

NEWTONOVA METODA PRO ŘEŠENÍ SYSTÉMU DVOU NELINEÁRNÍCH ROVNIC

- je dána soustava dvou nelineárních rovnic o dvou neznámých

$$f_1(x_1, x_2) = 0$$

$$f_2(x_1, x_2) = 0$$

- vektorový zápis soustavy: $F(\mathbf{x}) = \mathbf{0}$, $\mathbf{x} = (x_1, x_2)^T \in \mathbb{R}^2$, $\mathbf{0} = (0, 0)^T \in \mathbb{R}^2$
- ekvivalence úloh: $F(\mathbf{x}) = \mathbf{0} \Leftrightarrow \mathbf{x} = G(\mathbf{x})$, kde $G(\mathbf{x})$ je iterační matice tvaru

$$G(\mathbf{x}) = \mathbf{x} - J_F^{-1}(\mathbf{x})F(\mathbf{x}), \text{ kde } J_F(\mathbf{x}) = \begin{pmatrix} \frac{\partial f_1(\mathbf{x})}{\partial x_1} & \frac{\partial f_1(\mathbf{x})}{\partial x_2} \\ \frac{\partial f_2(\mathbf{x})}{\partial x_1} & \frac{\partial f_2(\mathbf{x})}{\partial x_2} \end{pmatrix}$$

se nazývá Jacobiova matice funkce F .

- iterační vztah:

$$\mathbf{x}^{(i+1)} = \mathbf{x}^{(i)} - J_F^{-1}(\mathbf{x}^{(i)})F(\mathbf{x}^{(i)}), i = 0, 1, 2, \dots$$

- postup pro výpočet:

1. označme $\mathbf{d}^{(i)} = \mathbf{x}^{(i+1)} - \mathbf{x}^{(i)}$
2. $J_F(\mathbf{x}^{(i)})\mathbf{d}^{(i)} = -F(\mathbf{x}^{(i)}) \longrightarrow$ výpočet $\mathbf{d}^{(i)}$
3. dosazení do iteračního vztahu: $\mathbf{x}^{(i+1)} = \mathbf{x}^{(i)} + \mathbf{d}^{(i)}$

Příklad. Newtonovou metodou řešte systém nelineárních rovnic

$$2x - e^y + 2 = 0$$

$$e^x + y - 1 = 0.$$

Počítejte s počáteční aproximací $\mathbf{x}^{(0)} = (0, 0)^T$ a přesností $\varepsilon = 0.001$.

Řešení.

Souhrnné výsledky (výsledky jsou uvedeny pro použití různých typů norem):

i	$x^{(i)}$	$y^{(i)}$	$d_1^{(i)}$	$d_2^{(i)}$	$ \mathbf{d}^{(i)} _\infty$	$x^{(i+1)}$	$y^{(i+1)}$	
0	0.0000	0.0000	-0.3333	0.3333	0.3333	-0.3333	0.3333	$\Rightarrow \hat{\mathbf{x}} = \begin{pmatrix} -0.3352 \\ 0.2848 \end{pmatrix}$
1	-0.3333	0.3333	-0.0025	-0.0481	0.0481	-0.3358	0.2852	
2	-0.3358	0.2852	0.0006	-0.0004	0.0006 < 0.001	-0.3352	0.2848	
i	$x^{(i)}$	$y^{(i)}$	$d_1^{(i)}$	$d_2^{(i)}$	$ \mathbf{d}^{(i)} _1$	$x^{(i+1)}$	$y^{(i+1)}$	
0	0.0000	0.0000	-0.3333	0.3333	0.6666	-0.3333	0.3333	$\Rightarrow \hat{\mathbf{x}} = \begin{pmatrix} -0.3352 \\ 0.2848 \end{pmatrix}$
1	-0.3333	0.3333	-0.0025	-0.0481	0.0506	-0.3358	0.2852	
2	-0.3358	0.2852	0.0006	-0.0004	0.0010 $\leq$ 0.001	-0.3352	0.2848	
i	$x^{(i)}$	$y^{(i)}$	$d_1^{(i)}$	$d_2^{(i)}$	$ \mathbf{d}^{(i)} _2$	$x^{(i+1)}$	$y^{(i+1)}$	
0	0.0000	0.0000	-0.3333	0.3333	0.4714	-0.3333	0.3333	$\Rightarrow \hat{\mathbf{x}} = \begin{pmatrix} -0.3352 \\ 0.2848 \end{pmatrix}$
1	-0.3333	0.3333	-0.0025	-0.0481	0.0482	-0.3358	0.2852	
2	-0.3358	0.2852	0.0006	-0.0004	0.0007 < 0.001	-0.3352	0.2848	

Příklad. Newtonovou metodou řešte systém nelineárních rovnic

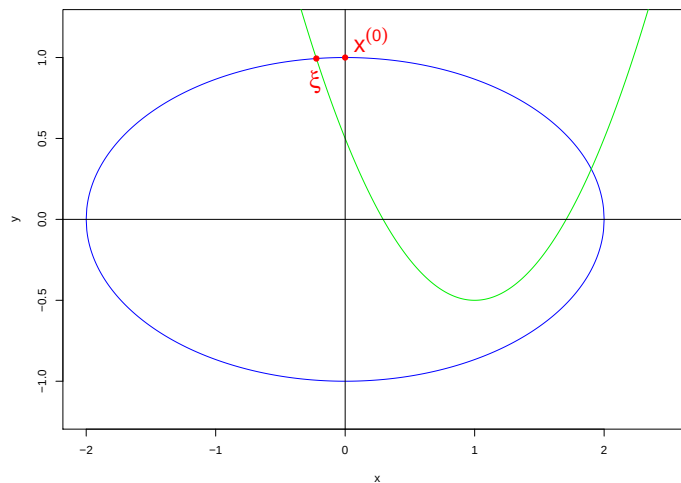
$$\begin{aligned}x^2 - 2x - y + \frac{1}{2} &= 0 \\x^2 + 4y^2 - 4 &= 0.\end{aligned}$$

Počítejte s počáteční aproximací $\mathbf{x}^{(0)} = (0, 1)^T$ a přesností $\varepsilon = 0.001$.

Řešení.

- Úprava na rovnici systému na středový tvar:

$$\begin{aligned}x^2 - 2x - y + \frac{1}{2} &= (x - 1)^2 - y - \frac{1}{2} = 0 \rightarrow y = (x - 1)^2 - \frac{1}{2} \dots \text{rovnice paraboly} \\x^2 + 4y^2 - 4 &= 0 \rightarrow x^2 + 4y^2 = 4 \rightarrow \frac{x^2}{4} + y^2 = 1 \dots \text{elipsa: } S = [0, 0], a = 2, b = 1\end{aligned}$$



- Jacobiova matice:

$$\begin{aligned}\frac{\partial f_1(x, y)}{\partial x} &= 2x - 2 \\ \frac{\partial f_1(x, y)}{\partial y} &= -1 \\ \frac{\partial f_2(x, y)}{\partial x} &= 2x \\ \frac{\partial f_2(x, y)}{\partial y} &= 8y\end{aligned} \quad \Rightarrow J_F(\mathbf{x}) = \begin{pmatrix} 2x - 2 & -1 \\ 2x & 8y \end{pmatrix}$$

- Výpočet $\mathbf{x}^{(1)}$:

$$J_F(\mathbf{x}^{(0)}) = \begin{pmatrix} -2 & -1 \\ 0 & 8 \end{pmatrix}, F(\mathbf{x}^{(0)}) = \begin{pmatrix} -\frac{1}{2} \\ 0 \end{pmatrix}$$

Řešíme systém $J_F(\mathbf{x}^{(0)})\mathbf{d}^{(0)} = -F(\mathbf{x}^{(0)})$:

$$\left(\begin{array}{cc|c} -2 & -1 & \frac{1}{2} \\ 0 & 8 & 0 \end{array} \right) \sim \dots \sim \left(\begin{array}{cc|c} 1 & 0 & -\frac{1}{4} \\ 0 & 1 & 0 \end{array} \right) \Rightarrow \mathbf{d}^{(0)} = \begin{pmatrix} -\frac{1}{4} \\ 0 \end{pmatrix}$$

Výpočet aproximace $\mathbf{x}^{(1)}$:

$$\mathbf{d}^{(0)} = \mathbf{x}^{(1)} - \mathbf{x}^{(0)} \rightarrow \mathbf{x}^{(1)} = \mathbf{d}^{(0)} + \mathbf{x}^{(0)} = \begin{pmatrix} -\frac{1}{4} \\ 0 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -\frac{1}{4} \\ 1 \end{pmatrix}$$

- Výpočet $\mathbf{x}^{(2)}$:

$$J_F(\mathbf{x}^{(1)}) = \begin{pmatrix} -\frac{5}{2} & -1 \\ -\frac{1}{2} & 8 \end{pmatrix}, F(\mathbf{x}^{(1)}) = \begin{pmatrix} \frac{1}{16} \\ \frac{1}{16} \end{pmatrix}$$

Řešíme systém $J_F(\mathbf{x}^{(1)})\mathbf{d}^{(1)} = -F(\mathbf{x}^{(1)})$:

$$\left(\begin{array}{cc|c} -\frac{5}{2} & -1 & -\frac{1}{16} \\ -\frac{1}{2} & 8 & -\frac{1}{16} \end{array} \right) \sim \dots \sim \left(\begin{array}{cc|c} 1 & 0 & 0.0274 \\ 0 & 1 & -0.0061 \end{array} \right) \Rightarrow \mathbf{d}^{(1)} = \begin{pmatrix} 0.0274 \\ -0.0061 \end{pmatrix}$$

Výpočet aproximace $\mathbf{x}^{(2)}$:

$$\mathbf{d}^{(1)} = \mathbf{x}^{(2)} - \mathbf{x}^{(1)} \rightarrow \mathbf{x}^{(2)} = \mathbf{d}^{(1)} + \mathbf{x}^{(1)} = \begin{pmatrix} 0.0274 \\ -0.0061 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} -\frac{1}{4} \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -0.2226 \\ 0.9939 \end{pmatrix}$$

- Výpočet $\mathbf{x}^{(3)}$ analogický
- Souhrnné výsledky (výsledky jsou uvedeny pro použití různých typů norem):

i	$x^{(i)}$	$y^{(i)}$	$d_1^{(i)}$	$d_2^{(i)}$	$ \mathbf{d}^{(i)} _\infty$	$x^{(i+1)}$	$y^{(i+1)}$	
0	0.0000	1.0000	-0.2500	0.0000	0.2500	-0.2500	1.0000	$\Rightarrow \hat{\mathbf{x}} = \begin{pmatrix} -0.2222 \\ 0.9938 \end{pmatrix}$
1	-0.2500	1.0000	0.0274	-0.0061	0.0274	-0.2226	0.9939	
2	-0.2226	0.9939	0.0004	-0.0001	0.0004 < 0.001	-0.2222	0.9938	
i	$x^{(i)}$	$y^{(i)}$	$d_1^{(i)}$	$d_2^{(i)}$	$ \mathbf{d}^{(i)} _1$	$x^{(i+1)}$	$y^{(i+1)}$	
0	0.0000	1.0000	-0.2500	0.0000	0.2500	-0.2500	1.0000	$\Rightarrow \hat{\mathbf{x}} = \begin{pmatrix} -0.2222 \\ 0.9938 \end{pmatrix}$
1	-0.2500	1.0000	0.0274	-0.0061	0.0335	-0.2226	0.9939	
2	-0.2226	0.9939	0.0004	-0.0001	0.0005 < 0.001	-0.2222	0.9938	
i	$x^{(i)}$	$y^{(i)}$	$d_1^{(i)}$	$d_2^{(i)}$	$ \mathbf{d}^{(i)} _2$	$x^{(i+1)}$	$y^{(i+1)}$	
0	0.0000	1.0000	-0.2500	0.0000	0.2500	-0.2500	1.0000	$\Rightarrow \hat{\mathbf{x}} = \begin{pmatrix} -0.2222 \\ 0.9938 \end{pmatrix}$
1	-0.2500	1.0000	0.0274	-0.0061	0.0281	-0.2226	0.9939	
2	-0.2226	0.9939	0.0004	-0.0001	0.0004 < 0.001	-0.2222	0.9938	