

Alcuni metodi iterativi per la ricerca di radici di funzioni

Gionata Massi

Indice

1	Il problema	1
2	Esistenza delle radici	1
2.1	Teorema degli zeri	1
3	Metodi numerici	3
3.1	Metodi diretti e metodi iterativi	3
3.2	Ordine di convergenza	3
3.3	Criteri di arresto	3
4	Metodo di bisezione	3
4.1	Convergenza	4
4.2	Codifica in JavaScript	4
4.3	Esempi	5
5	Iterazioni di punto fisso	5
5.1	Approssimazioni con rette	7
5.2	Metodo delle tangenti	7
5.2.1	Convergenza	7
5.2.2	Codifica in JavaScript	8
5.2.3	Esempi	8
5.2.4	Esempio: algoritmo del reciproco	8
5.2.5	Esempio: metodo di Erone per la radice quadrata	11
6	Estensioni per il calcolo degli estremanti relativi	11
6.1	Metodo di Newton per l'ottimizzazione	12
6.1.1	Interpretazione geometrica	12
6.2	Esempio	13

Elenco delle figure

1	Funzioni che non intersecano l'asse $y = 0$	1
2	Funzioni che intersecano l'asse $y = 0$ in un estremante	1
3	Funzioni che assumono valori opposti agli estremi -1, 1	2
4	Funzioni che assumono valori opposti agli estremi -1, 1 e hanno infiniti zeri	2
5	Successione delle soluzioni del metodo dicotomico applicato a $x^2 - 6$ nell'intervallo $[0, 6]$	5
6	Passi del metodo dicotomico applicato a $x^2 - 6$ nell'intervallo $[0, 6]$	6
7	Approssimazione di una funzione con una retta passante per $(x_k, f(x_k))$	7
8	Approssimazione di una funzione con la retta tangente passante in $(x_k, f(x_k))$	8
9	Successione delle soluzioni del metodo delle tangenti applicato a $x^2 - 6$	9
10	Successione delle soluzioni del metodo delle tangenti applicato a $x^2 - 6$	10

11	Riepilogo sul metodo delle tangenti applicato a $e^{0.9x-x^2}$	10
12	Successione delle soluzioni del metodo di Erone per il calcolo di $\sqrt{6}$ con stima iniziale 3	12

Elenco delle tabelle

2	Metodo dicotomico applicato a $\sin(x)$ nell'intervallo $[3, 3.2]$ con $n_{\max} = 10$	5
3	Metodo dicotomico applicato a $e^{e^{-x}} - x$ nell'intervallo $[0, 1]$ con $n_{\max} = 10$	6

1 Il problema

Data una funzione $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, determinare un valore reale α tale che $f(\alpha) = 0$.

Usualmente consideriamo funzioni continue in \mathbb{R} o almeno in un intervallo $[a, b] \subseteq \mathbb{R}$ chiuso e limitato in cui ricercare una radice.

2 Esistenza delle radici

Non tutte le funzioni ammettono radici, ad esempio $x \mapsto k$ e $x \mapsto (x+k)^2$, dove $k \neq 0$ (es: fig. 1).

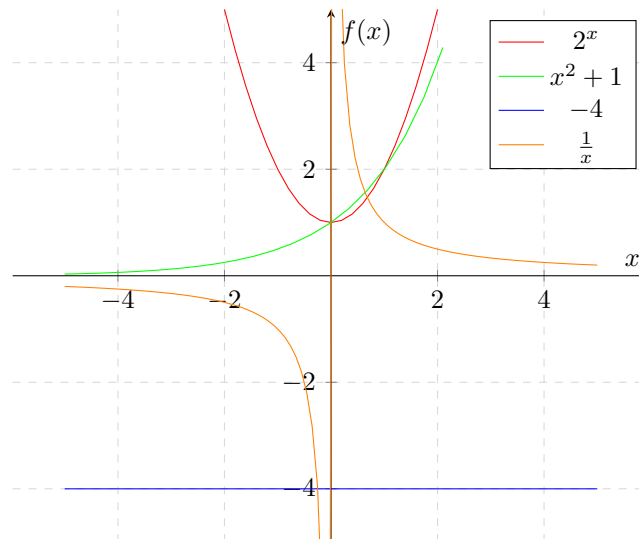


Figura 1: Funzioni che non intersecano l'asse $y = 0$

Altre funzioni hanno radici nei punti di massimo o di minimo locale (es: fig. 2) e questo può rendere difficile identificare già la sola esistenza degli zeri. Se un metodo può essere eseguito, esso sarà poco efficiente nel trovare la soluzione vicino ad un estremante.

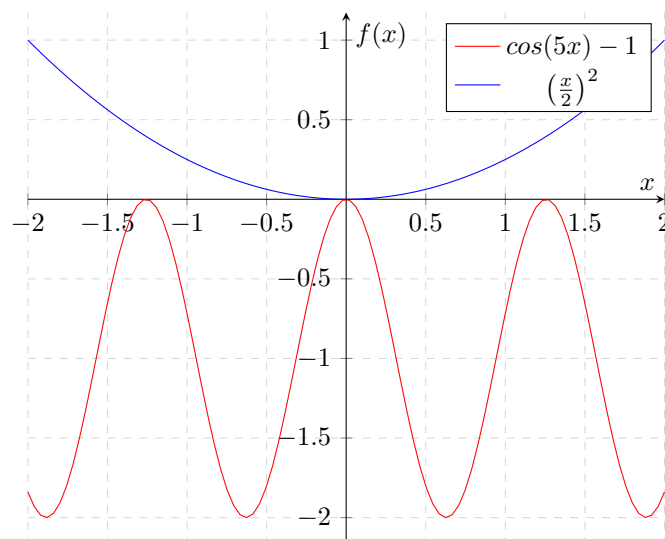


Figura 2: Funzioni che intersecano l'asse $y = 0$ in un estremante

2.1 Teorema degli zeri

Per essere sicuri che una funzione ammetta almeno una radice richiediamo che la funzione assuma valori positivi e negativi in un certo intervallo e che sia continua.

Teorema 2.1 (Bolzano). *Se $f(x)$ è una funzione continua sull'intervallo limitato e chiuso $[a, b]$ e $f(a) \cdot f(b) < 0$, allora esiste almeno una radice di $f(x)$ nell'intervallo (a, b) .*

Se le ipotesi del teorema sono vere può esistere una sola radice oppure ce ne possono essere in numero finito o anche infinite (fig. 3).

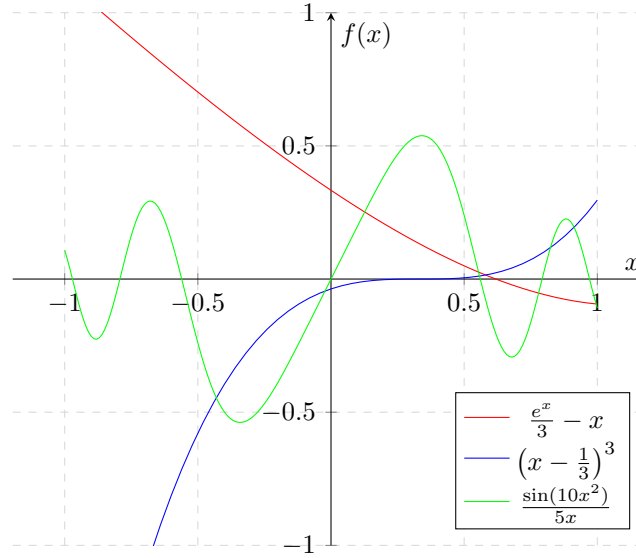


Figura 3: Funzioni che assumono valori opposti agli estremi -1, 1

Un metodo di ricerca delle radici, se convergente, restituirà una sola delle radici. Si intuisce che maggiore è la pendenza della funzione in un intorno della radice, più è facile discriminare la radice. Se invece la pendenza è nulla o quasi, allora il problema si dice mal condizionato.

Esistono funzioni continue in cui è difficile anche solo enumerare gli zeri.

Si consideri nell'intervallo $[-1, 1]$ la seguente funzione:

$$f(x) = \begin{cases} x \sin(\frac{1}{x}) & x \neq 0 \\ 0 & x = 0 \end{cases}$$

Il grafico in fig. 4 è costruito campionando l'intervallo $[-1, 1]$ in 800 punti e valutando in ognuno di questi punti, con la massima precisione possibile in virgola mobile, il valore della funzione. Anche aumentando il numero di punti il grafico ottenuto al calcolare sarà sempre impreciso.

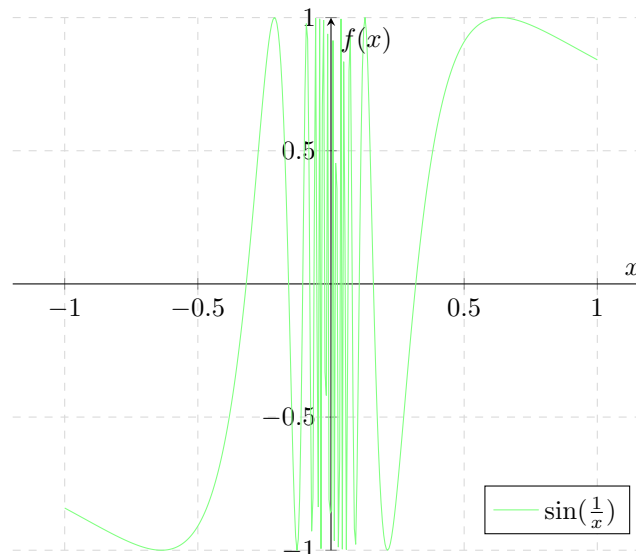


Figura 4: Funzioni che assumono valori opposti agli estremi -1, 1 e hanno infiniti zeri

3 Metodi numerici

3.1 Metodi diretti e metodi iterativi

I **metodi diretti** sono algoritmi che, in assenza di errori di arrotondamento, forniscono la soluzione in un numero finito di operazioni.

I **metodi iterativi** sono algoritmi nei quali la soluzione è ottenuta come limite di una successione di soluzioni. Nella risposta fornita da un metodo iterativo è, quindi, presente usualmente un errore di troncamento.

3.2 Ordine di convergenza

Sia $x_k, k = 0, 1, \dots$ una successione convergente al valore α .

Definizione 3.1 (Errore all'iterazione k -esima). L'errore per elemento della successione in posizione k è il valore non negativo $\varepsilon_k = |x_k - \alpha|$.

Definizione 3.2 (Ordine di convergenza). Se esistono un numero reale $p \geq 1$ e una costante reale positiva C tale che $\lim_{k \rightarrow +\infty} \frac{\varepsilon_{k+1}}{\varepsilon_k^p} = C$ allora la successione $x_k, k = 0, 1, \dots$ ha ordine di convergenza p e costante d'errore C .

Si noti che nella definizione di ordine di convergenza, la costante C è positiva, ossia strettamente maggiore di zero.

3.3 Criteri di arresto

I metodi iterativi sviluppano una successione di valori che deve essere troncata per produrre un risultato. Si possono usare vari criteri per arrestare un metodo numerico in base a vincoli sull'approssimazione della soluzione cercata e sulle risorse di calcolo (essenzialmente il tempo di calcolo) da impiegare. I criteri di arresto comunemente adottati sono i seguenti:

Tolleranza sull'approssimazione della funzione $|f(x_k)| < \tau_y$.

Tolleranza assoluta sull'approssimazione di α $|x_{k+1} - x_k| < \tau_x$.

Tolleranza relativa sull'approssimazione di α $\frac{|x_{k+1} - x_k|}{|x_{k+1}|} < \tau_r$.

Numero di iterazioni $k < k_M$.

4 Metodo di bisezione

Sia $f(x)$ una funzione continua sull'intervallo limitato e chiuso $[a, b]$ con $f(a) \cdot f(b) < 0$.

L'algoritmo genera una successione di intervalli $[a_k, b_k]$ con $f(a_k) \cdot f(b_k) < 0$ e con $[a_k, b_k] \subset [a_{k-1}, b_{k-1}]$ e $|b_k - a_k| = \frac{1}{2}|b_{k-1} - a_{k-1}|$.

Date due tolleranze ϵ_1, ϵ_2 , l'algoritmo si arresta quando:

- $|b_k - a_k| \leq \epsilon_1$, oppure
- $|f(\frac{a_k + b_k}{2})| \leq \epsilon_2$, o infine
- $k > n_{\max}$, ove n_{\max} è un numero massimo di iterazioni fissato.

Per alleggerire la notazione usiamo s_{a_k} per indicare segno($f(a_k)$), s_{b_k} per segno($f(b_k)$) e s_k per segno($f(\frac{a_k+b_k}{2})$), dove

$$\text{segno}(x) = \begin{cases} -1 & \text{se } x < 0, \\ 0 & \text{se } x = 0, \\ +1 & \text{se } x > 0 \end{cases} \quad (1)$$

Per il calcolo di $\frac{a_k+b_k}{2}$ in virgola mobile si deve usare la formula: $a_k + (b_k - a_k)/2$ in modo da ridurre gli errori di troncamento.

4.1 Convergenza

Il metodo è sempre convergente e si può calcolare l'ordine considerando l'errore come l'ampiezza dell'intervallo di incertezza: $\varepsilon_k = \frac{|b-a|}{2^k}$. Il rapporto tra due errori successivi per $p = 1$ vale

$$\frac{\varepsilon_{k+1}}{\varepsilon_k^p} = \frac{\frac{|b-a|}{2^{k+1}}}{\frac{|b-a|}{2^k}} = \frac{1}{2}$$

L'ordine di convergenza è uno con costante d'errore vale un mezzo.

4.2 Codifica in JavaScript

Si veda il listato 1.

```

1  /**
2   *
3   * @param {Function} f una funzione continua in [a, b]
4   * @param {Number} a l'estremo sinistro dell'intervallo di incertezza
5   * @param {Number} b l'estremo destro dell'intervallo di incertezza
6   * @param {Number} e1 tolleranza su asse delle ascisse
7   * @param {Number} e2 tolleranza su asse delle ordinate
8   * @param {Number} nmax numero massimo di iterazioni
9   */
10 const bisezione = (f, a, b, e1 = 1e-16, e2 = 1e-16, nmax = 10) => {
11   let f_a = f(a);
12   let f_b = f(b);
13   let s_a = Math.sign(f_a);
14   let s_b = Math.sign(f_b);
15   if (s_a === s_b) {
16     throw "Segni concordi nei due estremi.";
17   }
18   let x;
19   for (let iter = 0; iter < nmax && b - a >= e1; iter++) {
20     x = a + (b - a) / 2;
21     let f_x = f(x);
22     if (Math.abs(f_x) < e2) {
23       return x;
24     }
25     let s_x = Math.sign(f_x);
26     if (s_a === s_x) {
27       a = x;
28     } else {
29       b = x;
30     }
31   }
32   return x;
33 };

```

Codice sorgente 1: Descrizione in JavaScript del metodo di Bisezione

4.3 Esempi

Si vedano le tabb. 1, 2 e 3 e le figg. 5 e 6.

k	a_k	b_k	x_k	s_{a_k}	s_{b_k}	s_k	$ b_k - a_k $	f_k
0	0	6	3	-1	1	1	6	3
1	0	3	1.5	-1	1	-1	3	-3.75
2	1.5	3	2.25	-1	1	-1	1.5	-0.9375
3	2.25	3	2.625	-1	1	1	0.75	0.890625
4	2.25	2.625	2.4375	-1	1	-1	0.375	-0.05859375
5	2.4375	2.625	2.53125	-1	1	1	0.1875	0.4072265625

Tabella 1: Metodo dicotomico applicato a $x^2 - 6$ nell'intervallo $[0, 6]$ con $n_{\max} = 10$

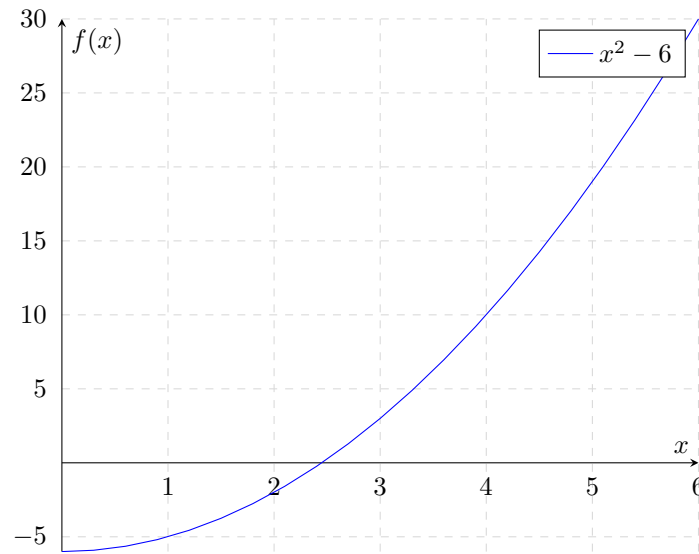


Figura 5: Successione delle soluzioni del metodo dicotomico applicato a $x^2 - 6$ nell'intervallo $[0, 6]$

k	a_k	b_k	x_k	s_{a_k}	s_{b_k}	s_k	$ b_k - a_k $	f_k
0	3	3.2	3.1	1	-1	1	0.2	0.0415806624
1	3.1	3.2	3.15	1	-1	-1	0.1	-0.0084072474
2	3.1	3.15	3.125	1	-1	1	0.05	0.0165918922
3	3.125	3.15	3.1375	1	-1	1	0.025	0.0040926422
4	3.1375	3.15	3.14375	1	-1	-1	0.0125	-0.0021573447
5	3.1375	3.14375	3.140625	1	-1	1	0.00625	0.0009676534
6	3.140625	3.14375	3.1421875	1	-1	-1	0.003125	-0.0005948464
7	3.140625	3.1421875	3.14140625	1	-1	1	0.0015625	0.0001864036
8	3.14140625	3.1421875	3.141796875	1	-1	-1	0.00078125	-0.0002042214
9	3.14140625	3.141796875	3.1416015625	1	-1	-1	0.000390625	$-8.9089102066 \cdot 10^{-6}$

Tabella 2: Metodo dicotomico applicato a $\sin(x)$ nell'intervallo $[3, 3.2]$ con $n_{\max} = 10$

5 Iterazioni di punto fisso

In generale si può costruire un metodo iterativo cercando un punto fisso di una funzione $\Phi(x)$, costruita in moda che si annulli ne punto desiderato, un valore \bar{x} tale che $\Phi(\bar{x}) = \bar{x}$.

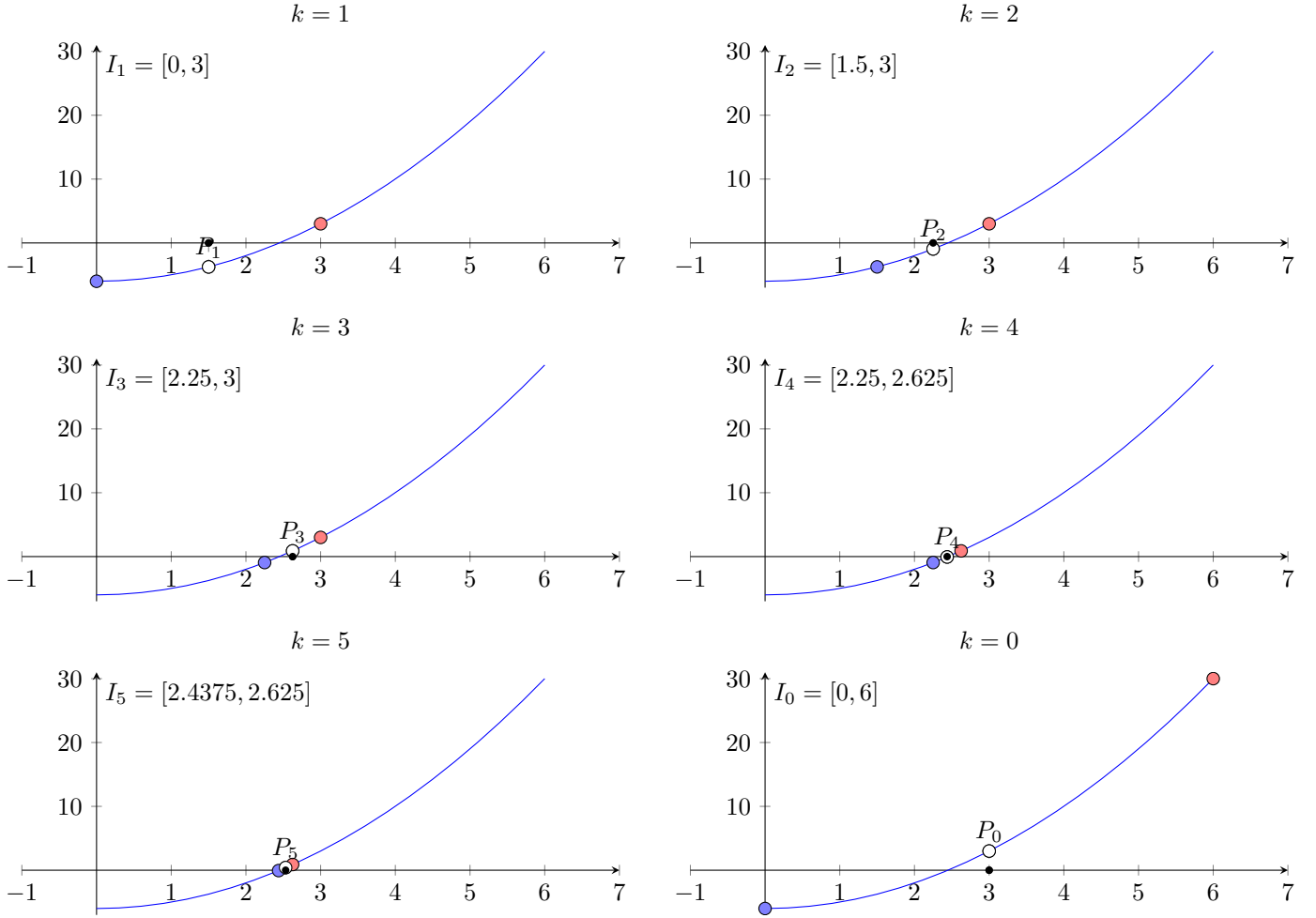


Figura 6: Passi del metodo dicotomico applicato a $x^2 - 6$ nell'intervallo $[0, 6]$

k	a_k	b_k	x_k	s_{a_k}	s_{b_k}	s_k	$ b_k - a_k $	f_k
0	0	1	0.5	1	-1	1	1	0.0452392119
1	0.5	1	0.75	1	-1	-1	0.5	-0.1264750837
2	0.5	0.75	0.625	1	-1	-1	0.25	-0.0394838005
3	0.5	0.625	0.5625	1	-1	1	0.125	0.0031482702
4	0.5625	0.625	0.59375	1	-1	-1	0.0625	-0.0180982778
5	0.5625	0.59375	0.578125	1	-1	-1	0.03125	-0.0074578482
6	0.5625	0.578125	0.5703125	1	-1	-1	0.015625	-0.0021505284
7	0.5625	0.5703125	0.56640625	1	-1	1	0.0078125	0.0004999324
8	0.56640625	0.5703125	0.568359375	1	-1	-1	0.00390625	-0.0008250321
9	0.56640625	0.568359375	0.5673828125	1	-1	-1	0.001953125	-0.0001624834

Tabella 3: Metodo dicotomico applicato a $e^{-x} - x$ nell'intervallo $[0, 1]$ con $n_{\max} = 10$

Il punto fisso è calcolato tramite l'applicazione ripetuta della regola di ricorrenza:

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

5.1 Approssimazioni con rette

Una retta è definita da una funzione del tipo $r(x) = mx + q$. Se imponiamo il passaggio per il punto $(x_k, f(x_k))$ della funzione di cui cerchiamo una radice, il fascio di rette sarà:

$$r(x) - f(x_k) = m(x - x_k)$$

Possiamo generare delle iterazioni andando a fissare il coefficiente angolare ad ogni iterazione e determinando l'intersezione della retta con l'asse delle ascisse.

$$r(x_{k+1}) - f(x_k) = m_k(x_{k+1} - x_k)$$

Risolvendo per

$$r(x_{k+1}) = 0$$

si ha

$$x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{m_k} \quad (2)$$

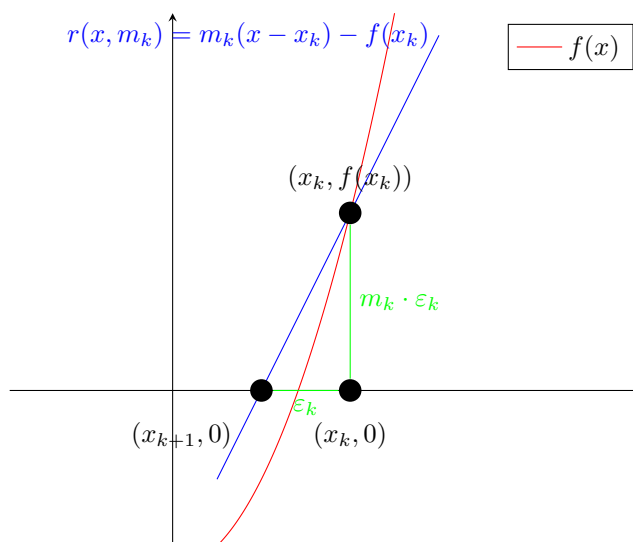


Figura 7: Approssimazione di una funzione con una retta passante per $(x_k, f(x_k))$

5.2 Metodo delle tangenti

Si approssima la funzione $f(x)$ con la retta $r(x) - f(x_k) = f'(x_k)(x - x_k)$ tangente ad essa in $(x_k, f(x_k))$.

L'iterata assume la forma:

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

Si veda la fig. 8

5.2.1 Convergenza

Il metodo non necessariamente converge. Può oscillare o divergere.

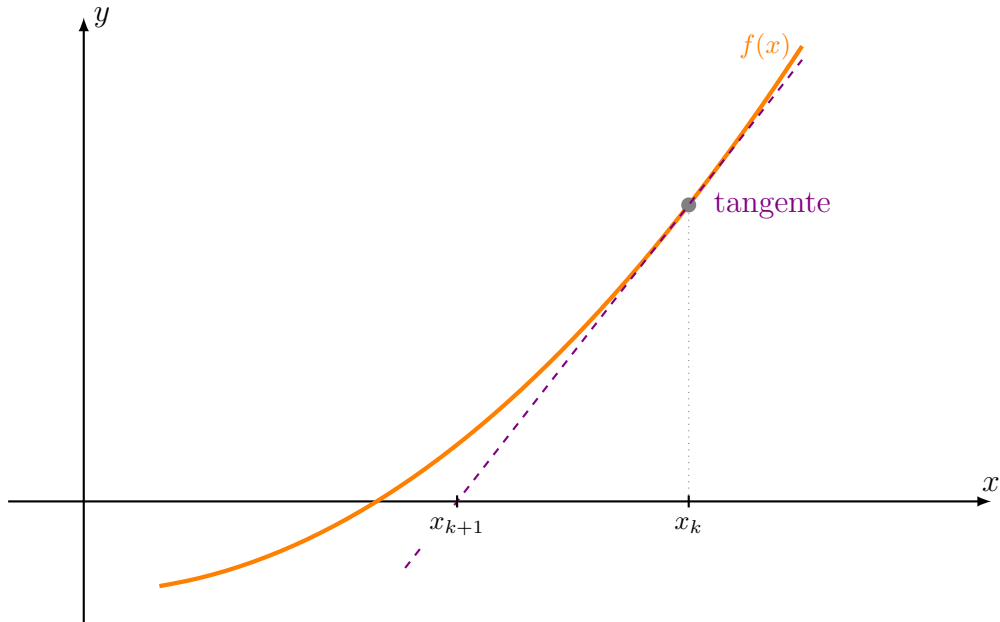


Figura 8: Approssimazione di una funzione con la retta tangente passante in $(x_k, f(x_k))$

5.2.2 Codifica in JavaScript

Si vedano il listato 2.

5.2.3 Esempi

Si vedano le tabb. ??, ?? e ?? e le fig. 9 e 11.

Una esempio che riassume il metodo è in fig. ??.

k	x_k	f_k	f'_k	$ x_{k+1} - x_k $
0	3	3	6	0.5
1	2.5	0.25	5	$5 \cdot 10^{-2}$
2	2.45	$2.5 \cdot 10^{-3}$	4.9	$5.1 \cdot 10^{-4}$
3	2.45	$2.6 \cdot 10^{-7}$	4.9	$5.31 \cdot 10^{-8}$
4	2.45	$3.55 \cdot 10^{-15}$	4.9	$8.88 \cdot 10^{-16}$
5	2.45	$-8.88 \cdot 10^{-16}$	4.9	0

Tabella 4: Metodo delle tangenti applicato a $x^2 - 6$ con stima iniziale 3 e $n_{\max} = 10$

k	x_k	f_k	f'_k	$ x_{k+1} - x_k $
0	3.1	0.0415806624	-0.9991351503	0.0416166546
1	3.1416166546	-0.000024001	-0.9999999997	0.000024001
2	3.1415926536	$4.5633567784 \cdot 10^{-15}$	-1	$4.4408920985 \cdot 10^{-15}$
3	3.1415926536	$1.2246467991 \cdot 10^{-16}$	-1	0

Tabella 5: Metodo delle tangenti applicato a $\sin(x)$ con stima iniziale 3,1 e $n_{\max} = 10$

5.2.4 Esempio: algoritmo del reciproco

Si vuole cercare il reciproco del valore ν come $\alpha = \frac{1}{\nu}$ con il metodo delle tangenti.

```

1  /**
2  *
3  * @param {Function} f una funzione continua e derivabile in un intorno di x
4  * @param {Number} x il valore x_0
5  * @param {Function} f1 la derivata prima di f
6  * @param {Number} e1 tolleranza su asse delle ascisse
7  * @param {Number} e2 tolleranza su asse delle ordinate
8  * @param {Number} nmax numero massimo di iterazioni
9  */
10 const tangenti = (f, x, f1, e1 = 1e-16, e2 = 1e-16, nmax = 10) => {
11   let err = e1 + 1; // permette di entrare nel ciclo
12   for (let iter = 0; iter < nmax && err >= e1; iter++) {
13     let f_x = f(x);
14     if (Math.abs(f_x) < e2) {
15       return x;
16     }
17     let f1_x = f1(x);
18     let xp = x;
19     x = xp - f_x / f1_x;
20     err = Math.abs(x - xp);
21   }
22   return x;
23 };

```

Codice sorgente 2: Descrizione in JavaScript del metodo delle tangenti

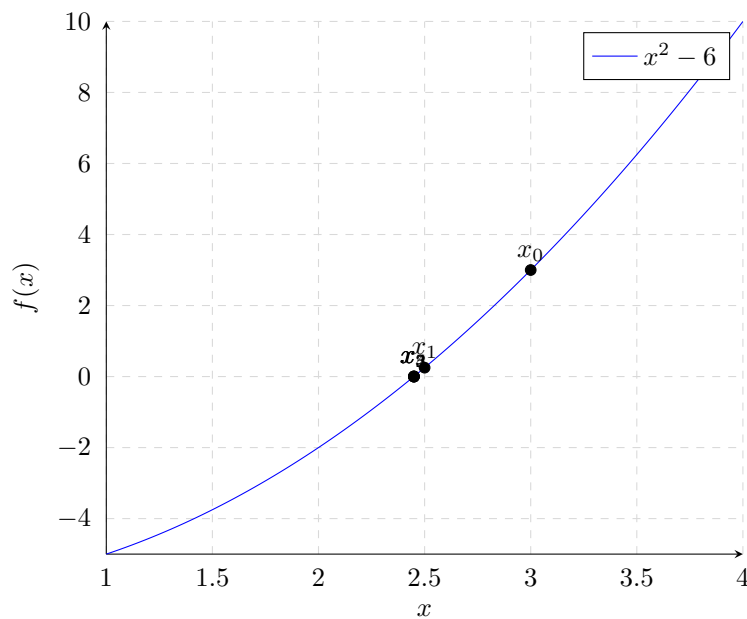


Figura 9: Successione delle soluzioni del metodo delle tangenti applicato a $x^2 - 6$

k	x_k	f_k	f'_k	$ x_{k+1} - x_k $
0	0.5	0.0452392119	-0.6692957011	0.0675922643
1	0.5675922643	-0.0003045748	-0.6784110106	0.0004489532
2	0.5671433111	$-1.4035108742 \cdot 10^{-8}$	-0.678348491	$2.0690115621 \cdot 10^{-8}$
3	0.5671432904	$-1.1102230246 \cdot 10^{-16}$	-0.6783484881	$1.1102230246 \cdot 10^{-16}$
4	0.5671432904	0	-0.6783484881	0

Tabella 6: Metodo delle tangenti applicato a $e^{-x} - x$ con stima iniziale 0,5 e $n_{\max} = 10$

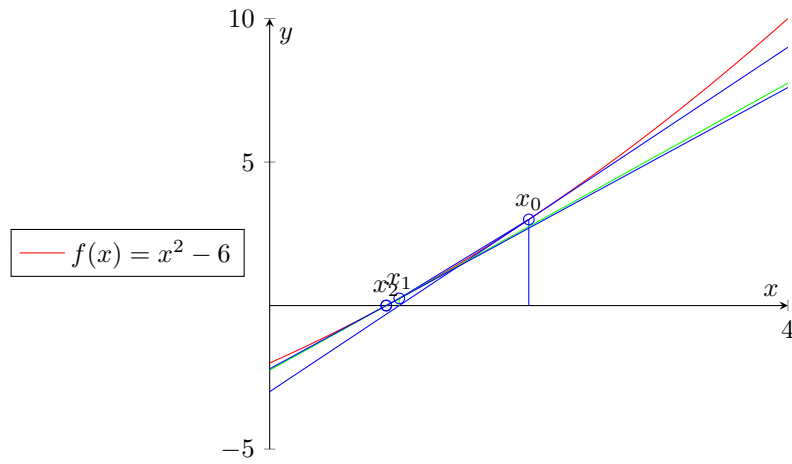


Figura 10: Successione delle soluzioni del metodo delle tangenti applicato a $x^2 - 6$

$$f(x) = e^{0.9x} - x^2$$

$$f'(x) \approx \frac{f(x + \Delta x) - f(x)}{\Delta x}, \quad \Delta x = 0.01$$

$$t_k(x) = f'(x_k) \cdot (x - x_k) + f(x_k)$$

$$x_0 = 2.6, \quad x_{k+1} = x_k - \frac{f(x_k)}{f'(x_k)}$$

n	x_k	$f(x_k)$	$f'(x_k)$	x_{k+1}
0	2.60000	3.62064	4.18396	1.73465
1	1.73465	1.75519	0.82550	-0.39150
2	-0.39150	0.54991	1.41144	-0.78110
3	-0.78110	-0.11490	2.00195	-0.72370
4	-0.72370	-0.00230	1.90735	-0.72249

$$\Rightarrow x \approx -0.72249$$

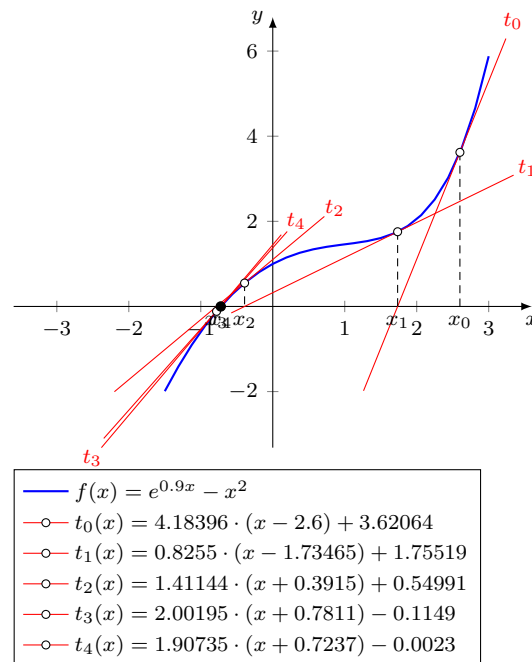


Figura 11: Riepilogo sul metodo delle tangenti applicato a $e^{0.9x} - x^2$

Per prima cosa occorre trasformare il problema con una funzione che si annulla in $\frac{1}{\nu}$. Scegliamo

$$f(x) = \nu - \frac{1}{x}$$

che applicata al reciproco di ν produce $f(\frac{1}{\nu}) = \nu - \frac{1}{\frac{1}{\nu}} = \nu - \nu = 0$.

La derivata prima assume la forma $f'(x) = \frac{1}{x^2}$ e

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

L'iterata del metodo delle tangenti è:

$$x_{k+1} = x_k - (\nu x_k^2 - x_k) = 2x_k - \nu x_k^2 = x_k \cdot (2 - \nu \cdot x_k).$$

Si noti che per calcolare il reciproco di un numero sono sufficienti le operazioni di moltiplicazione e sottrazione. Per la moltiplicazione occorrono le operazioni primitive di scorrimento e addizione e per la sottrazione quelle di negazione bit a bit e di addizione (basterebbe il solo incremento unitario).

Nota: queste proprietà permettono di realizzare le CPU senza l'operazione di divisione.

5.2.5 Esempio: metodo di Erone per la radice quadrata

Si consideri il problema di determinare la radice quadrata di un numero reale r .

Se dal punto di vista algebrico possiamo vedere il problema come determinare uno zero della funzione $f(x) = x^2 - r$, da un punto di vista geometrico possiamo porci il problema di trovare il lato di un quadrato di area r .

L'idea di Erone di Alessandria è quella fornire una stima della radice quadrata, che chiamiamo x_k e che rappresentiamo geometricamente come la base di un rettangolo. Chiamiamo $h_k = \frac{r}{x_k}$ l'altezza del rettangolo di area r e base x_k . Se x_k e h_k fossero molto vicini tra di loro, allora abbiamo trovato una buona stima per \sqrt{r} , altrimenti occorre migliorare la stima. Per fare ciò consideriamo il valor medio tra x_k e h_k .

L'iterata del metodo, ossia la stima migliore, ha equazione:

$$x_{k+1} = \frac{x_k + \frac{r}{x_k}}{2}$$

che può essere riscritta come:

$$x_{k+1} = \frac{x_k + \frac{r}{x_k}}{2} = \frac{x_k^2 + r}{2x_k}$$

Vogliamo dimostrare che la traccia di esecuzione del metodo di Erone di Alessandria è la stessa del metodo di Newton applicato alla funzione $f(x) = x^2 - r$ calcolando l'iterata:

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

Le iterate assumono lo stesso valore, come volevasi dimostrare!

Si vedano

6 Estensioni per il calcolo degli estremanti relativi

L'analisi matematica fornisce delle condizioni che mettono in relazione i punti di massimo e minimo relativo con quelli *stazionari*.

Teorema 6.1 (Teorema di Fermat sui punti stazionari). *Sia $f : (a, b) \rightarrow \mathbb{R}$ una funzione e si supponga che $x_0 \in (a, b)$ sia un punto di estremo locale di f . Se f è derivabile nel punto x_0 , allora $f'(x_0) = 0$.*

k	x_k	r/x_k	$ x_{k+1} - x_k $
0	3	2	0.5
1	2.5	2.4	0.05
2	2.45	2.4489795918	0.0005102041
3	2.4494897959	2.4494896896	$5.3135188693 \cdot 10^{-8}$
4	2.4494897428	2.4494897428	$8.881784197 \cdot 10^{-16}$
5	2.4494897428	2.4494897428	0

Tabella 7: Metodo di Erone di Alessandria per il calcolo di $\sqrt{6}$ con stima iniziale 3 e nmax = 10

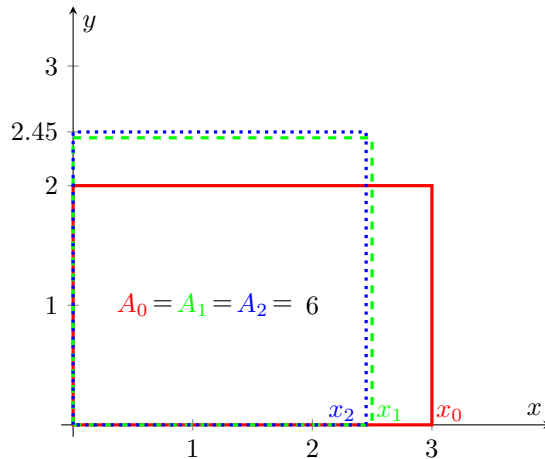


Figura 12: Successione delle soluzioni del metodo di Erone per il calcolo di $\sqrt{6}$ con stima iniziale 3

Trovare un estremante di una funzione, se è derivabile con condizioni che dipendono dal metodo scelto e la derivata è nota in forma simbolica o numerica, si riconduce al problema di determinare una radice della derivata prima.

Tra i metodi più interessanti si trova quello di Newton.

6.1 Metodo di Newton per l'ottimizzazione

Possiamo applicare il metodo di Newton per la ricerca delle radici ad una funzione $g(x) = f'(x)$ per trovare un punto stazionario. Si richiede che f sia continua e derivabile almeno due volte in un intorno di x_0 , stima iniziale del punto estremante.

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

6.1.1 Interpretazione geometrica del metodo di Newton per l'ottimizzazione

Possiamo sviluppare il metodo in modo geometrico, approssimando $f(x_k)$ con una parabola $p(x) = ax^2 + bx + c$ passante per il punto $(x_k, f(x_k))$, con la stessa tangente nel punto x_k e stessa derivata seconda. Trovati i coefficienti a, b e c della parabola, possiamo approssimare il vertice della funzione f con il vertice della parabola, che sappiamo avere proiezione sull'asse delle ascisse $x_{k+1} = \frac{-b}{2a}$.

Per calcolare a e b , gli unici due parametri usati per determinare il vertice, imponiamo le condizioni sulle derivate prime e seconda.

$$\begin{cases} f'(x_k) = 2ax_k + b \\ f''(x_k) = 2a \end{cases}$$

Dal sistema abbiamo esplicitato $2a = f''(x_k)$ e dobbiamo ricavare b dalla prima equazione.

$$b = f'(x_k) - 2ax_k = f'(x_k) - f''(x_k)x_k.$$

L'iterata del metodo geometrico che a partire dal punto x_k approssima l'estremante di f con il vertice di p ha equazione:

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

Per completezza, possiamo determinare tutti i coefficienti di p :

$$\begin{cases} f(x_k) = ax_k^2 + bx_k + c \\ f'(x_k) = 2ax_k + b \\ f''(x_k) = 2a \end{cases}$$

Sostituendo nella prima equazione a e b si ha:

$$c = -\frac{1}{2}f''(x_k) - f'(x_k)x_k + f''(x_k)x_k^2 + f(x_k) = f(x_k) - f'(x_k)x_k + \frac{1}{2}f''(x_k)x_k^2$$

Questa è l'interpretazione geometrica del metodo di Newton applicato alla derivata prima.

6.2 Esempio

Consideriamo la funzione $f(x) = \frac{1}{3}x^3 + 2x^2 + x + 6$, di cui è agevole calcolare le derivate prima, $f'(x) = x^2 + 4x + 1$, e seconda, $f''(x) = 2x + 4$.

Analiticamente è facile trovare gli estremanti in $x_M = -2 \pm \sqrt{3}$.

Numericamente potremmo valutare la funzione in più punti e magari potremmo osservare che gli estremanti si trovano nell'intervallo $[-5, 2]$ e consideriamo una volta il punto -3 e l'altra -1 come stime iniziali.

Possiamo riscrivere l'iterata come:

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

I parametri della parabola sono:

$$\begin{cases} f(x_k) = ax_k^2 + bx_k + c \\ f'(x_k) = 2ax_k + b \\ f''(x_k) = 2a \\ \begin{cases} c = \frac{1}{3}x_k^3 + 6 \\ b = 1 - x_k^2 \\ a = x_k + 2 \end{cases} \end{cases}$$

k	x_k	f_k	f'_k	f''_k	$ x_{k+1} - x_k $
0	-3	12	-2	-2	1
1	-4	12.6666666667	1	-4	0.25
2	-3.75	12.796875	0.0625	-3.5	0.0178571429
3	-3.7321428571	12.7974349338	0.0003188776	-3.4642857143	0.0000920471
4	-3.73205081	12.7974349485	$8.472675006 \cdot 10^{-9}$	-3.46410162	$2.4458506331 \cdot 10^{-9}$
5	-3.7320508076	12.7974349485	0	-3.4641016151	0

Tabella 8: Metodo delle parabole con $n_{\max} = 5$. $x_0 = -3$

k	x_k	f_k	f'_k	f''_k	$ x_{k+1} - x_k $
0	-1	6.6666666667	-2	2	1
1	0	6	1	4	0.25
2	-0.25	5.8697916667	0.0625	3.5	0.0178571429
3	-0.2678571429	5.8692317329	0.0003188776	3.4642857143	0.0000920471
4	-0.26794919	5.8692317182	$8.4726737848 \cdot 10^{-9}$	3.46410162	$2.4458502446 \cdot 10^{-9}$
5	-0.2679491924	5.8692317182	0	3.4641016151	0

Tabella 9: Metodo delle parabole con $n_{\max} = 5$. $x_0 = -1$