Одномерная минимизация функции

Владимир Руцкий, 3057/2

24 марта 2009 г.

1 Постановка задачи

Требуется найти с наперёд заданной точностью минимум одномерной функции $f(x)$ на заданном отрезке $[a, b]$:

$$\min f(x), \quad x \in [a, b],$$

используя *метод золотого сечения.*

Дана конкретная функция $\sin \frac{1}{x}$, и задан отрезок $[0.15, 0.6]$.

2 Исследование применимости метода

Алгоритмы поиска минимума одномерной функции $f(x)$ на отрезке $[a, b]$, использующие только значения функции в некоторых точках (исследуемый метод золотого сечения в их числе), применимы, только если заданная функция является *унимодальной*, а именно

$$\exists!\, x^* \in [a, b] : \quad \begin{cases} \forall x_1, x_2 \in [a, b] : & x^* \leqslant x_1 \leqslant x_2 \quad \Rightarrow f(x^*) \leqslant f(x_1) \leqslant f(x_2) \\ \forall x_1, x_2 \in [a, b] : & x^* \geqslant x_1 \geqslant x_2 \quad \Rightarrow f(x^*) \geqslant f(x_1) \geqslant f(x_2) \end{cases}.$$

3 Описание алгоритма

Общая идея поиска минимума унимодальной функции на отрезке заключается в том, что отрезок с минимумом можно разбить на части и гарантировано определить в какой части находится минимум, тем самым позволив сузить область для поиска минимума.

В случае метода золотого сечения отрезок, на котором имеется минимум, $[a, b]$ делится в отношении *золотой пропорции. Золотая пропорция* — это деление непрерывной величины на части в таком отношении, что большая часть относится к меньшей, как большая ко всей величине.

$x \in [a, b]$ делит $[a, b]$ золотым сечением, если

$$\begin{cases} x - a > b - x & \frac{x-a}{b-x} = \frac{b-a}{x-a} = \varphi \\ x - a < b - x & \frac{b-x}{x-a} = \frac{b-a}{b-x} = \varphi \end{cases},$$

т.е. для любого непустого отрезка найдуться две точки, делящие его в отношении золотой пропорции.

Величина отношения φ определена единственным образом, и равна $\frac{\sqrt{5}+1}{2}$.

Поиск минимума унимодальной функции методом золотого сечения можно описать алгоритмом 1:

Алгоритм 1 FindMinimumByGoldenSectionSearch. Поиск минимума унимодальной функции.

Вход: Исследуемая функция f; отрезок $[a, b]$, содержащий минимум; точность ε, с которой требуется найти минимум.

Выход: Точка x^* — аргумент функции в которой достигается минимум с точностью ε.

{ Инициализируем первоначальное деление отрезка $[a, b]$ на три отрезка золотым сечением. }
$\alpha := \frac{1}{\varphi}$ { с данной величиной далее будет удобно работать }
$i := 0$ { счетчик итераций }
{ $[a_i, b_i]$ — отрезок содержащий минимум на i-м шаге. }
$a_i := a$
$b_i := b$
{ $\lambda_i < \mu_i$ — точки делящие отрезок на i-м шаге золотым сечением. }
$\lambda_i := a_i + (1 - \alpha)(b_i - a_i)$
$\mu_i := a_i + \alpha(b_i - a_i)$
{ Подразбиваем отрезок пока его длина не станет меньше необходимой точности. }
while $|a_i - b_i| \geqslant \varepsilon$ **do**
  if $f(\lambda_i) \leqslant f(\mu_i)$ **then**
    { Минимум лежит на $[a_i, \mu_i]$, подразбиваем этот отрезок и продолжаем работу алгоритма. }
    $a_{i+1} := a_i$
    $b_{i+1} := \mu_i$
    { Из-за особенностей золотого сечения необходимо перевычислять лишь одну новую точку. }
    $\mu_{i+1} := \lambda_i$
    $\lambda_{i+1} := a_{i+1} + (1 - \alpha)(b_{i+1} - a_{i+1})$
  else
    { Минимум лежит на $[\lambda_i, b_i]$. }
    $a_{i+1} := \lambda_i$
    $b_{i+1} := b_i$
    $\lambda_{i+1} := \mu_i$
    $\mu_{i+1} := a_{i+1} + \alpha(b_{i+1} - a_{i+1})$
  end if
  $i := i + 1$
end while
{ Все точки на результирующем отрезке равны точке минимума с точностью ε, выбираем точку с меньшим значением функции из λ_i и μ_i. }
if $f(\lambda_i) \leqslant f(\mu_i)$ **then**
  return λ_i
else
  return μ_i
end if

Приведённый алгоритм 1 может быть легко оптимизирован, если сохранять вычисленные значения функции f в точках α_i и μ_i, таким образом функция может быть вычислена значительно меньшее число раз. Для простоты эта оптимизация не приводится в алгоритме.

4 Код программы

5 Результаты решения

6 Возможные дополнительные исследования

7 Обоснование достоверности полученного результата