

计算方法

北京师范大学数学科学学院

主讲人：纪光华

Email: ghji@bnu.edu.cn

第二章、非线性方程的解法

本章主要内容

1. 二分法
2. 简单迭代法（不动点迭代法）
3. Newton迭代法

本章主要讨论非线性方程

$$f(x) = 0 \quad (1)$$

的求根问题, 这里 $x \in \mathbf{R}$, $f(x)$ 为连续函数. 若存在 x^* 使得 $f(x^*) = 0$, 则称 x^* 是(1)的根或函数 $f(x)$ 的零点. 若 $f(x)$ 可分解为

$$f(x) = (x - x^*)^m g(x),$$

其中 m 是正整数, 且 $g(x^*) \neq 0$. 当 $m = 1$, x^* 为单根, 当 $m \geq 2$, x^* 为 m 重根.

无法解析求解

1. $f(x)$ 为超越函数, 例 $f(x) = e^x + \frac{0.435}{x}(e^x - 1) - 1.564$;
2. $f(x)$ 为次数大于等于5的代数方程;

非线性方程求根步骤

1. 根的搜索：分析方程存在多少个实根，找出每个根所在的区间。
 - 1) 图解法. 即通过画函数的图形，了解根的分布情况.
 - 2) 近似方程法.
 - 3) 解析法. 用微积分基本理论来分析.
 - 4) 定步长搜索法. 利用连续函数的介值定理.
2. 根的精确化，求满足给定精度的根的近似值. 产生近似值序列 $\{x_n\}$

停机准则:

1. $|x_n - x_{n-1}| < \varepsilon$;
2. $\frac{|x_n - x_{n-1}|}{|x_n|} < \varepsilon, x_n \neq 0$;
3. $|f(x_n)| < \varepsilon$.

可能出现的困难:

- ▶ 1,2, 可能会出现 $|x_n - x_{n-1}| \rightarrow 0$, 但是 x_n 不收敛, 例

$$\text{如 } x_n = \sum_{i=1}^n \frac{1}{i};$$

- ▶ 3, $f(x_n)$ 与 0 很接近, 但是 x_n 与 x^* 相差较大, 例
如 $f(x) = (x-1)^{10}, x^* = 1, x_n = 1 + \frac{1}{n}$, 只要 $n > 1$ 就有 $f(x_n) < 10^{-1}$, 但是要使 $|x_n - x^*| < 10^{-1}$, 则必须 $n > 1000$ 。

2.1 二分法

二分法思想：依据连续函数的零点存在定理，反复将区间分半，在足够小的区间内，方程有且仅有一根。

考虑方程 $f(x) = 0$ ，设函数 $f(x) \in C[a, b]$ 且 $f(a)f(b) < 0$ 。

记 $a_0 = a$, $b_0 = b$. $x_0 = \frac{1}{2}(a_0 + b_0)$ 考虑区间 $[a_0, x_0]$ 和 $[x_0, b_0]$ 。

1. 若 $f(x_0) = 0$ ，则 x_0 就是根，计算结束。否则
2. 若 $f(x_0) \neq 0$ ，则 $f(a_0)f(x_0) < 0$ 和 $f(x_0)f(b_0) < 0$ 有且只有一个成立。
 - 1) 若 $f(a_0)f(x_0) < 0$ ，令 $a_1 = a_0$, $b_1 = x_0$ ；否则
 - 2) 若 $f(x_0)f(b_0) < 0$ ，令 $a_1 = x_0$, $b_1 = b_0$ 。
3. 考虑区间 $[a_1, b_1]$ ，有 $f(a_1)f(b_1) < 0$ ，重复上述步骤。
4. 按此方法可以得到一系列区间

$$[a_0, b_0] \supset [a_1, b_1] \supset [a_2, b_2] \supset \cdots \supset [a_k, b_k] \supset \cdots,$$

而且有

- 1) $b_k - a_k = \frac{1}{2^k}(b_{k-1} - a_{k-1}) = \frac{1}{2^k}(b - a)$;
- 2) $f(a_k)f(b_k) < 0$

当 $b_k - a_k$ 充分小时, 其中点 $x_k = \frac{1}{2}(b_k + a_k)$ 可作
为 $f(x) = 0$ 在 $[a, b]$ 内根的近似值. 且有估计式

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

对于给定精度 ε , 若取 k 使得

$$\frac{1}{2^{k+1}}(b - a) \leq \varepsilon,$$

则有

$$|x^* - x_k| \leq \varepsilon.$$

例2.1

用二分法求方程 $f(x) = x^3 + 4x^2 - 10 = 0$ 在区间 $[1, 1.5]$ 上的根.

1. 要得到具有3位有效数的近似根, 需作多少次二分;
2. 用二分法求具有3位有效数的近似根.

解: $f(1) = -5$, $f(1.5) = 2.375$,

当 $x \in [1, 1.5]$ 时, $f'(x) = 3x^2 + 8x > 0$, 方程 $f(x) = 0$ 在 $[1, 1.5]$
有唯一实根.

1. $a = 1, b = 1.5, \varepsilon = \frac{1}{2} \times 10^{-2}$, 由

$$\frac{b-a}{2^{k+1}} \leq \varepsilon,$$

得

$$k \geq \frac{2}{\lg 2} - 1 = 5.64,$$

故可以取 $k = 6$, 即将区间二分6次.

2. 计算结果见表(1) 如下, 所以得具有3位有效数字得近似值 $x_6 = 1.36328125$.

Table: 二分法算例

k	a_k ($f(a_k)$ 的符号)	x_k ($f(x_k)$ 的符号)	b_k ($f(b_k)$ 的符号)
0	1(-)	1.25(-)	1.5(+)
1	1.25(-)	1.375(+)	1.5(+)
2	1.25(-)	1.3125(-)	1.375(+)
3	1.3125(-)	1.34375(-)	1.375(+)
4	1.34375(-)	1.359375(-)	1.375(+)
5	1.359375(-)	1.3671875(+)	1.375(+)
6	1.359375(-)	1.36328125(-)	1.3671875(+)

Remark:

1. 当对 f 与 x^* 无附加认知时, 第二种停机准则最好, 它最接近相对误差;
2. 设置一个迭代次数的上界以避免程序死循环;
3. 用 $\text{sgn}(f(a_n)) * \text{sgn}(f(b_n)) < 0$ 代替 $f(a_n) * f(b_n) < 0$ 以避免数的溢出;

2.2 简单迭代法（不动点迭代法）

思想：通过递推产生一个序列，使其极限为方程的根.
设方程

$$f(x) = 0 \quad (3)$$

在 $[a, b]$ 内有一个根 x^* . 将方程改为等价形式

$$x = \varphi(x). \quad (4)$$

任取 $x_0 \in [a, b]$, 得到递推公式

$$x_{k+1} = \varphi(x_k), \quad k = 0, 1, 2, \dots. \quad (5)$$

从而得到序列 $\{x_k\}_{k=0}^{\infty}$. 如果当 $k \rightarrow \infty$ 时, 序列 $\{x_k\}_{k=0}^{\infty}$ 有极限 \tilde{x} , 且 $\varphi(x)$ 在 \tilde{x} 附近连续, 则在(5)两边取极限得

$$\tilde{x} = \varphi(\tilde{x}),$$

故有 $f(\tilde{x}) = 0$, 即

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

(5)称为迭代格式，称 $\varphi(x)$ 为迭代函数， $\{x_k\}_{k=0}^{\infty}$ 为迭代序列.
如果任取 $x_0 \in [a, b]$ 迭代序列收敛，则称迭代格式(5)收敛.
称 $e_k = x^* - x_k$ 为第 k 次迭代误差. 上述方法称为迭代法.
当 $x_0 \neq x^*$ 时，如果迭代序列在 $[a, b]$ 内无极限，则称迭代格式发散.

注1

当 $x^* = \varphi(x^*)$, x^* 称为不动点；上述方法称为不动点迭代法.

例2.2

求方程 $x^3 - x - 1 = 0$ 在 $x_0 = 1.5$ 附近的根.

方法1 将原方程写成等价的方程： $x = x^3 - 1$. 取迭代函数 $\varphi_1(x) = x^3 - 1$, 构造迭代格式

$$x_{k+1} = x_k^3 - 1, \quad k = 0, 1, 2, \dots \quad (6)$$

取初值 $x_0 = 1.5$, 计算结果:

k	0	1	2	3	...
x_k	1.5	2.375	12.396	1903.779	...

方法2 将原方程写成等价的方程: $x = \sqrt[3]{x+1}$. 取迭代函数 $\varphi_2(x) = \sqrt[3]{x+1}$, 构造迭代格式

$$x_{k+1} = \sqrt[3]{x_k + 1}, \quad k = 0, 1, 2, \dots$$

取初值 $x_0 = 1.5$, 计算结果:

k	0	1	2	3	...	7	8
x_k	1.5	1.35721	1.33086	1.32588	...	1.32472	1.32472

迭代法的收敛性

定理2.1

设 $\varphi(x)$ 在 $[a, b]$ 内存在一阶连续导数, 且满足:

1. 当 $x \in [a, b]$ 时, $\varphi(x) \in [a, b]$;
2. 存在正常数 $L < 1$, 当 $x \in [a, b]$ 时, $|\varphi'(x)| \leq L < 1$.

则

- (1) $x = \varphi(x)$ 在 $[a, b]$ 上有唯一实根, 记为 x^* ;
- (2) 对任意初值 $x_0 \in [a, b]$, 迭代格式(5)收敛, 且 $\lim_{k \rightarrow \infty} x_k = x^*$;
- (3)

$$|x^* - x_k| \leq \frac{L}{1-L} |x_k - x_{k-1}|, \quad k = 1, 2, 3 \cdots; \quad (7)$$

$$|x^* - x_k| \leq \frac{L^k}{1-L} |x_1 - x_0|, \quad k = 1, 2, 3 \cdots; \quad (8)$$

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{x^* - x_{k+1}}{x^* - x_k} = \varphi'(x^*). \quad (9)$$

定理2.2

设方程(4)在区间 $[a, b]$ 上有根, 且当 $x \in [a, b]$ 时 $|\varphi'(x)| \geq 1$, 则对任意 $x_0 \in [a, b]$, 且 $x_0 \neq x^*$, 迭代格式(5)发散.

例2.3

求方程 $f(x) = x^3 + 4x^2 - 10 = 0$ 在 $[1, 1.5]$ 内的根 x^* .

1. 试分析如下3个迭代格式的收敛性.

$$x_{k+1} = 10 + x_k - 4x_k^2 - x_k^3, \quad (10)$$

$$x_{k+1} = \frac{1}{2} \sqrt{10 - x_k^3}, \quad (11)$$

$$x_{k+1} = \sqrt{\frac{10}{x_k + 4}}. \quad (12)$$

2. 选择一种收敛较快的迭代格式, 求出 x^* , 精确至4位有效数.

解:

1) 迭代函数

$$\varphi(x) = 10 + x - 4x^2 - x^3, \quad (13)$$

$$\varphi'(x) = 1 - 8x - 3x^2. \quad (14)$$

当 $x \in [1, 1.5]$ 时 $|\varphi'(x)| \geq 10 > 1$, 所以迭代发散.

2) 迭代函数为 $\varphi(x) = \frac{1}{2}\sqrt{10 - x^3}$, 当 $x \in [1, 1.5]$ 时

$$\varphi'(x) = -\frac{3}{4} \frac{x^2}{\sqrt{10 - x^3}}, \quad |\varphi'(x)| = \left| \frac{3}{4} \frac{x^2}{\sqrt{10 - x^3}} \right| \nearrow, \quad \Rightarrow$$

$$|\varphi'(x)| \leq |\varphi'(1.5)| = 0.6556 < 1.$$

当 $x \in [1, 1.5]$ 时

$$1 < \varphi(1.5) \leq \varphi(x) \leq \varphi(1) = 1.5,$$

因此迭代收敛.

3) 同2)分析相同。 $|\varphi'(x)| \leq |\varphi'(1)| = \frac{\sqrt{2}}{10}$ 。

例2.4

给定方程 $x^2 + \ln x - 2 = 0$.

1. 分析该方程存在几个实根.
2. 构造一个迭代格式, 说明收敛性, 并用迭代求方程的根, 精确至4位有效数.

解:

1. 记 $f(x) = x^2 + \ln x - 2$.

$$f(1) = 1 - 2 < 0, f(2) = 4 + \ln 2 - 2 > 0, f'(x) = 2x + \frac{1}{x} > 0,$$

所以方程 $f(x) = 0$ 有唯一实根 $x^* \in (1, 2)$.

2. 构造迭代格式:

$$x_{k+1} = \sqrt{2 - \ln x_k}, \quad k = 0, 1, \dots, \\ x_0 = 1.3.$$

分析: 迭代函数 $\varphi(x) = \sqrt{2 - \ln x}$.

$$1) \quad \forall x \in [1, 2], \varphi'(x) = -\frac{1}{2x\sqrt{2 - \ln x}},$$

$$|\varphi'(x)| = \frac{1}{2x\sqrt{2 - \ln x}} \leq \frac{1}{2\sqrt{2 - \ln 2}} < 1.$$

2) 当 $x \in [1, 2]$ 时,

$$1 < \sqrt{2 - \ln 2} \leq \varphi(2) \leq \varphi(x) \leq \varphi(1) \leq \sqrt{2} < 2.$$

由定理2.1, 迭代收敛.

计算得 $x_1 = 1.318194$, $x_2 = 1.312911$, $x_3 = 1.314440$,
 $x_4 = 1.313997$, $|x_4 - x_3| < \frac{1}{2} \times 10^{-3}$, $x^* \approx 1.313997$.

注2

定理2.1的条件一般不太容易验证，而且第二个条件很难在很大的范围内成立。

定义2.1

对于方程 $x = \varphi(x)$ ，若在 x^* 的某个邻域 $S = \{x \mid |x - x^*| \leq \delta\}$ 内，对任意初值 $x_0 \in S$ 迭代格式 $x_{k+1} = \varphi(x_k)$ 都收敛，则称迭代法在 x^* 的附近局部收敛。

定理2.3

设方程 $x = \varphi(x)$ 有根 x^* ，且在 x^* 的某个邻域 $S = \{x \mid |x - x^*| \leq \delta\}$ 内 $\varphi(x)$ 一阶连续可导，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。

收敛速度

定义2.2

设序列 $\{x_k\}$ 收敛于 x^* , 并记 $e_k = x^* - x_k$. 如果存在常数 $p \geq 1$ 及非零常数 C , 使得

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

则称序列 $\{x_k\}$ 是 p 阶收敛的.

p 的大小反映了序列 $\{x_k\}$ 的收敛速度, p 越大, 收敛越快.

当 $p = 1$ 且 $0 < |C| < 1$ 时, 称为线性收敛;

当 $p > 1$ 称超线性收敛, 特别当 $p = 2$ 时, 称平方收敛.

如果迭代 $x_{k+1} = \varphi(x_k)$, $k = 0, 1, \dots$ 产生的迭代序列 $\{x_k\}_{k=0}^{\infty}$ 是 p 阶收敛的, 则称该迭代是 p 阶收敛的.

收敛速度比较

例2.5

设两个迭代格式分别是线性收敛和平方收敛：(1) $\frac{e_{k+1}}{e_k} = \frac{1}{2}$;

(2) $\frac{\tilde{e}_{k+1}}{\tilde{e}_k^2} = \frac{1}{2}$ 。其中 $e_0 = \tilde{e}_0 = 1$ 。如果取精度 $\varepsilon = 10^{-16}$ ，试估计这两个迭代格式所需要的迭代次数。

解：

1. $\frac{e_{k+1}}{e_k} = \frac{1}{2} (k = 0, 1, 2, \dots), e_0 = 1, \rightarrow e_k = \frac{e_{k-1}}{2} = \dots =$

$\frac{e_0}{2^k} = \frac{1}{2^k}$, 要使得 $|e_k| \leq 10^{-16}$, 只要 $k \geq 53.15$.

2. $\frac{\tilde{e}_{k+1}}{\tilde{e}_k^2} = \frac{1}{2} (k = 0, 1, 2, \dots), \tilde{e}_0 = 1,$

$\tilde{e}_k = \frac{\tilde{e}_{k-1}^2}{2} = \frac{1}{2} \left(\frac{\tilde{e}_{k-2}^2}{2} \right)^2 = \left(\frac{1}{2} \right)^{1+2} (\tilde{e}_{k-1})^{2^2} = \dots =$

$\left(\frac{1}{2} \right)^{1+2+\dots+2^{k-1}} \tilde{e}_0^{2^k}$, 同样的误差限, 只需 $k \geq 5.76$.

定理2.4

若 $\varphi(x)$ 在 x^* 附近的某个邻域内有 $p(\geq 1)$ 阶连续导数, 且

$$\varphi^{(k)}(x^*) = 0, \quad k = 1, 2, \dots, p-1, \quad (15)$$

$$\varphi^{(p)}(x^*) \neq 0, \quad (16)$$

则迭代格式在 x^* 附近是 p 阶局部收敛的, 且有

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{x^* - x_{k+1}}{(x^* - x_k)^p} = (-1)^{p-1} \frac{\varphi^{(p)}(x^*)}{p!}. \quad (17)$$

如果 $p = 1$, 要求 $|\varphi'(x^*)| < 1$.

Aitken加速法

假设迭代格式 $x_{k+1} = \varphi(x_k)$ 是收敛的, 则有

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

则, 当 k 充分大时, 有

$$\frac{x_{k+2} - x^*}{x_{k+1} - x^*} \approx \frac{x_{k+1} - x^*}{x_k - x^*},$$

解出得

$$x^* \approx \frac{x_k x_{k+2} - x_{k+1}^2}{x_k - 2x_{k+1} + x_{k+2}}.$$

定理2.5

设方程 $x = \varphi(x)$ 有根 x^* , 且在 x^* 附近 $\varphi(x)$ 有2阶连续导数, 如果迭代格式 $x_{k+1} = \varphi(x_k)$ 线性收敛, 则迭代 $x_{k+1} = \Phi(x_k)$ 平方收敛, 其中

$$\Phi(x) = \frac{x\varphi(\varphi(x)) - \varphi^2(x)}{x - 2\varphi(x) + \varphi(\varphi(x))}. \quad (18)$$

注3

如果格式 $x_{k+1} = \varphi(x_k)$ 是 $p(\geq 2)$ 阶收敛的, 而且在 x^* 附近 $\varphi(x)$ 有 p 阶连续导数, 则上述加速迭代格式可以达到 $2p - 1$ 阶收敛性。

Aitken Δ^2 方法

$$\begin{aligned}x^* &\approx \frac{x_n x_{n+2} - 2x_n x_{n+1} + x_n^2 - x_{n+1}^2 + 2x_n x_{n+1} - x_n^2}{x_{n+2} - 2x_{n+1} + x_n} \\&\approx x_n - \frac{(x_{n+1} - x_n)^2}{x_{n+2} - 2x_{n+1} + x_n}, \\ \hat{x}_n &= x_n - \frac{(x_{n+1} - x_n)^2}{x_{n+2} - 2x_{n+1} + x_n}\end{aligned}$$

定义 $\Delta x_n = x_{n+1} - x_n$, 则Aitken加速公式可以写成

$$\hat{x}_n = x_n - \frac{(\Delta x_n)^2}{\Delta^2 x_n}, n \geq 0 \quad (19)$$

2.3 Newton 迭代法

给定方程

$$f(x) = 0 \quad (20)$$

若已知 x_k , 将 $f(x)$ 在 x_k 处做Taylor展开, 得到

$$f(x) \approx f(x_k) + f'(x_k)(x - x_k).$$

于是得到(20)的近似方程

$$f(x_k) + f'(x_k)(x - x_k) = 0.$$

其根为 $x_k - \frac{f(x_k)}{f'(x_k)}$ 可作为方程(20)的近似根. 因此得下面的Newton迭代:

$$x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f'(x_k)}, \quad k = 0, 1, \dots. \quad (21)$$

Newton法的几何意义: 以直线替代曲线。

例2.6

给定方程 $e^x + x - 3 = 0$

1. 判别该方程实根个数.
2. 用 *Newton* 迭代法求方程的根, 要求精确到3位有效数.

1. 记 $f(x) = e^x + x - 3$.

$$f(0) = 1 + 0 - 2 < 0, f(1) = e + 1 - 3 > 0,$$

$f'(x) = e^x + 1 > 0$, 所以方程 $f(x) = 0$ 有唯一实根 $x^* \in (0, 1)$.

2. 迭代格式:

$$x_{k+1} = x_k - \frac{e^{x_k} + x_k - 3}{e^{x_k} + 1}, \quad k = 0, 1, \dots,$$

$$x_0 = 0.5.$$

计算得 $x_1 = 0.8214$, $x_2 = 0.7924$, $x_3 = 0.7921$,

$$|x_3 - x_2| < \frac{1}{2} \times 10^{-3}, \quad x^* \approx 0.7921.$$

Newton迭代的收敛性

定理2.6

设 $f \in C^2[a, b]$, 如果 $x^* \in (a, b)$ 满足 $f(x^*) = 0, f'(x^*) \neq 0$, 则存在一个 $\delta > 0$ 使得对于任意初始值 $x_0 \in [x^* - \delta, x^* + \delta]$, *Newton*法产生的数列 $\{x_n\}_{n=1}^{\infty}$ 都二阶收敛到 x^*

例2.7

Newton法求方程

$$f(x) = (x - 1.56)^3(x - 4.56) = 0$$

的根。

解 $x_1^* = 4.56$ 为 $f(x) = 0$ 的单根, $x_2^* = 1.56$ 为 $f(x) = 0$ 的3重根。分别取 $x_0 = 5.000000$ 和 $x_0 = 2.000000$, 应用Newton迭代法计算列表, 看出求 x_1^* 收敛很快, 而求 x_2^* 收敛很慢。

Table: Newton迭代法求单根算例

k	x_k
0	5.000000
1	4.682017
2	4.572805
3	4.560161
4	4.56000

Table: Newton迭代法3重单根算例

k	x_k	k	x_k
0	2.000000	10	1.567042
1	1.844420	11	1.564692
2	1.246184	12	1.563128
3	1.682723	13	1.562085
4	4.56000	14	1.561390
5	1.641225	15	1.560926
6	1.613896	16	1.560617
7	1.595821	17	1.560412
8	1.575867	18	1.560274
9	1.570569	19	1.560183

割线法

$$x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f(x_k) - f(x_{k-1})}(x_k - x_{k-1}), \quad (22)$$

例2.8

分别用Newton法和割线法求解 $x = \cos x$ 的解。

步数	割线法	Newton法
0	0.5	0.7853981635
1	0.7853981635	0.7395361337
2	0.7363841388	0.7390851781
3	0.7390581392	0.7390851332
4	0.7390851493	0.7390851332
5	0.7390851332	

试位法

和割线法同样的方式产生近似解，但是增加一个检验以保证相邻的迭代之间包含根。

1. 选择初始近似值 x_0, x_1 满足 $f(x_0) \cdot f(x_1) < 0$;
2. 由割线法产生近似值 $x_2 = x_1 - \frac{f(x_1)}{f(x_1) - f(x_0)}(x_1 - x_0)$;
3. 如果 $\text{sgn}(f(x_2)) \cdot \text{sgn}(f(x_1)) < 0$ 则 x^* 介于 x_1, x_2 之间， x_3 取 $(x_1, f(x_1)), (x_2, f(x_2))$ 连线与 x 轴的交点。
$$x_3 = x_2 - \frac{f(x_2)}{f(x_2) - f(x_1)}(x_2 - x_1)$$
4. 否则， x_3 取 $(x_0, f(x_0)), (x_2, f(x_2))$ 连线与 x 轴的交点，然后交换 x_0, x_1 的下标。

重根的情形

设 x^* 是方程 $f(x) = 0$ 的 m 重

根, $f(x^*) = f'(x^*) = \dots = f^{(m-1)}(x^*) = 0, f^{(m)}(x^*) \neq 0$

1. 若 m 已知, 迭代修正为

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

2. 若 m 未知, 记 $u(x) = \frac{f(x)}{f'(x)}$, 此时 x^* 是方程 $u(x) = 0$ 的单根, 迭代修正为

$$x_{k+1} = x_k - \frac{u(x_k)}{u'(x_k)}, \quad k = 0, 1, \dots$$

取 $x_0 = 2$, 用修正的Newton法求例(2.7)

$$x_{k+1} = x_k - 3 \frac{f(x_k)}{f'(x_k)}$$

Table: 修正Newton法求重根

k	0	1	2	3
x_k	2.000000	1.533260	1.5559921	1.560000

Newton迭代的大范围收敛性

定理2.7

设函数 $f(x)$ 在区间 $[a, b]$ 内2阶连续可导, 且满足:

1. $f(a)f(b) < 0$;
2. 当 $x \in [a, b]$ 时, $f'(x) \neq 0$;
3. 当 $x \in (a, b)$ 时, $f''(x)$ 保号;
4. $a - \frac{f(a)}{f'(a)} \leq b, \quad b - \frac{f(b)}{f'(b)} \geq a$.

则对 $\forall x_0 \in [a, b]$, Newton迭代格式

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

收敛到方程 $f(x) = 0$ 在 $[a, b]$ 内的唯一实根.

例2.9

考虑方程

$$\sin x = \frac{x}{2}$$

(1) 讨论方程在区间 $[\frac{\pi}{2}, \pi]$ 上根的存在唯一性以及采用Newton迭代法的收敛性;

(2) 用Newton法求根, 精确至5位有效数字。
解 记

$$f(x) = \sin x - \frac{x}{2}$$

首先检验大范围收敛定理的4个条件, 知该方程在区间 $[\frac{\pi}{2}, \pi]$ 内有唯一根 x^* , 选取任意初值都收敛。迭代公式为

$$x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f'(x_k)} = x_k - \frac{\sin x_k - \frac{x_k}{2}}{\cos x_k - \frac{1}{2}}$$

取 $x_0 = \pi$, 得序列如下表

Table: Newton法大范围收敛性算例

k	0	1	2	3	4	5
x_k	π	2.09440	1.91322	1.89567	1.89549	1.89549

上机作业(2023.02.23)

每个方程有一个实根，分别用二分、牛顿法和割线法求近似根，精确到小数点后8位，然后对牛顿法采用Aitken加速。

1. $\sin x = 6x + 5;$

2. $\ln x + x^2 = 3;$