CN # 21,22 / 8 aprile 2013 / C43

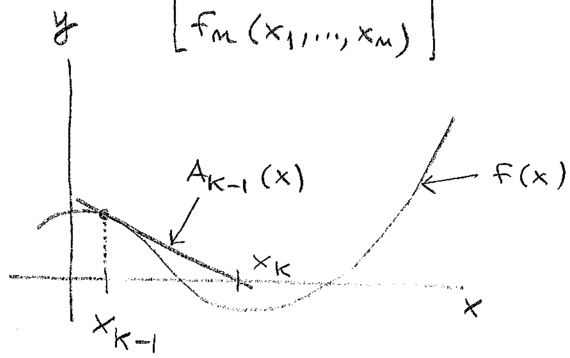
* METODO di NEWTON per $f: \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}^n$ *

(1) Idea: ad ogni passo si affronta il problema "linearizzato" ...

$$f(x) = \underbrace{f(x_{k-1}) + J_f(x_{k-1})(x - x_{k-1})}_{A_{k-1}(x)} + \dots$$

$$f(x) \to \begin{bmatrix} f_1(x_1, \dots, x_m) \\ \vdots \\ f_m(x_1, \dots, x_m) \end{bmatrix}$$

$m = 1$



$J_f(x) \in \mathbb{R}^{m \times m}$ MATRICE JACOBIANA di f in x ...

$$\begin{bmatrix} \frac{\partial f_1}{\partial x_1}(x) & \dots & \frac{\partial f_1}{\partial x_m}(x) \\ \vdots & & \\ \frac{\partial f_m}{\partial x_1}(x) & \dots & \frac{\partial f_m}{\partial x_m}(x) \end{bmatrix}$$

<u>SE</u> $J_f(x_{k-1})$ non singolare

<u>ALLORA</u>: (I) si risolve il SISTEMA LINEARE $\boxed{J_f(x_{k-1})\, v = -f(x_{k-1})}$

(II) si pone $\boxed{x_k = x_{k-1} + v}$

<u>Es</u>: $f(x) = \begin{bmatrix} x_1^2 - x_2 \\ -x_1 + x_2^2 \end{bmatrix} : \mathbb{R}^2 \to \mathbb{R}^2$

- $J_f(x) = \begin{bmatrix} 2x_1 & -1 \\ -1 & 2x_2 \end{bmatrix} : \mathbb{R}^2 \longrightarrow \mathbb{R}^{2\times 2}$

- $x_0 = \begin{pmatrix} 1 \\ -1 \end{pmatrix}$; sistema da risolvere: $J_f(x_0)\, v = -f(x_0)$

ovvero: $\begin{bmatrix} 2 & -1 \\ -1 & -2 \end{bmatrix} v = - \begin{bmatrix} 2 \\ 0 \end{bmatrix}$

$$v = \begin{bmatrix} -4/5 \\ 2/5 \end{bmatrix} \Rightarrow x_1 = x_0 + v = \begin{bmatrix} 1/5 \\ -3/5 \end{bmatrix}$$

(2) É il metodo ad un punto def da

$$h(x) = x - J_f(x)^{-1} f(x) \; : \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}^n$$

- TEO (CONVERGENZA LOCALE): siano $h: \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}^n$ suff regolare e $\alpha \in \mathbb{R}^n$ pu di h.

  SE $\rho(J_h(\alpha)) < 1$

  ALLORA: $\exists\, r > 0$ t.c. $\forall x_0 \in I(\alpha, r)$

  si ha $\boxed{\lim_{k \to \infty} x_k = \alpha}$

def (SPETTRO, RAGGIO SPETTRALE)

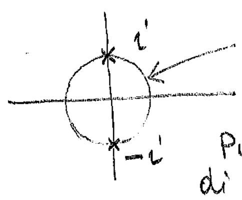
Sia $M \in \mathbb{C}^{n \times n}$

(I) $\sigma(M) = \{ \lambda \in \mathbb{C} \mid \lambda \text{ autovalore di } M \}$

(II) $\rho(M) = \max\{ |\lambda|, \; \lambda \in \sigma(M) \}$

Es: $M = \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 0 & -1 \end{pmatrix}$; $\sigma(M) = \{2, -1\}$, $\rho(M) = 2$

$M = \begin{pmatrix} 0 & -1 \\ 1 & 0 \end{pmatrix}$; $\sigma(M) = \{i, -i\}$, $\rho(M) = 1 \longrightarrow$



$M = \begin{pmatrix} 0 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$; $\sigma(M) = \{0\}$, $\rho(M) = 0$

- $h(x) = x - J_f(x)^{-1} f(x)$

$$\Rightarrow \quad J_h(x) = \cancel{I} - \divideontimes f(x) - \cancel{J_f(x)^{-1} J_f(x)}$$

$$\Rightarrow \quad \boxed{J_h(\alpha) = 0 \quad \text{se} \quad f(\alpha) = 0}$$

- $\boxed{\begin{array}{l}\text{TEO conv locale} \Rightarrow \forall \alpha \text{ t.c. } f(\alpha) = 0 \text{ e} \\ J_f(\alpha) \text{ non singolare}, \ \exists\, r(\alpha) \text{ t.c.} \\ \qquad \forall x_0 \in I(\alpha, r(\alpha)), \ \lim_{k\to\infty} x_k = \alpha \end{array}}$

(3) <u>se</u> f suff regolare, $f(\alpha) = 0$ e $J_f(\alpha)$ non singolare, <u>allora</u> $\boxed{\text{ordine di conv (ad } \alpha) \geq 2.}$

<u>Es</u>: $\boxed{\text{LMV\_newtonNd\_test\_00.sce}}$

$$f(x) = \begin{bmatrix} x_1^2 - x_2 + g \\ -x_1 + x_2^2 + g \end{bmatrix} \qquad (g \in \mathbb{R} \text{ assegnato})$$

$$J_f(x) = \begin{bmatrix} 2x_1 & -1 \\ -1 & 2x_2 \end{bmatrix}$$

- $g = 0$:

(A) $f(x) = 0$ per $x' = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix}$ e $x'' = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$;

(B) $J_f(x') = \begin{bmatrix} 0 & -1 \\ -1 & 0 \end{bmatrix}$ non singolare

```
//
// Test per newtonNd: intersezione di due parabole.
//
// Parte 1: assegnare g = 0. Soluzioni esatte: (0,0) e (1,1).
// (a) Assegnare x0 = [1;-1]. Osservare i grafici della stima
//     dell'errore e dell'ordine di convergenza, calcolare la matrice
//     jacobiana in (0,0) e verificarne la non singolarità.
// (b) Assegnare x0 = [1;0] e sostituire "loquace" con "zitto" nell'uso
//     della funzione newtonNd (altrimenti l'esecuzione si arresta
//     nel desegnare l'ultimo grafico). Verificare che il metodo
//     supera il numero di iterazioni massimo perché la successione
//     calcolata (si trova in XX) è periodica (e quindi è inutile
//     aumentare il numero massimo di iterazioni).
// (c) Cercare x0 in modo che la successione abbia limite (1,1),
//     osservare i grafici della stima dell'errore e dell'ordine di
//     convergenza, calcolare la matrice jacobiana in (1,1) e
//     verificarne la non singolarità.
//
// Parte 2: assegnare g = 1/4. Soluzione esatta: (1/2,1/2).
//     Assegnare x0 = [1;-1]. Osservare i grafici della stima
//     dell'errore e dell'ordine di convergenza, calcolare la matrice
//     jacobiana in (1/2,1/2) e verificarne la singolarità. Calcolare il
//     determinante della matrice jacobiana nel punto z.
//
Percorso = "PERCORSO newtonNd.sci"; // <----------- *** MODIFICARE ***
exec(Percorso + "newtonNd.sci");
//
g = 0;
//g = 1/4;
//
function y=f_test(x)
    y = [x(1)^2 - x(2) + g;
        -x(1) + x(2)^2 + g]
endfunction
//
function j=df_test(x)
    j = [2*x(1),     -1;
             -1, 2*x(2)]
endfunction
//
// *** Ricerca zeri
//
x0 = [1; -1];
E_newt = 1d-8;
kmax = 30;
//
[z,v,info,XX] = newtonNd(f_test,x0,df_test,E_newt,kmax,"loquace");
//
// *** Fine ricerca zeri
//
printf("z ="); disp(z);
printf("v ="); disp(v);
printf("info ="); disp(info);
//
// Grafici
//
scf(0);clf();
// Disegna i grafici delle due curve da intersecare, la successione
// generata dal metodo di Newton (cerchietti verdi) e il punto z
// (crocetta rossa).
tt = linspace(-2,2,100);
plot(tt,tt.^2+g);plot(tt.^2+g,tt);
plot(XX(1,:),XX(2,:),"go--",z(1),z(2),"r+");
xlabel("x(1)");
ylabel("x(2)");
xgrid();
//
```

$$J_f(x'') = \begin{bmatrix} 2 & -1 \\ -1 & 2 \end{bmatrix} \quad \text{non singolare}$$

(C) mi aspetto ordine di conv ≥ 2 ...

- $g = \frac{1}{4}$:

(A) $f(x) = 0$ per $x' = \begin{pmatrix} 1/2 \\ 1/2 \end{pmatrix}$

(B) $J_f(x') = \begin{pmatrix} 1 & -1 \\ -1 & 1 \end{pmatrix}$ singolare

(C) mi aspetto ordine di conv < 2 ...

PROBLEMI

(1) Scelta di x_0: difficile. Per $n=1$ si hanno ausili grafici, per $n>1$ no. Può aiutare, in casi specifici, l'interpretaz (grafica, fisica ...) del problema.

- CONTINUATION METHODS

(2) Costo :

(A) calcolo di $J_f(x)$: ad ogni iterazione da calcolare n^2 funzioni...

• "approssimazioni" di $J_f(x)$

Es: $n=1$. $h(x) = x - \frac{f(x)}{F}$, $F \in \mathbb{R}$

• $h'(x) = 1 - \frac{f'(x)}{F} \Rightarrow h'(\alpha) = 1 - \frac{f'(\alpha)}{F}$

<u>se</u> $F \neq f'(\alpha)$ (caso tipico!)

<u>allora</u> $h'(\alpha) \neq 0 \Rightarrow$ ordine di conv < 2 !

(B) Soluzione del sistema lineare:

$$J_f(x_{k-1})\, v = - f(x_{k-1})$$

Costo (numero di op aritmetiche) con metodo di Gauss: $\sim n^3$