

Equazioni e sistemi non lineari

Lucia Gastaldi

DICATAM - Sezione di Matematica,
<http://lucia-gastaldi.unibs.it>



UNIVERSITÀ
DEGLI STUDI
DI BRESCIA

- 1 Ricerca degli zeri di una funzione
 - Problema e definizioni
 - Bisezione
 - Metodo di Newton-Raphson
 - Test d'arresto
 - Algoritmo ed esercizi
 - Metodo delle secanti
 - Function di Matlab
- 2 Soluzione di sistemi non lineari
 - Il metodo di Newton-Raphson per sistemi
 - Problemi di minimo
- 3 Appendice

Zeri di funzione

Problema

Data $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ si cerca $x \in [a, b]$ tale che $f(x) = 0$.

Indichiamo con α uno zero di f .

Teorema

Supponiamo che la funzione $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ sia **continua in** $[a, b]$ e che $f(a) \cdot f(b) < 0$; allora esiste $\alpha \in (a, b)$ tale che $f(\alpha) = 0$.

Metodo di bisezione

Data una funzione $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ continua, con $f(a) \cdot f(b) < 0$, il **metodo di bisezione** individua un intervallo di data ampiezza nel quale è contenuto lo zero α della funzione.

Algoritmo di bisezione

Fintanto che l'ampiezza dell'intervallo è superiore alla tolleranza desiderata si eseguono i seguenti passi:

1. si calcola il punto medio $c = (a + b)/2$ dell'intervallo corrente;
2. si valuta $f(c)$;
3. se $f(c) = 0$, allora c è lo zero cercato; **stop**;
4. altrimenti se $f(a) \cdot f(c) < 0$ allora $b = c$; si torna all'inizio del ciclo;
5. altrimenti $a = c$; si torna all'inizio del ciclo.

Stima dell'errore

Nell'intervallo corrente l'errore $|\alpha - c| \leq (b - a)/2$.

Dopo k iterazioni l'ampiezza dell'intervallo corrente è data dall'ampiezza dell'intervallo di partenza diviso 2^k .

Function **bisezione**

Scrivere un **M-file** di tipo function per trovare uno zero di una funzione con il metodo delle bisezioni. La riga di definizione è la seguente:

```
function [zero,fval,iter]=bisezione(f,a,b,tol)
```

Input

f nome della funzione;
a,b estremi dell'intervallo;
tol tolleranza desiderata.

Output

zero lo zero della funzione trovato;
fval valore di f nello zero calcolato;
iter iterazioni eseguite.

Esercizio 1

Usare la function `bisezione` per trovare uno zero delle seguenti funzioni con tolleranza `tol=eps`. Rappresentare la funzione e marcare sul grafico lo zero trovato.

$$f(x) = x^2 - 2, \quad x \in [0, 2]$$

$$f(x) = 3x - 1, \quad x \in [0, 1]$$

$$f(x) = \arctan(x), \quad x \in [-1, 1]$$

$$f(x) = \sin(x) - \cos(2x), \quad x \in [-\pi, \pi]$$

$$f(x) = \sin(x) - \cos(2x), \quad x \in [0, 10004]$$

Risultati

1. zero=1.4142, fval= 8.8818e-16, iter=52
2. zero=0.3333, fval=4.4409e-16, iter=51
3. zero=0, fval=0, iter=1
4. La funzione assume negli estremi lo stesso valore. Se si cambia l'intervallo di partenza in $[-2, 2]$ si trova zero=0.5236, fval=-4.9960e-16, iter=53
5. zero=4.6438e+03, fval=-2.0687e-12, iter=65

Metodo di bisezione con test sull'errore relativo

Modificare la function bisezione in modo di considerare il seguente test d'arresto

$$\frac{b - a}{\max(|a|, |b|)} < \text{tol}$$

Ripetere le prove dell'esercizio precedente.

Risultati

1. zero=1.4142, fval=4.4409e-16, iter=53
2. zero=0.3333, fval=0, iter=53
3. zero=0, fval=0, iter=1
4. La funzione assume negli estremi lo stesso valore. Se si cambia l'intervallo di partenza in $[-2, 2]$ si trova zero=0.5236, fval=-1.6653e-16, iter=55
5. zero=4.6438e+03, fval=2.9432e-13, iter=53

Ordine di convergenza di un metodo iterativo

Definizione

Si dice che un **metodo iterativo** è **convergente di ordine** $p > 1$ se vale

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{|\alpha - x_{k+1}|}{|\alpha - x_k|^p} = C \neq 0.$$

Si dice che un **metodo iterativo** **converge linearmente** se esiste un numero positivo $0 < C < 1$ tale che

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{|\alpha - x_{k+1}|}{|\alpha - x_k|} = C.$$

Si dice che un **metodo iterativo** **converge superlinearmente** se vale

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{|\alpha - x_{k+1}|}{|\alpha - x_k|} = 0.$$

Metodo di Newton-Raphson

Supponiamo di avere calcolato il valore x_k .

La migliore approssimazione lineare della funzione f nel punto x_k è data dalla retta tangente

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

Ponendo $t_k(x) = 0$, si ricava il nuovo punto della successione x_{k+1} .

Iterata di Newton-Raphson

Dato x_0 ,

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

Teorema di convergenza locale quadratica

Teorema

Sia $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ una funzione di classe \mathbf{C}^2 . Sia α tale che

$$f(\alpha) = 0, \quad f'(\alpha) \neq 0.$$

Allora esiste $\eta > 0$ tale che se il punto iniziale x_0 soddisfa

$$|\alpha - x_0| \leq \eta$$

allora si ha:

1. Per ogni $k \in \mathbb{N}$, $|\alpha - x_k| \leq \eta$;
2. $\lim_{k \rightarrow \infty} x_k = \alpha$;
3. $\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{x_{k+1} - \alpha}{(x_k - \alpha)^2} = \frac{f''(\alpha)}{2f'(\alpha)}$.

Test d'arresto

Si deve trovare un modo per imporre che l'errore sia inferiore ad una tolleranza prestabilita, ossia tale che

$$\frac{|\alpha - x_k|}{|\alpha|} \leq \text{toll}, \quad \text{oppure } |\alpha - x_k| \leq \text{toll se } \alpha = 0.$$

Due possibilità:

$$|f(x_k)| \leq \text{toll}$$

non efficiente se $|f'(\alpha)| \approx 0$ oppure $|f'(\alpha)| \gg 1$.

$$|x_{k+1} - x_k| \leq \text{toll}$$

efficiente se il metodo converge **superlinearmente**.

Algoritmo di Newton-Raphson

1. Dati f , f' , x_0 , $toll$ e $nmax$;
2. valuta $y = f(x_0)$ e la derivata $dy = f'(x_0)$;
3. inizializza $\delta = 1$ e $iter = 0$;
4. Se $|\delta| \leq toll$ il test d'arresto è verificato, x_0 è la soluzione cercata; **stop**.
5. Se $iter > nmax$, è stato raggiunto il numero massimo di iterazioni senza arrivare a convergenza; **stop**.
6. Altrimenti:
 - calcola $\delta = -y/dy$;
 - aggiorna $x_0 = x_0 + \delta$.
 - valuta $y = f(x_0)$ e la derivata $dy = f'(x_0)$;
 - incrementa l'indice di iterazione $iter = iter + 1$.
7. Ripeti da 4.

Function `newton`

Scrivere un programma di tipo function per implementare il metodo di Newton, con la seguente riga di definizione:

```
function [zero,fz,iter]=newton(f,df,x0,toll,Nmax)
```

Input

<code>f</code>	function che contiene l'espressione della funzione f ;
<code>df</code>	function che contiene l'espressione della derivata f' ;
<code>x0</code>	punto iniziale per l'iterazione;
<code>toll</code>	tolleranza desiderata;
<code>Nmax</code>	numero massimo di iterazioni da eseguire;

Output

<code>zero</code>	soluzione cercata;
<code>fz</code>	valore di f nello zero calcolato;
<code>iter</code>	numero di iterazioni utilizzate.

Esercizi

Esercizio 2

Testare la function `newton` per determinare gli zeri delle funzioni dell'Esercizio 1.

Esercizio 3

La funzione

$$f(x) = e^x - 2x^2$$

ha tre zeri, $\alpha_1 < 0$, α_2 e α_3 positivi.

- ▶ Fare il grafico della funzione.
- ▶ Per $i = 1, 2, 3$ trovare un valore di x_0 in modo che il metodo di Newton implementato converga a α_i .
- ▶ Marcare gli zeri trovati sul grafico della funzione.

Esercizio 4

Si consideri la funzione

$$f(x) = x - \frac{3\sin(3x)}{x} \quad x \in [0, 6].$$

La funzione e la sua derivata sono implementate nelle function `sin3` e `dsin3` rispettivamente.

Usare la function `newton` per calcolare lo zero di f e rappresentare il procedimento iterativo con le seguenti scelte del dato iniziale $x_0 = 0.1$, $x_0 = 2$, $x_0 = 2.1$, $x_0 = 2.2$, $x_0 = 2.4$, $x_0 = 2.5$ e $x_0 = 3$.

Convergenza del metodo di Newton

Modificare la function `newton` che implementa l'algoritmo di Newton-Raphson con la seguente riga di dichiarazione:

```
[zero,fz,iter,xk]=newton(f,df,x0,tol,Niter)
```

Input

<code>f</code>	function che contiene l'espressione della funzione f ;
<code>df</code>	function che contiene l'espressione della derivata f' ;
<code>x0</code>	punto iniziale per l'iterazione;
<code>tol</code>	tolleranza desiderata;
<code>Niter</code>	numero massimo di iterazioni da eseguire.

Output

<code>zero</code>	soluzione cercata;
<code>fz</code>	valore di f nello zero calcolato;
<code>iter</code>	numero di iterazioni utilizzate;
<code>xk</code>	vettore delle approssimazioni successive (opzionale).

Verifica dell'ordine di convergenza

Se il metodo di Newton converge quadraticamente si verifica che

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{|x_{k+1} - x_k|}{|x_k - x_{k-1}|^2} = \frac{|f''(\alpha)|}{|2f'(\alpha)|}.$$

Quindi per verificare l'andamento dell'errore si può riportare in un grafico in scala semilogartimica ([semilogy](#)) la differenza fra due iterate successive. Se l'ordine di convergenza è quadratico si potrà vedere che l'errore decresce rapidamente.

Si può verificare questo comportamento anche dai valori della frazione nel limite scritto sopra.

Test

Esercizio 5

Usare la function `newton` per calcolare gli zeri delle seguenti funzioni, con x_0 assegnato:

$$\begin{array}{ll} f(x) = \sin x - \cos 2x & x_0 = 1 \\ f(x) = x^3 - 7x^2 + 11x - 5 & x_0 = 2 \text{ e } x_0 = 7 \\ f(x) = x^4 - 12x^3 + 47x^2 - 60x + 24 & x_0 = 0 \text{ e } x_0 = 2 \end{array}$$

Fare un grafico di ciascuna funzione. Riportare in scala semilogaritmica la differenza fra due successive iterate e dedurre se la convergenza è quadratica o lineare.

Esercizio 6

Si consideri l'equazione $2x^4 - 11x^3 + 21x^2 - 16x + 4 = 0$.

1. Plottare la funzione nell'intervallo $[0, 3]$.
2. Trovare gli zeri mediante il metodo di Newton usando i seguenti valori iniziali: $x_0 = 0.75, 1.25, 1.75, 2.25, 2.75$.
3. Per ciascuna radice trovata dire l'ordine di convergenza.

Soluzione Esercizio 5

$tol=1e-10$, $nmax=20$

$$f(x) = \sin x - \cos 2x \quad x_0 = 1$$

Il metodo converge in 5 iterazioni $zero = 5.235988e-01$ $fval = -1.665335e-16$ Convergenza quadratica

$$f(x) = x^3 - 7x^2 + 11x - 5$$

Se $x_0 = 2$ il metodo non converge nel massimo numero di iterazioni
Residuo finale = $-1.869616e-12$ Convergenza lineare

Se $x_0 = 7$ il metodo converge in 7 iterazioni $zero = 5.000000e+00$ $fval = -7.105427e-15$ Convergenza quadratica

$$f(x) = x^4 - 12x^3 + 47x^2 - 60x + 24$$

Se $x_0 = 0$ il metodo converge in 9 iterazioni $zero = 8.883058e-01$ $fval = 0.000000e+00$ Convergenza quadratica

Se $x_0 = 2$ il metodo converge in 8 iterazioni $zero = 1.000000e+00$ $fval = 0.000000e+00$ Convergenza quadratica

Soluzione Esercizio 6

$f(x) = 2x^4 - 11x^3 + 21x^2 - 16x + 4$ $\text{tol}=1\text{e-}10$, $\text{nmax}=20$

Se $x_0 = 0.75$ il metodo converge in 10 iterazioni $\text{zero} =$

$5.000000\text{e-}01$ $\text{fval} = 0.000000\text{e+}00$ Convergenza quadratica

Se $x_0 = 1.25$ Il metodo converge in 5 iterazioni $\text{zero} =$

$1.000000\text{e+}00$ $\text{fval} = 0.000000\text{e+}00$ Convergenza cubica

Se $x_0 = 1.75$, $x_0 = 2.25$, $x_0 = 2.75$ il metodo non converge nel massimo numero di iterazioni con residui finali = $4.973799\text{e-}14$, $3.339551\text{e-}13$, $8.292034\text{e-}12$ Convergenza lineare

Esempi

Un esempio perverso

Usare la function `newton` per calcolare lo zero della seguente funzione:

$$f(x) = \text{sign}(x)\sqrt{|x|}, \quad x \in \mathbb{R}.$$

Osservare che per qualunque scelta del dato iniziale x_0 la successione è oscillante.

`arctan(x)`

Applicare il metodo di Newton alla ricerca dello zero della funzione $f(x) = \arctan(x)$ con $x_0 = 0.3, 2$.

Usare il metodo di Newton per trovare il valore critico di x_0 per cui $x_1 = -x_0$. Chiamare x_c tale valore.

Verificare, usando la function `newton`, che il metodo di Newton applicato alla funzione $f(x) = \arctan(x)$:

- ▶ converge per $x_0 \leq x_c$;
- ▶ diverge per $x_0 \geq x_c$;
- ▶ è oscillante per $x_0 = x_c$.

Metodo delle secanti

Supponiamo di avere calcolato il valore x_k .

Nel caso in cui non si disponga della derivata di f oppure il costo del calcolo sia eccessivo si può considerare la secante che passa per $(x_k, f(x_k))$ e $(x_{k-1}, f(x_{k-1}))$:

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

Ponendo $s_k(x) = 0$, si ricava il nuovo punto della successione x_{k+1} .

Iterata delle secanti

Dati x_0 e x_1

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

Teorema di convergenza locale superlineare

Teorema

Sia $f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ una funzione di classe \mathbf{C}^2 . Sia α tale che

$$f(\alpha) = 0, \quad f'(\alpha) \neq 0.$$

Allora esiste $\eta > 0$ tale che se il punto iniziale x_0 soddisfa $|\alpha - x_0| \leq \eta$ allora si ha:

1. Per ogni $k \in \mathbb{N}$, $|\alpha - x_k| \leq \eta$;
2. $\lim_{k \rightarrow \infty} x_k = \alpha$;
3. $\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{\alpha - x_{k+1}}{(\alpha - x_k)(\alpha - x_{k-1})} = -\frac{f''(\alpha)}{2f'(\alpha)}$
4. $\lim_{k \rightarrow \infty} \frac{|\alpha - x_{k+1}|}{|\alpha - x_k|^p} = M^{-(1+1/p)}$

con $p = (1 + \sqrt{5})/2$ e $M = |f''(\alpha)|/(2|f'(\alpha)|)$.

Algoritmo delle secanti

1. Dato x_0 e x_1 ;
2. valuta $f_0 = f(x_0)$ e $f_1 = f(x_1)$.
3. Se il test d'arresto è verificato, x_1 è la soluzione cercata; **stop**.
4. Altrimenti:
 - calcola $dy = (f_1 - f_0)/(x_1 - x_0)$;
 - calcola $\delta = -f_1/dy$;
 - aggiorna $x_0 = x_1$, $x_1 = x_1 + \delta$;
 - aggiorna $f_0 = f_1$;
 - valuta $f_1 = f(x_1)$.
5. Ripeti da 3.

Function `secanti`

La **function** `secanti.m` implementa l'algoritmo delle secanti con la seguente riga di dichiarazione:

```
[zero,fz,iter]=secanti (f,x0,x1,tol,Nit)
```

Input

<code>f</code>	function che contiene l'espressione della funzione f ;
<code>x0,x1</code>	dati iniziali per l'iterazione;
<code>tol</code>	tolleranza desiderata;
<code>Nit</code>	numero massimo di iterazioni da eseguire;

Output

<code>zero</code>	soluzione cercata;
<code>fz</code>	valore di f nello zero calcolato;
<code>iter</code>	numero di iterazioni utilizzate;

Esercizio 7

Usare la function `secanti` per risolvere gli esercizi 5 e 6, scegliendo lo stesso valore di x_0 e $x_1 = x_0 + 0.5$. In caso di non convergenza, modificare opportunamente il valore di x_1 .

Soluzione Esercizio 7 - Funzioni Es. 5

$$\text{tol}=1\text{e-}10, \text{ nmax}=20 \quad p = (1 + \sqrt{5})/2$$

$$f(x) = \sin x - \cos 2x \quad x_0 = 1 \text{ e } x_1 = 1.5$$

Il metodo converge in 8 iterazioni $\text{zero} = 5.235988\text{e-}01$ $\text{fval} = 1.110223\text{e-}16$ Convergenza di ordine p

$$f(x) = x^3 - 7x^2 + 11x - 5$$

Se $x_0 = 2$ e $x_1 = 2.5$ il metodo non converge nel massimo numero di iterazioni Residuo finale = $-2.068380\text{e-}08$ Convergenza lineare

Se $x_0 = 7$ e $x_1 = 7.5$ il metodo converge in 10 iterazioni $\text{zero} = 5.000000\text{e+}00$ $\text{fval} = -2.131628\text{e-}14$

Convergenza di ordine p

$$f(x) = x^4 - 12x^3 + 47x^2 - 60x + 24$$

Se $x_0 = 0$ e $x_1 = 0.5$ il metodo converge in 12 iterazioni $\text{zero} = 8.883058\text{e-}01$ $\text{fval} = 7.105427\text{e-}15$

Convergenza di ordine p

Se $x_0 = 2$ e $x_1 = 2.5$ dopo 11 iterazioni si trova la soluzione esatta $\text{zero} = 1.000000\text{e+}00$ $\text{fval} = 0.000000\text{e+}00$

Soluzione Esercizio 7 - Funzioni Es .6

$f(x) = 2x^4 - 11x^3 + 21x^2 - 16x + 4$ $\text{tol}=1\text{e-}10$, $\text{nmax}=20$

Se $x_0 = 0.75$ e $x_1 = x_0 + 0.5$ dopo 6 iterazioni si trova la soluzione esatta $\text{zero} = 1.000000\text{e}+00$ $\text{fval} = 0.000000\text{e}+00$

Per individuare la radice $\alpha = 0.5$ scelgo $x_0 = 0.4$ e $x_1 = 0.6$

Il metodo converge in 9 iterazioni $\text{zero} = 5.000000\text{e-}00$ $\text{fval} = 8.881784\text{e-}16$

Se $x_0 = 1.25$ Il metodo converge in 5 iterazioni $\text{zero} = 1.000000\text{e}+00$ $\text{fval} = 0.000000\text{e}+00$

Se $x_0 = 1.75$, il metodo non converge nel massimo numero di iterazioni Residuo finale = $2.599424\text{e-}01$

Se $x_0 = 2.25$ e $x_1 = x_0 + 0.5$ dopo 34 iterazioni si trova la soluzione esatta $\text{zero} = 2.000000\text{e}+00$ $\text{fval} = 0.000000\text{e}+00$

Se $x_0 = 2.75$ e $x_1 = x_0 + 0.5$ dopo 42 iterazioni si trova la soluzione esatta $\text{zero} = 2.000000\text{e}+00$ $\text{fval} = 0.000000\text{e}+00$

fzero

Calcola gli zeri di una funzione reale di variabile reale con la seguente sintassi

```
[x,fval]=fzero(fun,x0)
```

`[x,fval]=fzero(@fun,x0)` se `fun` è una function

Input

<code>fun</code>	function che contiene la funzione f
<code>x0</code>	dato iniziale

Output

<code>x</code>	approssimazione dello zero calcolato
<code>fval</code>	valore di f in x .

Si possono ottenere delle informazioni complete sulle iterazioni usando il comando

```
[x,fval]=fzero(@fun,x0,optimset('disp','iter'))
```

fzero

Algoritmo di Dekker-Brent

- ▶ Cerca un intervallo $[a, b]$ in modo che $f(a)f(b) < 0$.
- ▶ Usa un passo delle secanti per trovare c .
- ▶ Ripete i passi seguenti finché $|b - a| < \varepsilon|b|$ o $f(b) = 0$.
 - ▶ Ordina a , b e c in modo tale che:

$$f(a)f(b) < 0, \quad |f(b)| < |f(a)|,$$

c è il valore precedente di b .

- ▶ Se $c \neq a$, usa un passo IQI (Inverse Quadratic Interpolation).
- ▶ Se $c = a$, usa il passo delle secanti.
- ▶ Se IQI o le secanti forniscono un valore interno a $[a, b]$, lo accetta.
- ▶ Altrimenti, usa il metodo delle bisezioni.

Utilizzo di `fzero`

`[x,fval]=fzero(fun,x0)` fornisce il valore della funzione `fun` nello zero `x`.

`[x,fval,exitflag]=fzero(fun,x0)` fornisce un valore `exitflag` che indica l'esito di `fzero`

Valore	Esito
--------	-------

1	convergenza verso la soluzione <code>x</code>
-1	l'algoritmo è interrotto da un <code>output function</code>
-3	sono stati trovati valori NaN o Inf
-4	sono stati trovati valori complessi durante la ricerca di un intervallo con cambio di segno
-5	<code>fzero</code> potrebbe essere arrivata a convergenza in un punto singolare
-6	<code>fzero</code> non trova un intervallo con cambio di segno.

Esercizio 8

Usare la function `fzero` per risolvere gli esercizi 5 e 6, scegliendo gli stessi valori iniziali per x_0 e confrontare i risultati ottenuti con il metodo di Newton.

Soluzione Esercizio 8 - Funzioni Es. 5

$$f(x) = \sin x - \cos 2x \quad x_0 = 1 \text{ e } x_1 = 1.5$$

$$z = 0.5236 \quad fz = 3.8858e-16$$

intervaliterations: 10 iterations: 6 funcCount: 26

$$f(x) = x^3 - 7x^2 + 11x - 5$$

$$\text{Se } x_0 = 2 \quad z = 5 \quad fz = 0$$

intervaliterations: 13 iterations: 9 funcCount: 36

$$\text{Se } x_0 = 7 \quad z = 5 \quad fz = 0$$

intervaliterations: 8 iterations: 7 funcCount: 23

$$f(x) = x^4 - 12x^3 + 47x^2 - 60x + 24$$

$$\text{Se } x_0 = 0 \quad z = 0.8883 \quad fz = 0$$

intervaliterations: 11 iterations: 11 funcCount: 34

Se $x_0 = 2$ Exiting fzero: aborting search for an interval containing a sign change because NaN or Inf function value encountered during search. (Function value at $-1.48214e+77$ is Inf.) Check function or try again with a different starting value.

intervaliter: 522 iterations: 0 funcCount: 1044

Soluzione Esercizio 8 - Funzioni Es. 6

$f(x) = 2x^4 - 11x^3 + 21x^2 - 16x + 4$ tol=1e-10, nmax=20

Se $x_0 = 0.75$ z = 0.5000 fz = 0

intervaliterations: 9 iterations: 9 funcCount: 27

Se $x_0 = 1.25$ z = 1.0000 fz = 0

intervaliterations: 7 iterations: 4 funcCount: 18

Se $x_0 = 1.75$ z = 1.0000 fz = 0

intervaliterations: 9 iterations: 5 funcCount: 23

Se $x_0 = 2.25$ z = 1.0000 fz = 0

intervaliterations: 10 iterations: 6 funcCount: 26

Se $x_0 = 2.75$ z = 1.0000 fz = 0

intervaliterations: 10 iterations: 4 funcCount: 24

Il metodo di Newton-Raphson per sistemi

Consideriamo una funzione a valori vettoriali $F : A \rightarrow \mathbb{R}^n$ con $A \subseteq \mathbb{R}^n$:

$$F(\mathbf{x}) = \begin{cases} f_1(x_1, x_2, \dots, x_n) \\ f_2(x_1, x_2, \dots, x_n) \\ \dots\dots\dots \\ f_n(x_1, x_2, \dots, x_n) \end{cases}$$

Problema

Trovare $\mathbf{x} = (x_1, x_2, \dots, x_n) \in A$ tale che $F(\mathbf{x}) = 0$.

Linearizzazione

Per semplicità consideriamo $n = 2$ quindi abbiamo il sistema:

$$\begin{cases} f(x, y) = 0 \\ g(x, y) = 0 \end{cases}$$

Supponiamo di essere arrivati a calcolare un'approssimazione (x_k, y_k) e consideriamo l'approssimazione di f e g con i piani tangenti nel punto (x_k, y_k) :

$$\begin{cases} f(x, y) \approx f(x_k, y_k) + f_x(x_k, y_k)(x - x_k) + f_y(x_k, y_k)(y - y_k) \\ g(x, y) \approx g(x_k, y_k) + g_x(x_k, y_k)(x - x_k) + g_y(x_k, y_k)(y - y_k) \end{cases}$$

Iterazione del metodo di Newton-Raphson

La nuova approssimazione si ottiene come

$$x_{k+1} = x_k + \delta_x \quad y_{k+1} = y_k + \delta_y$$

dove il vettore $\delta = (\delta_x, \delta_y)^T$ è la soluzione del sistema

$$J(x_k, y_k)\delta = -F(x_k, y_k)$$

e

$$J(x_k, y_k) = \begin{pmatrix} f_x(x_k, y_k) & f_y(x_k, y_k) \\ g_x(x_k, y_k) & g_y(x_k, y_k) \end{pmatrix}$$
$$F(x_k, y_k) = \begin{pmatrix} f(x_k, y_k) \\ g(x_k, y_k) \end{pmatrix}$$

Algoritmo di Newton-Raphson

Newton_sist.m

1. Dato \mathbf{x}_0 .
2. Se il test d'arresto è verificato, \mathbf{x}_0 è la soluzione cercata; **stop**.
3. Altrimenti:
 - 3.1 valuta $Y = F(\mathbf{x}_0)$ e lo Jacobiano $A = J(\mathbf{x}_0)$;
 - 3.2 risolvi $A\delta = -Y$;
 - 3.3 aggiorna $\mathbf{x}_0 = \mathbf{x}_0 + \delta$.
4. Ripeti da 2.

Nota bene

F è il nome di una function che fornisce il valore di F in un vettore colonna di dimensione n .

J è il nome di una function che fornisce il valore dello Jacobiano come array $n \times n$.

Function newtonsys

Modificare la function `newton` in modo che possa essere utilizzata per risolvere un sistema non lineare mediante il seguente comando:

```
[z,fz,iter]=newton (@f,@fd,x0,tol,Nit)
```

Input

<code>f</code>	function che contiene la funzione f (vettore colonna);
<code>df</code>	function che contiene lo Jacobiano J (matrice);
<code>x0</code>	punto iniziale per l'iterazione (vettore colonna);
<code>tol</code>	tolleranza desiderata;
<code>Nit</code>	numero massimo di iterazioni da eseguire;

Output

<code>zero</code>	soluzione cercata;
<code>fz</code>	valore di f nello zero calcolato;
<code>iter</code>	numero di iterazioni utilizzate;

fsolve

Risolve i sistemi di equazioni non lineari in più variabili.

Appartiene al toolbox `optim`.

```
[x,fval]=fsolve(@fun,x0)
```

Input

`fun` nome della function che contiene la funzione f
`fun` accetta in input un vettore x e dà in output
il vettore dei valori di f valutata in x .

`x0` dato iniziale

Output

`x` approssimazione dello zero calcolato

`fval` valore di `fun` in `x`.

Opzioni per `fsolve`

```
[x,fval]=fsolve(@fun,x0,options)
```

risolve il sistema con i parametri di default sostituiti da quelli dichiarati nella struttura `options`. `options` viene creato con il comando `optimset`. Vedere `optimset` per i dettagli. Le opzioni più usate sono: `Display`, `TolX`, `TolFun`, `Diagnostics`, `DerivativeCheck`, `Jacobian`, `MaxFunEvals`, `MaxIter`, `PlotFcns`, `OutputFcn`.

Per usare lo Jacobiano la function `FUN` deve dare come output sia il valore di f che quello del suo jacobiano.

Opzioni per `fsolve`

```
[x,fval,exitflag,output]=fsolve(@fun,x0,options)
```

fornisce in output le seguenti informazioni:

`exitflag` ha valore da -4 a 4. Se l'algoritmo è arrivato a convergenza correttamente `exitflag=1`.

`output` è una struttura del seguente tipo:

```
output =  
    iterations: 5  
    funcCount: 18  
    algorithm: 'trust-region dogleg'  
firstorderopt: 1.6919e-07  
    message: [1x76 char]
```

Esercizi

Esercizio 9

Applicare il metodo di Newton-Raphson per trovare gli zeri delle seguenti funzioni:

$$F_1(x, y) = \begin{pmatrix} x + y - 3 \\ x^2 + y^2 - 9 \end{pmatrix} \quad \begin{array}{l} \text{radici: } (0, 3) \ (3, 0) \\ x_0 = (1, 5), \ x_0 = (2, 3) \end{array}$$

$$F_2(x, y) = \begin{pmatrix} x^2 + y^2 - 2 \\ e^{x-1} + y^3 - 2 \end{pmatrix} \quad \begin{array}{l} \text{radice: } (1, 1) \\ x_0 = (1.5, 2), \ x_0 = (2, 3) \end{array}$$

Trovare la soluzione usando il metodo di Newton (`newtonsys`) e la function di Matlab `fsolve`. In questo caso confrontare cosa si ottiene fornendo anche il valore dello Jacobiano.

Problemi di minimo

Esercizio 10

Usare la function `newtonsys` per trovare il minimo delle seguenti funzioni di più variabili:

$$f(x, y) = 10x^2 + y^2 \quad \alpha = (0, 0) \quad x_0 = [1; 2]$$

$$f(x, y) = (x - 2)^4 + (x - 2)^2 y^2 + (y + 1)^2 \\ \alpha = (2, -1) \quad x_0 = [1; 1]$$

$$f(x, y) = x^4 + (x + y)^2 + (e^x - 1)^2 \\ \alpha = (0, 0) \quad x_0 = [1; 1], [-1; 3]$$

$$f(x, y) = 100(y - x^2)^2 + (1 - x)^2 \\ \alpha = (1, 1) \quad x_0 = [-1.9; 2]$$

Rappresentare le superfici corrispondenti alle funzioni date e le loro curve di livello.

Problemi di minimo

segue

Risolvere i precedenti problemi di minimo usando la function di Matlab `fminsearch` mediante il seguente comando

```
x = fminsearch(fun,x0)
```

essendo `fun` il nome della function che contiene la funzione e `x0` il punto iniziale. Per ulteriori dettagli sull'uso di questa function dare il comando `help fminsearch`.

Esercizio facoltativo

Radici terze dell'unità

- ▶ Risolvere in campo complesso l'equazione $z^3 = 1$. Tre radici: $z_0 = 1$, $z_1 = -0.5 + i \sin(2\pi/3)$ e $z_2 = -0.5 - i \sin(2\pi/3)$.
- ▶ Posto $z = x + iy$, trasformare l'equazione data in un sistema di due equazioni reali relative alla parte reale e al coefficiente dell'immaginario.
- ▶ Trovare le soluzioni mediante il metodo di Newton-Raphson.
- ▶ Considerare nel piano complesso un quadrato di lato L .
Suddividere tale quadrato in n^2 quadratini. Utilizzare il centro di ciascun quadratino come x_0 per la risoluzione con il metodo di Newton-Raphson. Colorare il quadratino corrispondente
 - ▶ di rosso se la radice trovata è z_0 ,
 - ▶ di blu se la radice trovata è z_1 ,
 - ▶ di verde se la radice trovata è z_2 .

nargin

La function **nargin** conta i parametri in **input** di una function. Può servire per rendere più flessibile l'uso di una function.

Esempio - nargin

Nella function `newton` si può passare come dato anche il valore dello zero esatto per fare l'analisi dell'errore e della convergenza.

Uso la seguente riga di dichiarazione:

```
function[zero,fz,iter]=newton(f,fd,x0,toll,Niter,output,p)
```

Nel programma per valutare l'ordine di convergenza uso le seguenti istruzioni:

```
if nargin==5  
output=0; p=2  
elseif nargin==6  
p=2  
end
```

e poi procedo con il calcolo del rapporto che dà la convergenza.

nargout

La function **nargout** conta i parametri in **output** di una function. Può servire per rendere più flessibile l'uso di una function.

Esempio - nargout

Si può prevedere che usando la function `newton` si voglia conoscere tutta la successione dei valori ottenuti, più spesso interessano solo il valore dello zero, quello della f ed il numero delle iterazioni.

Uso comunque la seguente riga di dichiarazione:

```
function [zero,fz,iter,xk,fk]=newton (f,fd,x0,toll,Niter)
```

Inserisco nel programma prima della costruzione dei vettori `xk` e `fk` il seguente controllo:

```
if nargout>=4
    xk=....;   fk=....
end
```

Se uso il comando `[zero,fz,iter]=newton(f,fd,x0,toll,Niter)` la successione dei valori ottenuti non verrà memorizzata.

Attenzione le variabili in output devono comunque essere assegnate.