Pracownia z Analizy Numerycznej

Sprawozdanie do zadania P1.7

Mateusz Leonowicz

November 7, 2020

1 Wstęp

Wiele problemów w matematyce, fizyce czy informatyce sprowadzić można do wyznaczenia miejsc zerowych danego równania algebraicznego. Często nie wystarczy nam prosta analiza funkcji, a jedyne co możemy zrobić, to obliczenie jej wartości w danej, skończonej liczbie punktów jej dziedziny. Dlatego temat ten stał się jednym z fundamentalnych zagadnień analizy numerycznej, dzięki czemu powstało wiele metod iteracyjnych, które oczywiście mają swoje zalety i wady.

Celem tego sprawozdania jest przedstawienie metod obliczania pierwiastków wielomianów w postaci

$$ax^3 + bx^2 + cx + d = 0 \qquad a, b, c, d \in \mathbb{R}$$

które pozwalają komputerom na uzyskanie wyników z kontrolowanym błędem. Przedstawię trzy metody numeryczne oraz rozwiązania z użyciem wzorów Cardano. Opiszę ich działadnie i charakterystykę, a następnie umieszczę ich porównanie razem z podsumowaniem.

Wszystkie testy przeprowadzane będą z użyciem języka do analizy numerycznej Julia.

Contents

1	$\mathbf{W}\mathbf{step}$	1
2	Metoda Newtona	2
3	Metoda biskecji	3
4	Metoda Bairstowa	4
5	Wzory Cardano	5
6	Testy numeryczne 6.1 Dobór przybliżenia pierwiastka	7 8 9 10
	6.6 Test 5	

2 Metoda Newtona

Niech f(x) będzie funkcją, której miejsce zerowe chcemy wyznaczyć. Niech α będzie takim zerem, a x jego przybliżeniem. Z twierdzenia Taylora, wiemy, że przybliżenie funkcji f, możemy zapisać w postaci:

$$0 = f(\alpha) = f(x+e) = f(x) + ef'(x) + \frac{f''(\xi)}{2!}e^2 \qquad \xi \in interv(x,\alpha)$$
 (1)

Jeśli nasz wyraz $\frac{f''(\xi)}{2!}e^2$ będzie dostatecznie mały, to możemy go pominąć i rozwiązać równanie względem e, co daje nam:

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

Jeśli x jest dostatecznie dobrym przybliżeniem α , to x-e będzie jeszcze lepszym przybliżeniem tego pierwiastka. Na tej różnicy opiera się metoda Newtona, która po wybraniu startowego przybliżenia x_0 zera α polega na stosowaniu rekurencyjnego wzoru:

$$x_{n+1} = x_n - \frac{f(x)}{f'(x)} \qquad n \ge 0 \tag{2}$$

Dobranie startowego punktu x_0 w tej metodzie jest bardzo istotne, gdyż metoda Newtona nie zawsze jest zbieżna. Jeśli dobierzemy odpowiednio punkt początkowy będziemy mieli zbieżność kwadratową, z wyjątkiem przypadków, gdy istnieją wielokrotne zera funkcji. Wtedy otrzymamy zbieżność liniową.

Metoda Newtona opiera się na linearyzacji funkcji f, co pozwala nam na dobre przybliżanie wartości funkcji w małym otoczeniu punktu x. Możemy więc rozumieć tę metodę, jako przybliżanie miejsc zerowych funkcji za pomocą jej stycznych, co oczywiście niesie za sobą groźbę rozbieżności.

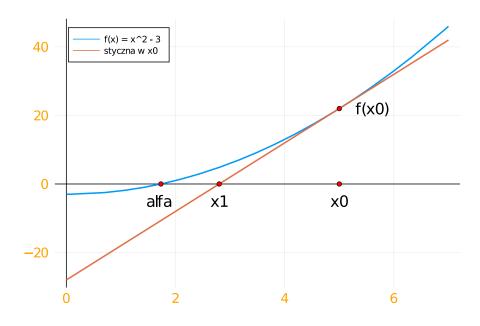


Figure 1: Interpretacja geometryczna metody Netwona

3 Metoda biskecji

Niech f będzie funkcją ciągłą w przedziale [a,b] i jeśli f(a)f(b) < 0, czyli funkcja zmienia znak na końcach przedziałów, to ta funkcja musi mieć zero w przedziale (a,b) i jest to oczywiście konsekwencja twierdzenia Darboux. Możemy więc zmniejszyć nasz przedział o połowę wybierając punkt c, taki że f(c)f(a) < 0 lub f(c)f(b) < 0. Uzyskaliśmy nowy przedział, w którym wiemy, że znajduje się nasze miejsce zerowe. Na tym rozumowaniu opiera się metoda biskecji, którą wyrazić można następującym algorytmem:

Algorithm 1 Szukanie pierwiastka funkcji f

```
Require: \epsilon \ a_0 \ b_0 \ M takie, że f(a_0)f(b_0) < 0
  n \leftarrow 1
  left \leftarrow a_0
  right \leftarrow b_0
   while n < M do
     c = \frac{left + right}{2}
     if f(c) = 0 \lor |left - right| < \epsilon then
         pierwiastkiem jest c
     else
         n \leftarrow n + 1
     end if
     if f(left)f(c) < 0 then
         left \leftarrow c
     else
         right \leftarrow c
     end if
   end while
```

Algorytm uwzględnia trzy kryteria zakończenia obliczeń, ponieważ inaczej istniałoby ryzyko zapętlenia. Pierwszym jest oczywiście znalezienie takiego punkt c, że f(c) = 0. Drugim z nich jest skończona liczba iteracji wyrażona zmienną M. Oprócz tego, obliczenia są przerywane, jeżeli błąd jest dostatecznie mały, tj. mniejszy od ϵ . Łatwo znaleźć przykłady funkcji w których brak któregoś z kryterów mógłby prowadzić do bardzo błędnych wyników.

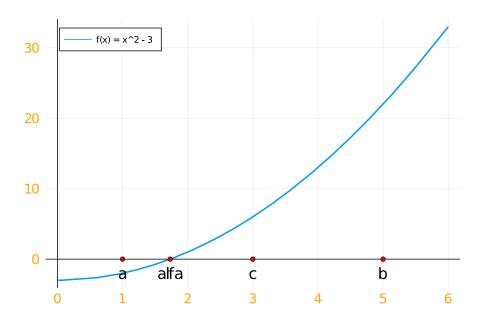


Figure 2: Interpretacja geometryczna metody bisekcji

4 Metoda Bairstowa

Wymienione metody do tej pory, oprócz oczywistych problemów z wybraniem początkowych wyrazów, czy niejednolitą zbieżnością, mają jedną o wiele poważniejszą dla nas wadę. W ich akutalnej postaci, jeśli nasza funkcja f będzie miała pierwiastki zespolone, to ich nie wyznaczymy. Do tego potrzebujemy bardziej zaawansowanego i ogólnego algorytmu. Najpierw przedstawię kilka letmatów, które przydadzą się do wyprowadzenia metody Bairstowa.

Theorem 1. Wielomian stopnia n ma dokładnie n pierwiastków w przestrzeni zespolonej, gdy każdy z nich liczony jest tyle razy, ile wynosi jego krotność.

Theorem 2. Jeśli wielomian w(x) stopnia $n \in \mathbb{N}$ ma współczynniki $a_i \in \mathbb{R}$, $0 \le i \le n$, oraz $\alpha \in \mathbb{C} \setminus \mathbb{R}$ jest jego miejscem zerowym, to $\overline{\alpha}$ też jest jego miejscem zerowym, a iloczyn kwadratowy $(x - \alpha)(x - \overline{\alpha})$ dzieli bez reszty wielomian w(x).

Proof. Mamy wielomian $w(x) = a_n x^n + a_{n-1} x^{n-1} + \ldots + a_0 x^0$, oraz z założenia wiemy, że $w(\alpha) = 0$. Korzystając z dwóch własności sprzężenia $\overline{x+y} = \overline{x} + \overline{y}$, $\overline{xy} = \overline{xy}$ otrzymujemy wprost równość: $w(\overline{\alpha})$. Ponieważ α jest pierwiastkiem nierzeczywistym, to $\alpha \neq \overline{\alpha}$. Z twierdzenia o reszcie, wynika, że iloczyn $(x-\alpha)(x-\overline{\alpha})$ dzieli nasz wielomian bez reszty.

Theorem 3. Dzielenie wielomianu

$$w(x) = a_n x^n + a_{n-1} x^{n-1} + \dots + a_0 x^0$$

Przez wielomian w postaci $(x^2 - ux - v)$ $u, v \in \mathbb{C}$ daje iloraz i resztę równe:

$$\phi(x) = b_n x^{n-2} + b_{n-1} x^{n-3} + \dots + b_2 x^0$$
$$r(x) = b_1 (z - u) + b_0$$

Których współczynniki dane są rekurencyjnym wzorem:

$$b_{n+1} = b_{n+2} = 0,$$
 $b_k = a_k + ub_{k+1} + vb_{k+2}$ $(n \le k \le 0).$ (3)

Dowód jest dość prosty i polega na porównaniu współczynników po obu stronach równania:

$$w(x) = \phi(x)(x^2 - ux - v) + r(x)$$

Dla każdego wielomianu w stopnia $n \leq 2$ znajdziemy więc takie u i v, że nasz wielomian $(x^2 - ux - v)$ będzie dzielił w bez reszty. Na szukaniu tych rzeczywistych czynników opiera się metoda Bairstowa. W r(x) nasze współczynniki b_0 i b_1 zależą od u i v, więc zapiszmy:

$$b_0(u,v) = 0$$
 $b_1(u,v) = 0$

Są to równania nieliniowe, dwuargumentowe. Szukamy więc takich poprawek oznaczonych δu i δv , które spełniałyby równanie:

$$b_0(u + \delta u, v + \delta v) = b_1(u + \delta u, v + \delta v) = 0$$

Z twierdzenia Taylora możemy zlinearyzować powyższe równości, co daje:

$$b_0(u,v) + \frac{\partial b_0}{\partial u} \delta u + \frac{\partial b_0}{\partial v} \delta v = 0$$

$$b_1(u,v) + \frac{\partial b_1}{\partial u} \delta u + \frac{\partial b_1}{\partial v} \delta v = 0$$
(4)

Zdefiniujmy więc wyrazy pomocnicze, które oczywiście spełniają rekurencyjną zależność z (3):

$$c_k = \frac{\partial b_k}{\partial u} \qquad (0 \le k \le n)$$

Podstawiając do równań z (4) i uzależniając równania od δv i δu otrzymujemy:

$$\delta u = (c_1b_1 - c_2b_0)\frac{1}{I}$$

$$\delta v = (c_1 b_0 - c_0 b_1) \frac{1}{7}$$

$$J = c_0 c_2 - c_1^2$$

Otrzymaliśmy więc wzór na lepsze przybliżenie naszej pary (u, v).

5 Wzory Cardano

Do rozwiązywania takich problemów w przypadku wielomianów 3 stopnia posłużyć również mogą wzory dające nam wprost pierwiastki funkcji. Wzory Cardano są dość skomplikowane matematycznie, ale są proste do wyprowadzenia i udowodnienia, dlatego przedstawię krótki opis. Niech f będzie wielomianem 3 stopnia:

$$f(x) = ax^3 + bx^2 + cx + d$$

wtedy możemy przekształcić naszą funkcję f do alternatywnej postaci

$$g(y) = y^3 + Qy - 2R$$

$$y = x + \frac{b}{3a}$$
, $Q = \frac{3ac - b^2}{9a^2}$, $R = \frac{9abc - 27a^2d - 2b^3}{54a^3}$

Teraz, niech y = (u + v), gdzie uv = -Q. Przekształcając otrzymujemy nową postać naszej funkcji.

$$g(u+v) = u^6 - 2Ru^3 - Q^3$$

Widzimy, że otrzymujemy funkcję kwadratową względem u^3 , więc dostajemy równości:

$$u^{3} = \frac{2R \pm \sqrt{4Q^{3} + 4R^{2}}}{2} = R \pm \sqrt{Q^{3} + R^{2}}$$

Niech $u^3 = R + \sqrt{Q^3 + R^2}$. Mamy wtedy:

$$v^3 = -\frac{Q^3}{u^3} = R - \sqrt{Q^3 + R^2}$$

Jeśli weźmiemy $u^3=R-\sqrt{Q^3+R^2}$, to analogicznie otrzymamy $v^3=R+\sqrt{Q^3+R^2}$. Bez straty ogólności przyjmijmy, że

$$S = \sqrt[3]{u^3} = \sqrt[3]{R + \sqrt{Q^3 + R^2}}$$

$$T = \sqrt[3]{v^3} = \sqrt[3]{R - \sqrt{Q^3 + R^2}}$$

Wtedy istnieje oczywiście 9 kombinacji dla wartości v, u, ale tylko 3 z nich pasują do naszych warunków. Są to

$$\begin{split} u &= S \wedge v = T \\ u &= (-\frac{1}{2} + \frac{i\sqrt{3}}{2})S \wedge v = (-\frac{1}{2} - \frac{i\sqrt{3}}{2})T \\ u &= (-\frac{1}{2} - \frac{i\sqrt{3}}{2})S \wedge v = (-\frac{1}{2} + \frac{i\sqrt{3}}{2})T \end{split}$$

Nasze pierwiastki zespolone x_0, x_1, x_2 równe więc są:

$$x_0 = S + T - \frac{b}{3a}$$

$$x_1 = -\frac{S+T}{2} - \frac{b}{3a} + \frac{i\sqrt{3}}{2}(S - T)$$

$$x_2 = -\frac{S+T}{2} - \frac{b}{3a} - \frac{i\sqrt{3}}{2}(S - T)$$

Wzory te dają nam pierwiastki wielomianu najszybciej Może okazać się jednak, że proste operacje arytmetyczne, które wykonywane są po drodze bardzo wpłyną na nasz wynik dając przekłamane zera. Głównie problemem okazać się może utrata cyfr znaczących przy odejmowaniu dwóch bliskich sobie liczb.

6 Testy numeryczne

Tę sekcję poświęcę na porównanie opisanych przeze mnie metod poprzez zestawienie ze sobą wyników zbieżnością do pierwiastków wybranych przeze mnie wielomianów 3-go stopnia. Metodę biskecji potraktuję raczej jako ciekawostkę i umieszczę ją tylko w pierwszych testach, ponieważ sam problem doboru przedziału dyskwalifikuje ją jako efektywną metodę.

6.1 Dobór przybliżenia pierwiastka

Dla metody Newtona będę stosował algorytm do wybierania pierwszego przybliżenia pierwiastka. Polega on na rozpoznaniu, czy pierwiastek rzeczywisty funkcji leży między zerami jej pochodnej, czy poza nimi. Niech f będzie wielomianem 3-go stopnia i niech f' będzie jego pochodną. Jeśli f' ma pierwiastki rzeczywiste, to niech będą to $x_1 \leq x_2$. Sprawdźmy więc, czy funkcja zmienia znak poza zerami pochodnej. Jeżeli

$$sgn(x_1 - \frac{1}{2}) = sgn(a)$$

to nasze pierwsze przybliżenie będzie równe $x_1 - \frac{1}{2}$. Jeśli ten warunek nie zachodzi, to sprawdzamy analogicznie dla punktu $x_2 + \frac{1}{2}$. Jeśli funkcja nie zmienia znaku poza tymi punktami, to wybieramy dowolnie punkt między zerami pochodnej.

Jeśli nasza pochodna nie ma pierwiastków rzeczywistych, to pozostaje nam dobrać punkt startowy arbitralnie.

Przez C. z. oznaczam liczbe cyfr znaczących, a e(x) oznacza błąd bezwzględny przybliżenia pierwiastka.

6.2 Test 1

Prosta funkcja przykładowa, aby zaprezentować sposób prezentacji danych oraz kryteria porównawcze.

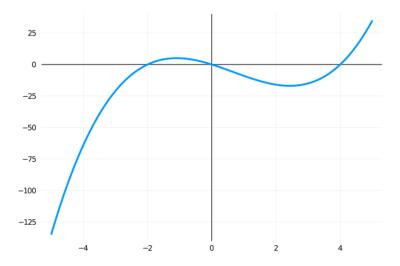


Figure 3: $f(x) = x^3 - 2x^2 - 8x$

Metoda Newtona

Iteracja	x_0	$f(x_0)$	C.z. x_0	C.z. x_1	C.z. x_2
1	87.40256216597504	683055.1593426905	0	0	0
5	4	0	\inf +	\inf +	\inf +
10	4	0	\inf +	\inf +	\inf +

Metoda Bisekcji

Iteracja	x_0	$f(x_0)$	C.z. x_0	C.z. x_1	C.z. x_2
1	2.500000	-8.125000	0	0	0
5	4.531250	15.722198	1	0	0
10	4.018555	0.448762	2	2	2
15	3.999481	-0.012448	3	3	3
20	3.999982	-0.000435	5	5	5

Metoda Bairstowa

Iteracja	x_0	$f(x_0)$	C.z. x_0	C.z. x_1	C.z. x_2
1	-3.14625657737552	-25.77238332178403	0	0	0
5	-1.5183794715 - 2.1659587805i	34.78812403 - 0.6466883761i	0	2	0
10	-2.0	0.0	\inf +	\inf +	inf+
15	-2.0	0.0	\inf +	\inf +	\inf +

$$e(x_0) = 0$$
 $e(x_1) = 0$ $e(x_2) = 0$

6.3 Test 2

Funkcja, która ma miejsca zerowe odległe od 0, oraz podwójny pierwiastek rzeczywisty.

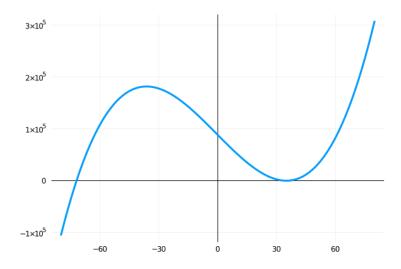


Figure 4: $f(x) = x^3 + 2x^2 + 3815x - 88200$

Metoda Newtona

Iteracja	x_0	$f(x_0)$	C.z. x_0	C.z. x_1	C.z. x_2
1	23.11296895543223	13439.605853832152	0	0	0
5	34.33910684864469	46.44676930300225	1	0	0
10	34.97947097899548	0.04508550349326828	2	0	0
25	34.999999399616065	3.9879819941898415e-11	8	\inf +	8
40	34.99999999967189	-1.9895119090292067e-12	9	\inf +	9

Metoda Bisekcji

Iteracja	x_0	$f(x_0)$	C.z. x_0	C.z. x_1	C.z. x_2
1	-100	-510300	0	0	0
5	-75	-36300	0	0	0
15	-72.003173828125	-36.339313896678505	2	1	1
25	-72.00000286102295	-0.032755853497292285	6	2	2

Metoda Bairstowa

Iteracja	x_0	$f(x_0)$	C.z. x_0	C.z. x_1	C.z. x_2
1	75.91167528178869	247569.41096827542	0	0	0
5	-71.99999999198174	9.18010833055059e-5	7	2	2
10	-71.9999999999976	2.7679476488628924e-9	13	3	3
20	-72.0	0.0	\inf +	6	6

$$e(x_0) = 0$$
 $e(x_1) = 0$ $e(x_2) = 0$

6.4 Test 3

Funkcja mająca 2 pierwiastki zespolone i jeden rzeczywisty znacznie oddalony od 0.

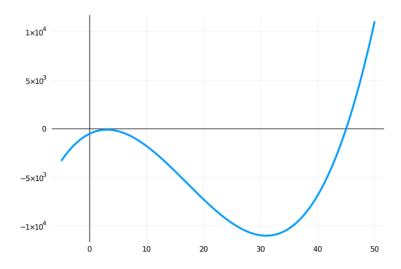


Figure 5: $f(x) = x^3 - 51x^2 + 281.25x - 506.25$

Metoda Newtona

Iteracja	x_0	$f(x_0)$	C.z. x_0	C.z. x_1	C.z. x_2
1	289.1961123377604	$2.0002217043731242\mathrm{e}7$	0	0	0
5	73.9670126666814	145952.2308328106	0	0	0
10	45.00001645738978	0.029067887456002296	6	0	0
15	45.0	0	\inf +	\inf +	\inf +

Metoda Bisekcji

Iteracja	x_0	$f(x_0)$	C.z. x_0	C.z. x_1	C.z. x_2
1	25.0	-9725.0	0	0	0
5	43.75	-2078.515625	0	0	0
15	44.921875	-137.4760627746582	1	0	0
20	44.99998092651367	-0.03368851466803574	5	4	4

Metoda Bairstowa

Iteracja	x_0	$f(x_0)$	C.z. x_0	C.z. x_1	C.z. x_2
1	75.91167528178869	247569.41096827542	0	0	0
5	-71.99999999198174	9.18010833055059e-5	7	2	2
10	-71.9999999999976	2.7679476488628924e-9	13	3	3
20	-72.0	0.0	\inf +	6	6

$$e(x_0) = 0$$
 $e(x_1) = 8.881784197001252e - 16$ $e(x_2) = 8.881784197001252e - 16$

6.5 Test 4

Funkcja, która ma pierwiastki rzeczywiste bardzo blisko siebie

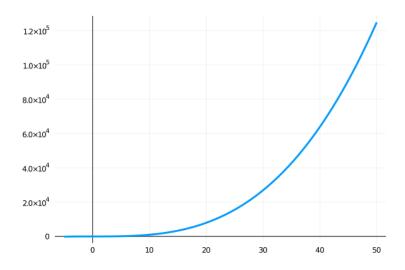


Figure 6: $f(x) = x^3 + 2.36995x^2 - 38.976263499999995x + 68.71088465$

Metoda Newtona

Iteracja	x_0	$f(x_0)$	C.z. x_0	C.z. x_1	C.z. x_2
1	2.0113803008969344	7.732777080647594	0	0	0
5	0.4263474940328461	0.05932089727765367	1	1	1
10	0.10692149626617695	7.912797366119274e-5	1	2	2
15	0	0	\inf +	\inf +	\inf +

Metoda Bairstowa

Iteracja	x_0	$f(x_0)$	C.z. x_0	C.z. x_1	C.z. x_2
1	$0.84033613 + 1.21947221 \mathrm{im}$	-3.07751250 + 0.56499945im	0	\inf +	0
5	$0.37452953 + 0.39006335 \mathrm{im}$	9.18010833055059e-5	1	\inf +	1
15	0.10000018685790094	1.8685859924824825e-9	7	\inf +	3
25	0.10000000000000013	1.2490009027033043e-18	15	\inf +	6

$$e(x_0) = 0$$
 $e(x_1) = 2.3629366184170625e - 10$ $e(x_2) = 2.3629364796391844e - 10$

6.6 Test 5

Funkcja, o wybranych współczynnikach tak, aby oblczenia były 'niebezpieczne' numerycznie.

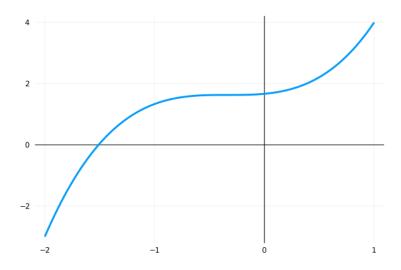


Figure 7: $f(x) = x^3 + 1.0000001038583122x^2 + 0.33333364701740337x + 1.6666667812898837$

Metoda Newtona

Iteracja	x_0	$f(x_0)$	C.z. x_0	C.z. x_1	C.z. x_2
1	-1955.1001700352447	-7.4693857239496355e9	0	0	0
10	-51.181437422003114	-131467.652885827	0	0	0
20	-1.5770066485475038	-0.29398900499360264	2	0	0
25	-1.510116082353336	-2.97379159244366e- 16	20	16	16

Metoda Bairstowa

Iteracja	x_0	$f(x_0)$	C.z. x_0	C.z. x_1	C.z. x_2
1	-2.1962930904616655	-4.835994078624513	0	0	0
10	-1.486247437 - 1.562610208im	8.54254956 - 2.415611203im	0	0	0
20	$0.5921042807 + 1.019336546 \mathrm{im}$	$-0.4625127 + 1.559847674 \mathrm{im}$	0	1	0
25	$0.2550579892+1.019123845 \mathrm{im}$	0	$\inf +$	\inf +	\inf +

$$e(x_0) = 1.731027414741959e - 7 \qquad e(x_1) = 6.924109678897218e - 8 \qquad e(x_2) = 6.924109678897218e - 8$$

6.7 Test 6

Funkcja, dla której ciężko wybrać właściwe początkowe przybliżenie pierwiastka.

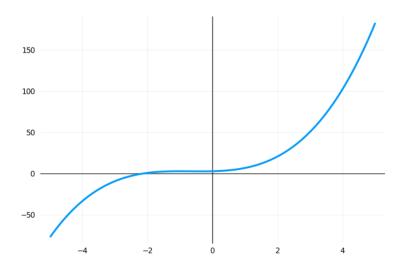


Figure 8: $f(x) = x^3 + 2x^2 + 1x + 3$

Metoda Newtona

Iteracja	x_0	$f(x_0)$	C.z. x_0	C.z. x_1	C.z. x_2
1	87.40256216597504	683055.1593426905	0	0	0
5	16.732615031525334	-131467.652885827	0	0	0
10	1.5437877415713737	12.98962828477444	0	0	0
20	4.263718879956009	121.1337352919147	0	0	0
21	2.5950439877792135	36.53923411927553	0	0	0
22	1.4381143629749316	11.548729387762949	0	0	0
23	0.5468007419391421	4.308271373440125	0	0	0
24	-0.5080684029847669	2.8770491250635657	0	0	0
25	10.648772161362636	1447.973348832624	0	0	0
40	8.55818117413703	784.8653963832828	0	0	0
48	-2.182745085909218	-0.05341140744611266	2	0	0
49	-2.1746057681803856	-0.00030077451451259693	5	0	0
50	-2.174559411791341	-9.721197942146932e-9	10	7	7

Metoda Bairstowa

Iteracja	x_0	$f(x_0)$	C.z. x_0	C.z. x_1	C.z. x_2
1	$0.121495327 + 1.228746647 \mathrm{im}$	$-0.417133300 + 0.02512335599 \mathrm{im}$	0	0	0
2	$0.088623332 + 1.172063711 \mathrm{im}$	$-0.007673587 + 0.005065978 \mathrm{im}$	2	2	2
3	$0.087280433 + 1.171310438 \mathrm{im}$	$-0.4625127+1.559847674 \mathrm{im}$	5	4	5
4	$0.087279705 + 1.171312110 \mathrm{im}$	1.62191396e- $11 + 2.4867478$ e- 12 im	6	6	6
5	$0.087279705 + 1.171312111 \mathrm{im}$	$1.36092529 e ext{e-}15 + 3.8459193 e ext{-}16 ext{im}$	15	13	13
15	$0.087279705 + 1.17131211 \mathrm{im}$	$1.36092529 e ext{e} ext{-}15 + 3.8459193 e ext{-}16 ext{im}$	15	13	13

$$e(x_0) = 1.3766765505351941e - 14 \qquad e(x_1) = 9.90189642062563e - 15 \qquad e(x_2) = 9.90189642062563e - 15$$