqrt[3]{2x+5}, \quad \varphi'_1(x^*) = \frac{2}{3}(2x^*+5)^{-\frac{2}{3}} \approx 0.151959082$$

$$\varphi_2(x) = \frac{2x^3+5}{3x^2-2}, \quad \varphi'_2(x^*) = \frac{6x^*(x^{*3}-2x^*-5)}{(3x^{*2}-2)^2} = 0$$

$$\varphi_3(x) = \frac{1}{2}(x^3-5), \quad \varphi'_3(x^*) = \frac{3}{2}x^{*2} \approx 6.580718866$$

根据局部收敛定理，前两种迭代收敛，第三种迭代发散

由于实际应用中, x^* 事先不知道, 故条件 $|\varphi'(x^*)| < 1$ 无法验证。

若已知根的初始值 x_0 在 x^* 的邻近, 又根据 φ' 的连续性, 则可采用条件

$$|\varphi'(x_0)| < 1$$

来代替 $|\varphi'(x^*)| < 1$

2.3.3 迭代法的计算步骤

迭代法的突出优点：

算法的逻辑结构简单；

计算时，中间结果若有扰动，不会影响计算结果

步一：准备 确定方程 $f(x)=0$ 的等价形式 $x=\varphi(x)$ ；

提供迭代初值 x_0 ；

步二：迭代 计算迭代值 $x_1=\varphi(x_0)$ ；

步三：判别 检查 $|x_1-x_0|$ ：若 $|x_1-x_0|>\varepsilon$ (ε 为预先指定的精度)，则以 x_1 替换 x_0 转步二继续迭代；当 $|x_1-x_0|\leq\varepsilon$ 时终止计算，取 x_1 作为所求的结果。

例2.4 用两种收敛的迭代法求方程 $x^2-3=0$ 的根 $x^* = \sqrt{3}$

解：等价方程：


$$1) \quad x = \varphi_1(x) = x - \frac{1}{4}(x^2 - 3),$$

$$2) \quad x = \varphi_2(x) = \frac{1}{2}\left(x + \frac{3}{x}\right)$$

且

$$1) \quad \varphi_1'(x) = 1 - \frac{1}{2}x,$$

$$2) \quad \varphi_2'(x) = \frac{1}{2}\left(1 - \frac{3}{x^2}\right)$$


$$1) \quad \varphi_1'(x^*) = 1 - \frac{\sqrt{3}}{2} \approx 0.134 < 1,$$

$$2) \quad \varphi_2'(x^*) = \frac{1}{2}\left(1 - \frac{3}{x^2}\right) = 0$$

迭代公式:

$$1) \ x_{k+1} = \varphi_1(x_k) = x_k - \frac{1}{4}(x_k^2 - 3),$$

$$2) \ x_{k+1} = \varphi_2(x_k) = \frac{1}{2}\left(x_k + \frac{3}{x_k}\right)$$

均局部收敛

取初值 $x_0=2$

k	$x_{k+1} = \varphi_1(x_k)$	$x_{k+1} = \varphi_2(x_k)$
0	2.000000	2.000000
1	1.750000	1.750000
2	1.734750	1.732143
3	1.732361	1.732051
...

$$\sqrt{3} = 1.7320508\dots$$

虽然两种迭代法都收敛，
但第二种迭代法比第一
种迭代法收敛得快，这
是由于

$$\varphi_2'(x^*) = 0$$

2.3.4 收敛速度与迭代公式的加速/* Order of Convergence */

(1) **收敛速度** 一种迭代法具有使用价值，不但需要肯定它是收敛的，还要求它收敛得比较快，所谓迭代过程的收敛速度，是指在接近收敛时迭代误差的下降速度。具体地说：

定义 设有方程 $x = \varphi(x)$ 及迭代过程

$\begin{cases} x_0 & \text{初值} \end{cases}$

$$\begin{cases} x_{k+1} = \varphi(x_k) \quad (k = 0, 1, 2, \dots) \end{cases}$$

且设 $\{x_k\}$ 收敛于 x^* 。

对迭代误差 $e_k = x^* - x_k$,

如果有误差关系

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{|e_{k+1}|}{|e_k|^p} = \lim_{k \rightarrow \infty} \frac{|x^* - x_{k+1}|}{|x^* - x_k|^p} = c \neq 0$$

其中 P 为实数且 $P \geq 1$, c 为正常数, 称迭代过程为 **P 阶收敛**,

当 $P=1$ 时 称迭代过程为线性收敛,

当 $P>1$ 时 称迭代过程为超线性收敛,

当 $P=2$ 时称迭代过程为二次收敛 (或为平方收敛)。

定理2.3

对于迭代过程 $x_{k+1} = \varphi(x_k)$, 如果 $\varphi^{(p)}(x)$ 在所求根 x^* 的邻近连续, 并且

$$\varphi'(x^*) = \varphi''(x^*) = \varphi^{(p-1)}(x^*) = 0, \quad \varphi^{(p)}(x^*) \neq 0$$

则称该迭代过程在点 x^* 邻近是 p 阶收敛的。
(证明过程略)

对于前例中前两种解法的迭代函数, $x^* \approx 2.094551482$,

$$\varphi_1(x) = \sqrt[3]{2x+5}, \quad \varphi_1'(x^*) = \frac{2}{3}(2x^*+5)^{-\frac{2}{3}} \approx 0.151959082 \neq 0$$

$$\varphi_2(x) = \frac{2x^3+5}{3x^2-2}, \quad \varphi_2'(x^*) = \frac{6x^*(x^{*3}-2x^*-5)}{(3x^{*2}-2)^2} = 0$$

线性
收敛

超线性收敛

平方收敛

$$\varphi_2''(x^*) = \frac{24(x^{*3}+15x^{*2}+2x^*)}{(3x^{*2}-2)^3} = 1.366771471 \neq 0$$

对于例2.4中

$$\begin{array}{ll} 1) \ x = \varphi_1(x) = x - \frac{1}{4}(x^2 - 3), & 1) \ \varphi_1'(x) = 1 - \frac{1}{2}x, \\ 2) \ x = \varphi_2(x) = \frac{1}{2}\left(x + \frac{3}{x}\right) & 2) \ \varphi_2'(x) = \frac{1}{2}\left(1 - \frac{3}{x^2}\right) \end{array}$$

$\varphi_1'(x^*) \neq 0 \quad \longrightarrow \quad \text{线性收敛}$

$\varphi_2'(x^*) = 0, \ \varphi_2''(x) = \frac{6}{x^3}, \ \varphi_2''(x^*) = \frac{2}{\sqrt{3}} \quad \longrightarrow \quad \text{2阶收敛}$

一般收敛阶数 P 越大，迭代序列收敛越快。

迭代法 总结

$$f(x) = 0 \xleftrightarrow{\text{等价变换}} x = \varphi(x)$$

$f(x)$ 的根 \longleftrightarrow $\varphi(x)$ 的不动点



思路

从一个初值 x_0 出发, 计算 $x_1 = \varphi(x_0)$, $x_2 = \varphi(x_1)$, ..., $x_{k+1} = \varphi(x_k)$, ... 若 $\{x_k\}_{k=0}^{\infty}$ 收敛, 即存在 x^* 使得

$\lim_{k \rightarrow \infty} x_k = x^*$, 且 φ 连续, 则由 $\lim_{k \rightarrow \infty} x_{k+1} = \lim_{k \rightarrow \infty} \varphi(x_k) = \varphi(\lim_{k \rightarrow \infty} x_k) = \varphi(x^*)$ 可知 $x^* = \varphi(x^*)$, 即 x^* 是 φ 的不动点, 也就是 f 的根。



在所求区间上满足
 $|\varphi'(x)| < 1$, 就这么简单!



2.4 牛顿迭代法 /* Newton - Raphson Method */

2.4.1 公式的构造

原理：将非线性方程逐步化为线性方程来求解。

设有非线性方程 $f(x) = 0$

其中，设 $f(x)$ 为 $[a, b]$ 上**一阶连续可微**，且 $f(a) * f(b) < 0$ ；

又设 x_0 是 $f(x)$ 一个零点 $x^* \in (a, b)$ 的近似值（设 $f'(x) \neq 0$ ），

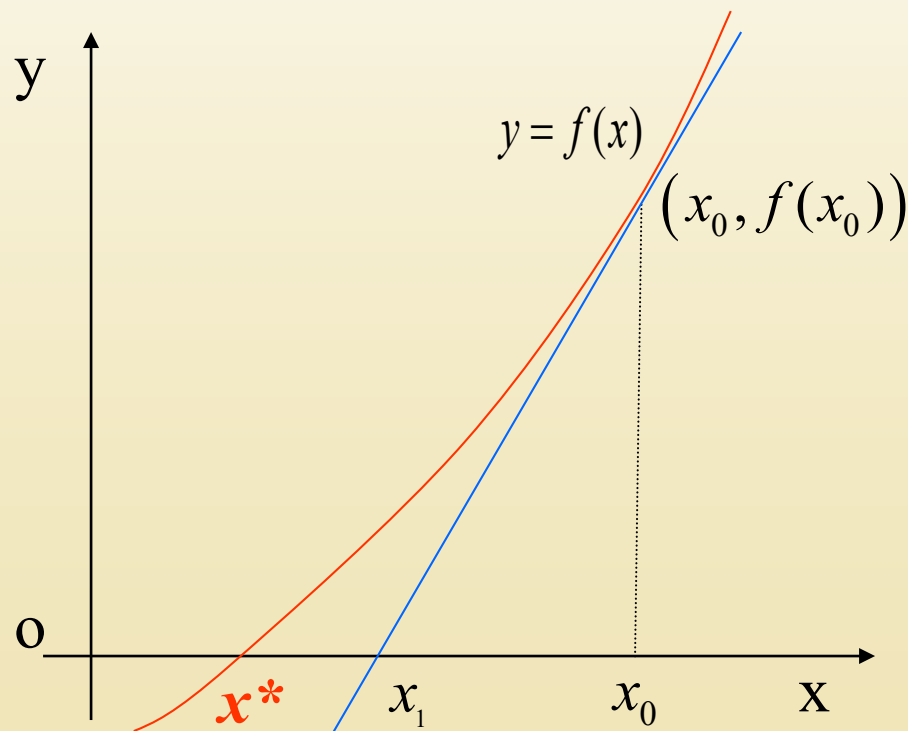
现考虑**用过曲线 $y=f(x)$ 上点 $P(x_0, f(x_0))$ 的切线**

近似代替函数 $f(x)$ ，即用线性函数

$$y = f(x_0) + f'(x_0)(x - x_0)$$

代替 $f(x)$ 。

$$y = f(x_0) + f'(x_0)(x - x_0)$$



用切线（即线性函数）的零点，记为 x_1 ，作为方程 $f(x) = 0$ 根 x^* 的近似值。

由 $y = f(x_0) + f'(x_0)(x - x_0)$

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

一般，若已求得 x_k ，将上式中 x_0 换为 x_k ，重复上述过程，即得求方程 $f(x)=0$ 的牛顿方法的计算公式

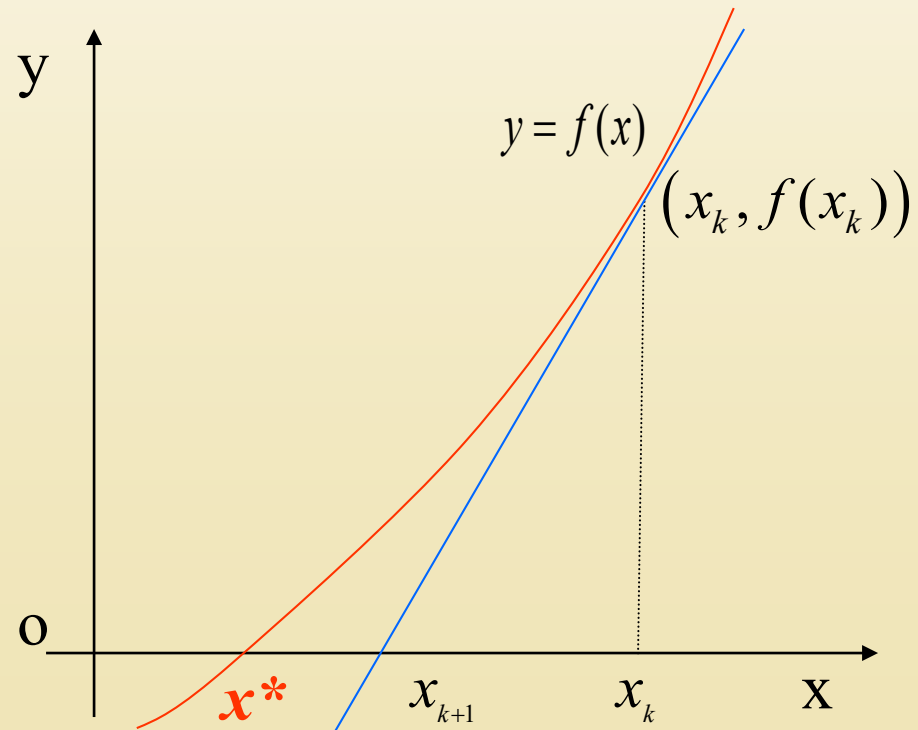
$$\begin{cases} x_0 & (\text{初值}) \\ x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f'(x_k)} & (k = 0, 1, 2, \dots) \end{cases}$$

牛顿法的几何解释

$$x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f'(x_k)}$$

迭代公式就是**切线与 x 轴交点的横坐标**，所以牛顿法是用**切线与 x 轴的交点来近似代替曲线与 x 轴交点的横坐标**。

→ **切线法**



2.4.2 牛顿法的收敛性

定理2.4 (收敛的充分条件) 设 $f(x)$ 在区间 $[a, b]$ 上满足下列条件:

(1) $f(a)f(b) < 0$;

有根

(2) $f'(x) \neq 0$;

根唯一

(3) $f''(x)$ 存在且不变号,

产生的序列单调
有界, 保证收敛。

选取 $x_0 \in [a, b]$ 使得 $f(x_0)f''(x_0) > 0$;

则Newton's Method产生的序列 $\{x_k\}$ 收敛到 $f(x)=0$ 在 $[a, b]$ 的唯一根。

牛顿法的局部收敛性

设有方程 $f(x)=0$ ，显然，牛顿法是一种迭代法，即

$$x_{k+1}=g(x_k)$$

其中迭代函数为

$$g(x) = x - \frac{f(x)}{f'(x)} \quad (\text{设 } f'(x_k) \neq 0)$$

于是，可用迭代法理论来考查牛顿方法的收敛性。

定理2.2 设方程 $x = \varphi(x)$ 有根 x^* ，且在 x^* 的某个邻域

$U = \{x \mid |x - x^*| \leq \delta\}$ 内 $\varphi(x)$ 存在一阶连续导数，则

- (1) 当 $|\varphi'(x^*)| < 1$ 时，迭代格式局部收敛；
- (2) 当 $|\varphi'(x^*)| > 1$ 时，迭代格式发散。



牛顿法的局部收敛定理

设有方程 $f(x)=0$

(1) 设 $f(x)$ 在根 x^* 邻近具有连续二阶导数;

(2) 且设 $f(x^*)=0$, 但 $f'(x^*) \neq 0$;

则存在 x^* 的一个邻域 $S = \{x \mid |x^* - x| \leq \delta\}$

使得对于任意选取初值 $x_0 \in S$, 由牛顿法产生的序列 $\{x_k\}$ 收敛于 x^*

证明 由于牛顿法是一个迭代法，其迭代函数为

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

计算

$$\varphi'(x) = 1 - \frac{f'^2(x) - f(x)f''(x)}{(f'(x))^2} = \frac{f(x)f''(x)}{(f'(x))^2}$$

由假设条件(2)，则有

$$\varphi'(x^*) = \frac{f(x^*)f''(x^*)}{(f'(x^*))^2} = 0$$

于是由迭代法局部收敛定理，迭代法 $x_{k+1} = \varphi(x_k)$
(即牛顿法) 为局部收敛

证毕

若 $f^{(3)}(x)$ 在 x_0 的邻域内存在, 对

$$\varphi'(x) = 1 - \frac{f'^2(x) - f(x)f''(x)}{(f'(x))^2} = \frac{f(x)f''(x)}{(f'(x))^2}$$

再求一次导数, 得

$$\varphi''(x) = \frac{f'^2(x)f''(x) + f(x)f'(x)f^{(3)}(x) - 2[f''(x)]^2 f(x)}{[f'(x)]^3}$$

$$f(x^*) = 0$$

$$\Rightarrow \varphi''(x^*) = \frac{f''(x^*)}{f'(x^*)}$$

$$\varphi''(x^*) = \frac{f''(x^*)}{f'(x^*)}$$

只要 $f''(x^*) \neq 0$

$$\varphi''(x^*) \neq 0$$

⇒ **牛顿迭代公式是平方收敛的,**

若 $f''(x^*) = 0$ 收敛速度还会更快。

定理2.3 对于迭代过程 $x_{k+1} = \varphi(x_k)$, 如果 $\varphi^{(p)}(x)$ 在所求根 x^* 的邻近连续, 并且

$$\varphi'(x^*) = \varphi''(x^*) = \varphi^{(p-1)}(x^*) = 0, \quad \varphi^{(p)}(x^*) \neq 0$$

则称该迭代过程在点 x^* 邻近是 p 阶收敛的。

牛顿法的局部收敛定理

设有方程 $f(x)=0$

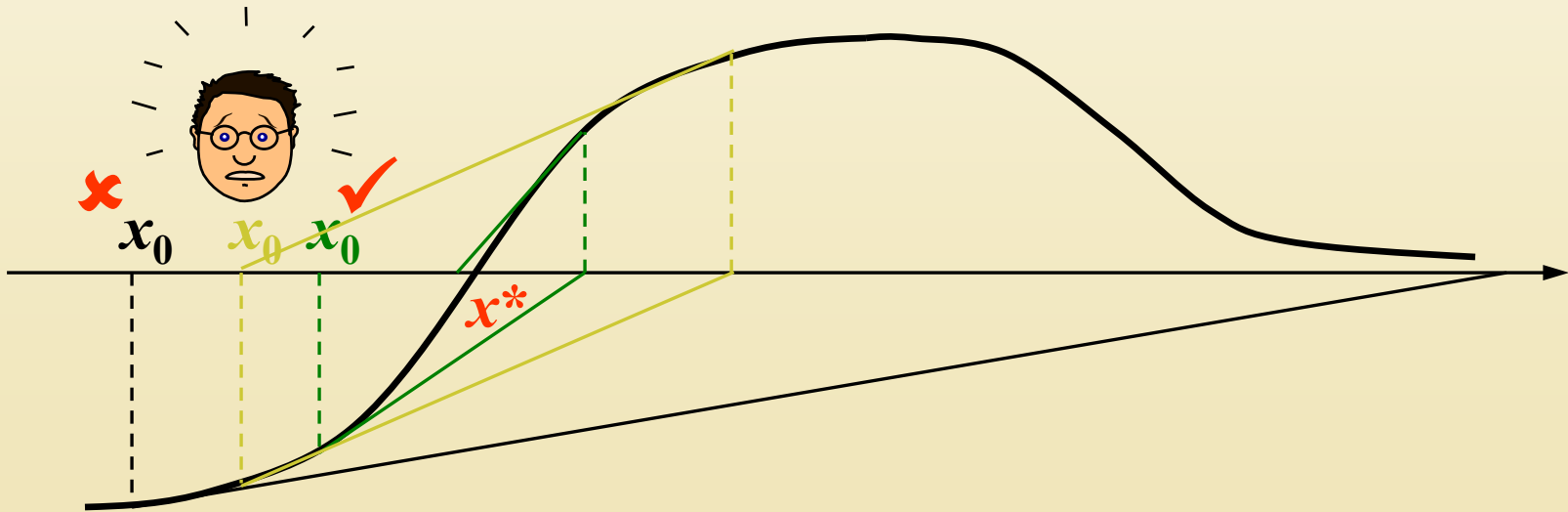
(1) 设 $f(x)$ 在根 x^* 邻近具有连续二阶导数;

(2) 且设 $f(x^*)=0$, 但 $f'(x^*) \neq 0$;

则存在 x^* 的一个邻域 $S = \{x \mid |x^* - x| \leq \delta\}$

使得对于任意选取初值 $x_0 \in S$, 由牛顿法产生的序列 $\{x_k\}$ 收敛于 x^*

注：Newton's Method 收敛性依赖于 x_0 的选取。



由于牛顿迭代法是局部收敛的，故初值 x_0 应充分靠近根 x^* 才能保证收敛，这在一般情况下不容易实现。

实用中可先用二分法做求根预处理，
二分若干次后得到较靠近根 x^* 的近似根 x_0 ，
再用此根作为牛顿迭代法的初值来求根，
达到取长补短的作用。

2.4.3 牛顿迭代法的计算步骤:

步一：准备 选定初始近似值 x_0 , 计算 $f_0 = f(x_0)$ 和 $f'_0 = f'(x_0)$

步二：迭代 按公式 $x_1 = x_0 - \frac{f_0}{f'_0}$ 迭代一次, 得新的近似值 x_1

步三：控制 如果 满足 $|x_1 - x_0|$ 则终止迭代, 以 x_1 作为所求的根; 否则转步4。

步四：修改 如果迭代次数达到预先指定的次数 N 或者 $f'_1 = 0$ 则方法失败; 否则以 (x_1, f_1, f'_1) 代替 (x_0, f_0, f'_0) 转步二继续迭代。

牛顿法优缺点

缺点：函数 $f(x)$ 必须是光滑的，要容易计算导数；初始猜想要靠近零点。

优点：收敛速度快，二次收敛。

例：用牛顿法解方程 $x^3-2x-5=0$ ，取 $x_0=2.5$ ，求 $[2, 3]$ 之间的根

第一步：形成迭代函数

$$f'(x) = 3x^2 - 2$$

$$x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f'(x_k)} = x_k - \frac{x_k^3 - 2x_k - 5}{3x_k^2 - 2} = \frac{2x_k^3 + 5}{3x_k^2 - 2} \quad (k = 0, 1, 2, \dots)$$

第二步：确定初值

$$f(x_0) = 2.5^3 - 2 \times 2.5 - 5 = 5.6250 \quad f''(x_0) = 6x_0 > 0$$

第三步：迭代计算

$$x_1 = \frac{2x_0^3 + 5}{3x_0^2 - 2} = 2.164179104$$

$$x_1 = 2.164179104, \quad x_2 = 2.097135356, \quad x_3 = 2.094555232,$$

$$x_{14} = 2.094551482 = x_5$$


例 2.5 设 $C > 0$ ，试建立计算 C 的开平方正实根的牛顿迭代公式，并分析其收敛性。

解 作函数 $f(x)=x^2-C$ ，($x>0$)，则方程 $f(x)=0$ 的正根就是 \sqrt{C}

可得牛顿迭代公式：

$$x_{k+1} = x_k - \frac{x_k^2 - C}{2x_k} = \frac{1}{2} \left(x_k + \frac{C}{x_k} \right)$$

因为 $x > 0$ 时，

$f'(x) = 2x > 0$	}		取任意初值 $x_0 > \sqrt{C}$
$f''(x) = 2 > 0$			

定理2.4 迭代公式收敛

例 2.6 求方程 $f(x) = x^3 - 2x^2 - 4x - 7 = 0$

在区间[3, 4]中的根的近似值, 要求误差不超过0.005

解 因为

$$\left. \begin{aligned} f(3) &= -10 < 0, f(4) = 9 > 0 \\ f'(x) &= 3x^2 - 4x - 4, f''(x) = 6x - 4, \\ f'(x) &> 0, f''(x) > 0, x \in [3, 4] \end{aligned} \right\} \longrightarrow$$

取初值 $x_0=4$ 时, 牛顿迭代公式收敛。牛顿迭代公式为

$$x_{k+1} = x_k - \frac{x_k^3 - 2x_k^2 - 4x_k - 7}{3x_k^2 - 4x_k - 4} = \frac{2x_k^3 - 2x_k^2 + 7}{3x_k^2 - 4x_k - 4}$$

计算结果为: $x_1 = 3.680, x_2 = 3.633, x_3 = 3.631$

$$\because |x_3 - x_2| = 0.002 < 0.005 \quad \therefore x^* \approx 3.631$$

2.5 弦截法

$$x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f'(x_k)}$$

2.5.1 弦截公式及其收敛性

牛顿法的突出优点是收敛速度快，但它有个明显的缺点，就是每次迭代都要计算导数：

$$f'(x_k)$$

如果函数 $f(x)$ 比较复杂，求导可能有困难，这时可将牛顿公式中 $f'(x)$ 近似用插商来代替，即

$$f'(x) \approx \frac{f(x_k) - f(x_0)}{x_k - x_0}$$

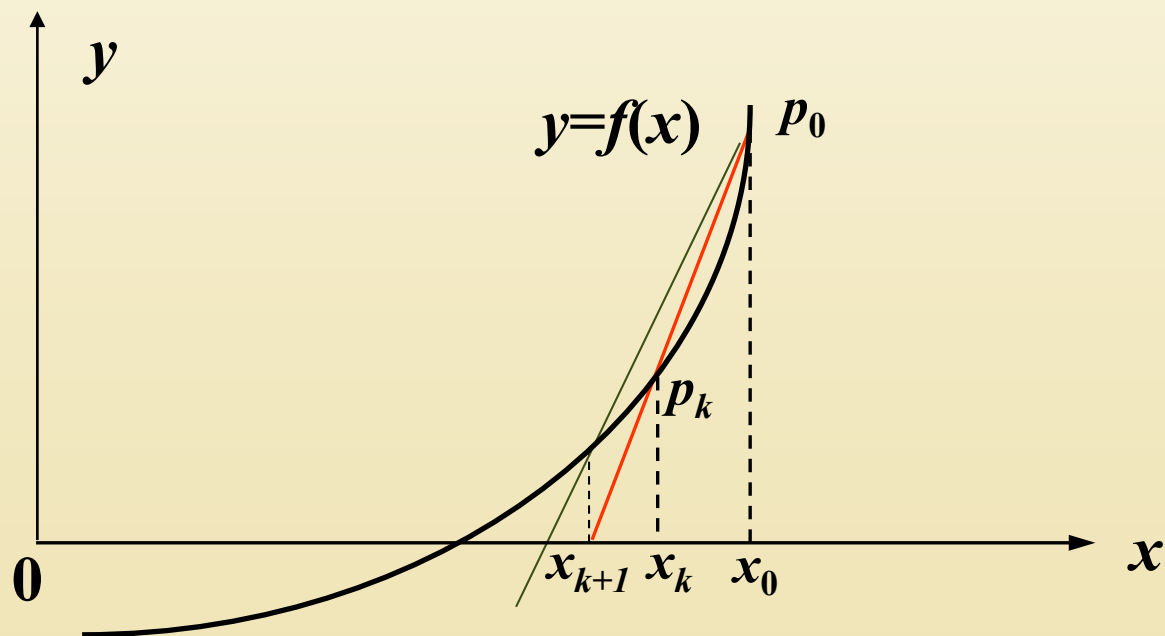
于是得到弦截法计算公式：

$$\begin{cases} \text{初值 } x_0, x_1 \\ x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f(x_k) - f(x_0)}(x_k - x_0) \quad (k = 1, 2, \dots) \end{cases}$$

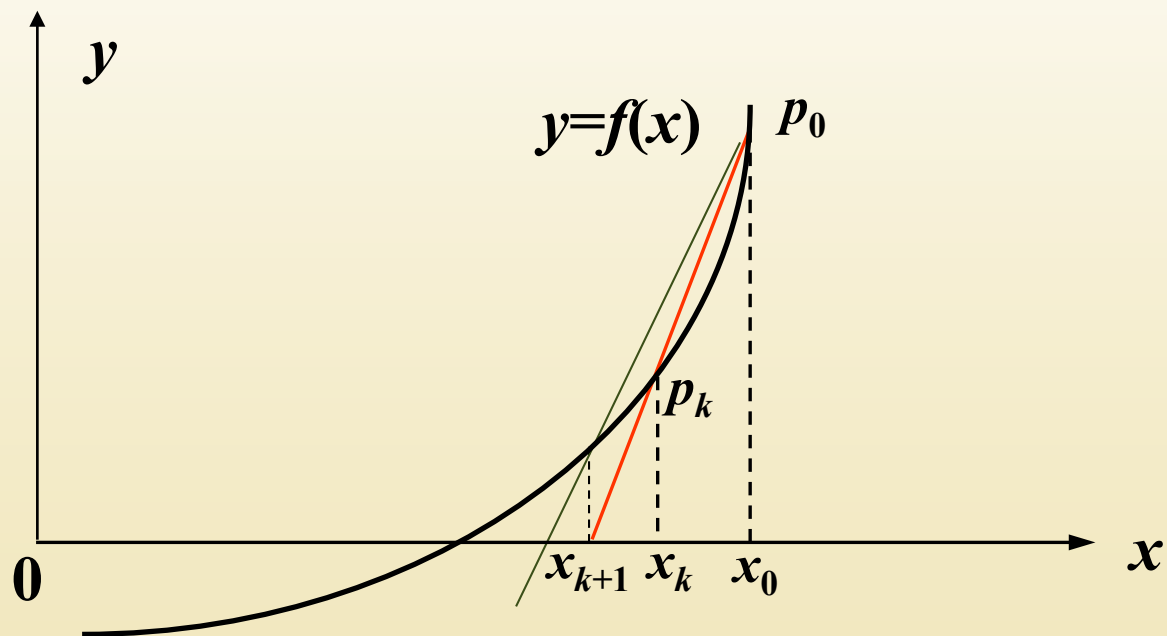


弦截法几何解释

设方程 $f(x)=0$, 且 $f(a)*f(b)<0$, $f(x)$ 于 $[a,b]$ 连续, 取初值 x_0 ,



曲线 $y=f(x)$ 上横坐标为 x_k 的点记为 P_k , 则差商 $\frac{f(x_k)-f(x_0)}{x_k-x_0}$ 表示弦线 $\overline{P_0P_k}$ 的斜率。



可见，按公式
$$x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f(x_k) - f(x_0)}(x_k - x_0)$$

求得的 x_{k+1} 实际上是弦线 $\overline{P_0 P_k}$ 与 x 轴的交点，
因此这种算法称作**弦截法——单点弦截法**。

与牛顿迭代法类似，当 $f(x)$ 在根 x^* 的某邻域内有直到二阶的连续导数，且 $f'(x) \neq 0$ 时，
弦截公式可看作是根据方程 $f(x)=0$ 的等价方程

$$x = x - \frac{f(x)}{f(x) - f(x_0)}(x - x_0)$$

建立的迭代公式，所以弦截法的迭代函数为

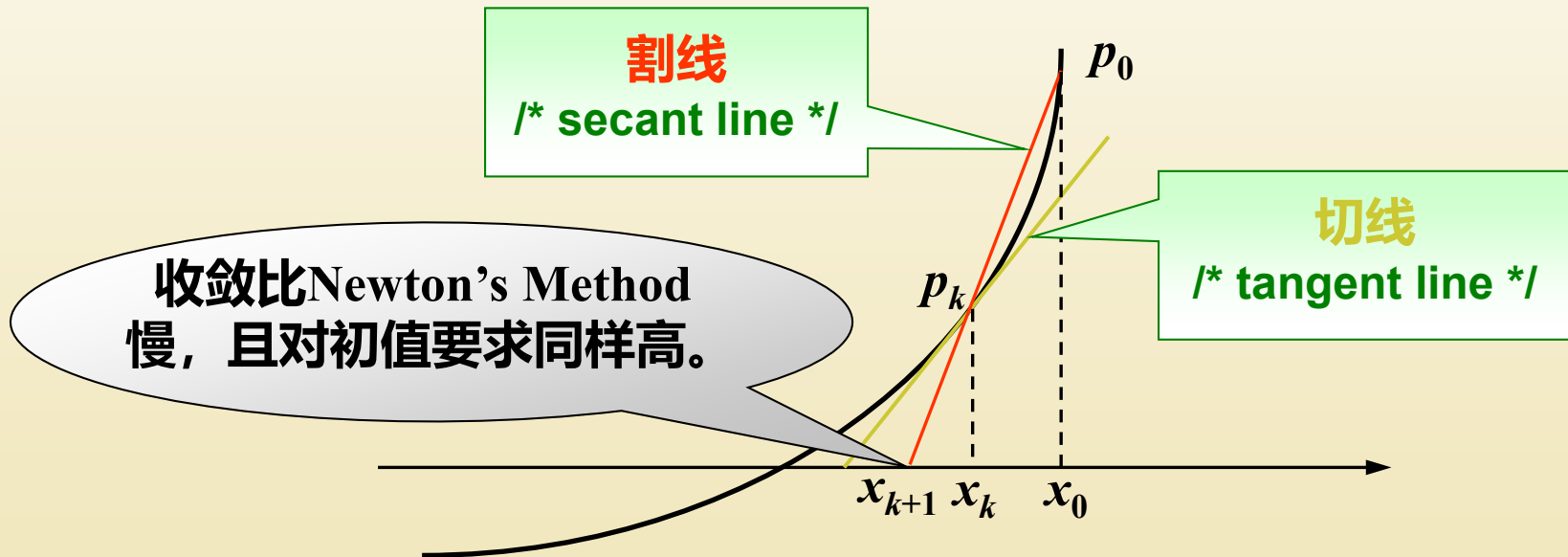
$$\varphi(x) = x - \frac{f(x)}{f(x) - f(x_0)}(x - x_0)$$

$$\varphi(x) = x - \frac{f(x)}{f(x) - f(x_0)}(x - x_0)$$

当 x_0 充分接近 x^* 时: $0 < |\varphi'(x^*)| < 1$

由定理2.2及定理2.3知弦截法具有局部收敛性, 且具有线性收敛速度。

可见, 弦截法的收敛速度比牛顿法慢, 但它的优点是不需要计算导数值。



切线斜率 \approx 割线斜率 $\Rightarrow f'(x_k) \approx \frac{f(x_k) - f(x_0)}{x_k - x_0}$

2.5.2 快速弦截法

$$x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f'(x_k)}$$

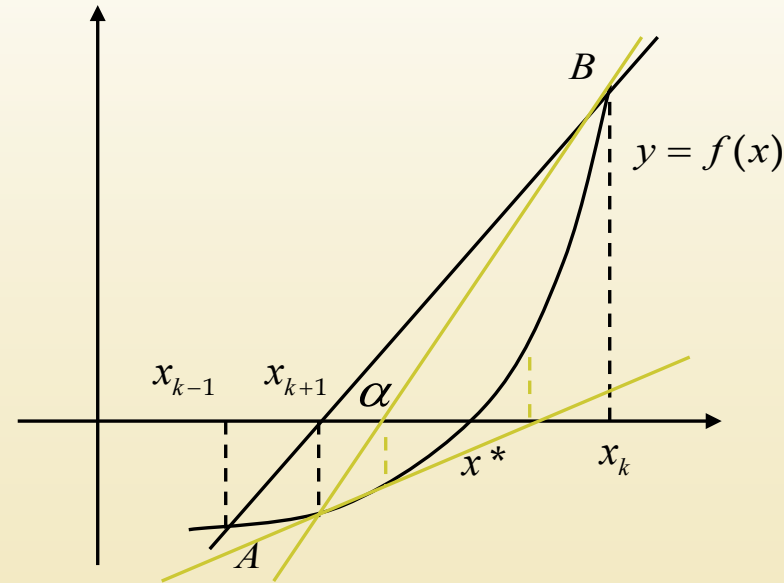
为了提高弦截法的收敛速度，改用差商 $\frac{f(x_k) - f(x_{k-1})}{x_k - x_{k-1}}$

替代牛顿迭代公式中的导数 $f'(x_k)$

得到 $\left\{ \begin{array}{l} \text{初值 } x_0, x_1 \\ x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f(x_k) - f(x_{k-1})} (x_k - x_{k-1}) \quad (k = 1, 2, \dots) \end{array} \right.$ **需要2个初值 x_0 和 x_1 。**

→ **快速（双点）弦截法**

$$\left\{ \begin{array}{l} \text{初值 } x_0, x_1 \\ x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f(x_k) - f(x_0)} (x_k - x_0) \quad (k = 1, 2, \dots) \end{array} \right.$$



$$\begin{cases} \text{初值 } x_0, x_1 \\ x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f(x_k) - f(x_{k-1})} (x_k - x_{k-1}) \end{cases}$$

弦截法和快速弦截法计算一开始,
都需要给出2个初值 x_0 和 x_1 , 才能求出 x_2 ,
但到后面计算 x_{k+1} ($k>1$) 时,
弦截法只需要前面的信息 x_k 及 x_0 ,
而快速弦截法却需要用到前面两步信息 x_k 及 x_{k-1} ,
快速弦截法 \longrightarrow 两步法
前面介绍的迭代法、弦截法 \longrightarrow 单步法

2.5.3 快速弦截法的计算步骤

步一：准备 选定初始近似值 x_0, x_1 ，并计算相应的函数值 $f(x_0)$ 和 $f(x_1)$ 。

步二：迭代 计算

$$x_1 - \frac{f(x_1)}{f(x_1) - f(x_0)}(x_1 - x_0) \Rightarrow x_2,$$
$$x_1 \Rightarrow x_0, x_2 \Rightarrow x_1$$

步三：控制 如果 $|x_1 - x_0|$ (ϵ 为事先给定的精度要求)，则转步四；否则转步二

步四：结束 输出满足精度要求的根 x_1 。

例：用快速弦截法解方程 $x^3-2x-5=0$ ，取 $x_0=3, x_1=2$ ：

$$x_0=3 \qquad f(x_0)=3^3-2*3-5=16$$

$$x_1=2 \qquad f(x_1)=2^3-2*2-5=-1$$

$$x_2 = \frac{x_0 f(x_1) - x_1 f(x_0)}{f(x_1) - f(x_0)} = \frac{3*(-1) - 2*16}{(-1) - 16} = 2.058823529$$

$$f(x_2) = -0.390799919$$

$$\left\{ \begin{array}{l} \text{初值 } x_0, x_1 \\ x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f(x_k) - f(x_{k-1})} (x_k - x_{k-1}) = \frac{x_{k-1} f(x_k) - x_k f(x_{k-1})}{f(x_k) - f(x_{k-1})} \end{array} \right.$$

$$x_3 = \frac{x_1 f(x_2) - x_2 f(x_1)}{f(x_2) - f(x_1)} = 2.096558637$$

$$f(x_3) = 0.0224280615$$

$$x_4 = 2.094510554$$

$$f(x_4) = -4.568046392\text{e-}004$$

$$x_5 = 2.094551435$$

$$f(x_5) = -5.157851950\text{e-}007$$

$$x_6 = 2.094551482$$

$$f(x_6) = 1.188471543\text{e-}011$$

$$x_7 = x_6 = 2.094551482$$

弦截法解方程 $x^3-2x-5=0$, 取 $x_0=3, x_1=2$:

$$\begin{cases} \text{初值 } x_0, x_1 \\ x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f(x_k) - f(x_0)}(x_k - x_0) \end{cases}$$

$$x_{23} = 2.094551482 = x_{24}$$

收敛较慢

牛顿法一步要计算 $f(x)$ 和 $f'(x)$, 相当于2个函数值, 比较费时。

用弦截法, 一步只计算 $f(x)$, 少算一个函数值。

作业:

P159

1, 3, 5, 11