

توسعه روش تکراری نیوتن و معرفی روش های سریع برای حل معادلات غیرخطی

صمد عهدی اقدم^{*}، رضا رضاپور

اعضای هیات علمی گروه ریاضی، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد مرند

رسید مقاله: ۸۸/۳/۲

پذیرش مقاله: ۸۹/۶/۲۹

چکیده

در این مقاله برخی اصلاحات روش کلاسیک نیوتن با همگرایی مکعبی را به همراه روش هالی در نظر گرفته و به کمک قاعده مشتق گیری عددی گاوس و قواعد انتگرال گیری عددی روش هایی ترکیبی به دست می آوریم. تحلیل همگرایی نشان می دهد که روش های ارایه شده دارای مراتب همگرایی پنج یا شش می باشند و آزمون های عددی موید کارایی بیشتر و بهتر این روش ها نسبت به سایر روش های موجود هستند.

کلمات کلیدی: ریشه یابی، روش نیوتن، روش های تکراری، انتگرال گیری عددی و مشتق گیری عددی.

۱ مقدمه

روش کلاسیک نیوتن برای یافتن ریشه معادله $f(x) = 0$ عبارت است از:

$$x_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)}{f'(x_n)} \quad (1)$$

با قرار دادن $\frac{f}{f'}$ در محل f در فرمول نیوتن، روش تکراری شرودر با فرمول

$$x_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)f'(x_n)}{[f'(x_n)]^2 - f(x_n)f''(x_n)} \quad (2)$$

حاصل می شود.

بسط تیلور مرتبه دوم تابع $f(x)$ حول نقطه x_n (به ازای $x = x_{n+1}$) به صورت

$$0 = f(x_{n+1}) \cong f(x_n) + (x_{n+1} - x_n) \left[f'(x_n) + \frac{1}{2} f''(x_n)(x_{n+1} - x_n) \right] \quad (3)$$

^{*}عهده دار مکاتبات

آدرس الکترونیکی: ahdi@marandiau.ac.ir

است که با قرار دادن $-\frac{f(x_n)}{f'(x_n)}$ از فرمول نیوتن به جای عبارت $(x_{n+1} - x_n)$ در داخل کرشه و حل معادله حاصل نسبت به x_{n+1} فرمول روش هالی به صورت

$$x_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)f'(x_n)}{[f'(x_n)]^2 - \frac{1}{2}f(x_n)f''(x_n)} \quad (4)$$

حاصل می شود.

روش های کلاسیک نیوتن و شرودر دارای مرتبه همگرایی دو بوده و روش هالی مرتبه همگرایی سه دارد. روش های مرتبه سوم که با اصلاحاتی از روش نیوتن در [1، 2، 6، 7 و 8] ارایه شده اند، با در نظر گرفتن فرمول های درجه دوم متفاوت برای محاسبه انتگرال

$$f(x) = f(x_n) + \int_{x_n}^x f'(t)dt \quad (5)$$

به دست می آیند که با رعایت نامگذاری های همان مراجع به ترتیب آن ها را توضیح می دهیم:

الف روش میانگین حسابی نیوتن

از فرمول (5) به ازای $x = x_{n+1}$ و $f(x_{n+1}) = 0$ نتیجه می شود:

$$0 = f(x_n) + \int_{x_n}^{x_{n+1}} f'(t)dt \quad (6)$$

که با استفاده از قاعده انتگرال گیری ذوزنقه ای به فرمول

$$x_{n+1} = x_n - \frac{2f(x_n)}{f'(x_{n+1}) + f'(x_n)}$$

می رسیم که مشکل معلوم بودن x_{n+1} در سمت راست این رابطه (برای محاسبه خودش) را می توان با اعمال تکرار $(n+1)$ ام نیوتن در طرف راست برطرف نمود. به این ترتیب روش نیوتن اصلاح شده با نام روش میانگین حسابی نیوتن به صورت زیر به دست می آید:

$$x_{n+1} = x_n - \frac{2f(x_n)}{f'(x_{n+1}^*) + f'(x_n)} \quad (7)$$

که

$$x_{n+1}^* = x_n - \frac{f(x_n)}{f'(x_n)} \quad (*)$$

ب روش نقطه میانی نیوتن

با به کارگیری قاعده نقطه میانی برای انتگرال موجود در (۶) به روش دیگری به صورت

$$x_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)}{f'\left(\frac{x_n + x_{n+1}^*}{2}\right)} \quad (۸)$$

دست می‌یابیم که همانند روش قبل x_{n+1}^* از رابطه (*) محاسبه می‌شود.

پ روش واسطه موزون نیوتن

با در نظر گرفتن بسط تیلور درجه اول $f(x)$ حول نقاط x_n و x_{n+1} داریم:

$$\begin{cases} f(x) \approx f(x_n) + f'(x_n)(x - x_n) \\ f(x) \approx f(x_{n+1}) + f'(x_{n+1})(x - x_{n+1}) \end{cases}$$

در این عبارات به جای x به ترتیب x_n و x_{n+1} را نوشته و تقریبها را به تساوی در نظر می‌گیریم. سپس با حل هر یک از این معادلات نسبت به x_{n+1} و محاسبه میانگین آن‌ها روشی به صورت

$$x_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)}{2} \left[\frac{1}{f'(x_n)} + \frac{1}{f'(x_{n+1}^*)} \right] \quad (۹)$$

حاصل می‌شود که هومیر [۳] نیز آن را به دست آورده است.

۲ روش های نو و تحلیل همگرایی

تقریب ریشه توابعی نظیر $f(x) = \sin(x)e^{-x} + \ln(x^2 + 1)$ با روش های شرودر و هالی به دلیل نیاز به تعیین f'' با محاسبات فراوانی همراه است. برای سهولت می‌توان با استفاده از قاعده مشتق‌گیری عددی گاوس به جای f'' عباراتی بر حسب f' یا f را قرار داد. قاعده مشتق‌گیری عددی گاوس سه نقطه‌ای به صورت

$$\forall x \in [x_n, x_{n+1}]; f''(x) \approx w_0 f(x_n) + w_1 f\left(\frac{x_n + x_{n+1}}{2}\right) + w_2 f(x_{n+1})$$

فرمول مرتبه سوم

$$x_{n+1} = x_n - \frac{3f(x_n) - 4f\left(\frac{x_n + x_{n+1}^*}{2}\right) + 2f(x_{n+1}^*)}{f'(x_n)} \quad (۱۰)$$

را نتیجه می‌دهد که آن را فرمول نیوتن-گاوس می‌نامیم. در این فرمول نیز x_{n+1}^* از رابطه (*) محاسبه می‌شود.

در ادامه برخی اصلاحات جدید روش نیوتن را با یک یا دو ارزیابی اضافی از تابع در یک نقطه تکراری دیگر به وسیله روش های مرتبه سوم ارائه می کنیم. این روش ها دارای مرتبه همگرایی پنج یا شش هستند. به این منظور انتگرال (۵) را روی بازه $[u_{n+1}, x_{n+1}]$ با قاعده مستطیلی تقریب می زنیم که با حل معادله نسبت به x_{n+1} نتیجه می شود:

$$x_{n+1} = u_{n+1} - \frac{f(u_{n+1})}{f'(u_{n+1})} \quad (11)$$

برای بدست آوردن روش های نیوتن اصلاح شده ترکیبی و همچنین برای کاستن از تعداد ارزیابی های توابع، $f'(u_{n+1})$ را با $f'(x_{n+1}^*)$ برآورد می کنیم که x_{n+1}^* از رابطه (*) محاسبه می شود. بنابراین یک رده از روش های جدید

$$x_{n+1} = u_{n+1} - \frac{f(u_{n+1})}{f'(x_{n+1}^*)} \quad (12)$$

حاصل می شود که $u_{n+1} = g(x_n)$ یکی از روش های قبلی است. علاوه بر این با استفاده از بسط تیلور داریم:

$$\begin{cases} f'(x_{n+1}^*) \approx f'(x_n) + f''(x_n)(x_{n+1}^* - x_n) \\ f'\left(\frac{x_n + x_{n+1}^*}{2}\right) \approx f'(x_n) + \frac{1}{2}f''(x_n)(x_{n+1}^* - x_n) \end{cases}$$

از این دو رابطه می توانیم تقریب

$$f'(x_{n+1}^*) \approx 2f'\left(\frac{x_n + x_{n+1}^*}{2}\right) - f'(x_n)$$

را به دست آوریم که با به کارگیری این تقریب در رابطه (۱۱) گروه دیگری از روش های جدید به صورت

$$x_{n+1} = u_{n+1} - \frac{f(u_{n+1})}{2f'\left(\frac{x_n + x_{n+1}^*}{2}\right) - f'(x_n)} \quad (13)$$

حاصل می شوند.

در ادامه در قضایای ۱ و ۲ ثابت می کنیم که ترکیب روش های مرتبه سه با روابط (۱۲) یا (۱۳) روش هایی از مرتبه پنج و با رابطه (۱۱) روش هایی از مرتبه شش را تولید می کند. برخی از ترکیبات روش ها که دارای کارایی بهتر و تعداد اعمال کمتری می باشند، عبارتند از:

الف ترکیب (۷) با (۱۲) را روش میانگین حسابی اصلاح شده نیوتن می نامیم:

$$\begin{cases} u_{n+1} = x_n - \frac{2f(x_n)}{f'(x_{n+1}^*) + f'(x_n)}, \\ x_{n+1} = u_{n+1} - \frac{f(u_{n+1})}{f'(x_{n+1}^*)}. \end{cases} \quad (14)$$

ب ترکیب (۸) با (۱۳) را روش نقطه میانی اصلاح شده نیوتن نامگذاری می کنیم:

$$\begin{cases} u_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)}{f'\left(\frac{x_n + x_{n+1}^*}{2}\right)}, \\ x_{n+1} = u_{n+1} - \frac{f(u_{n+1})}{2f'\left(\frac{x_n + x_{n+1}^*}{2}\right) - f'(x_n)}. \end{cases} \quad (15)$$

پ ترکیب (۹) با (۱۲) با نام روش واسطه موزون اصلاح شده نیوتن عبارت است از:

$$\begin{cases} u_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)}{2} \left[\frac{1}{f'(x_n)} + \frac{1}{f'(x_{n+1}^*)} \right], \\ x_{n+1} = u_{n+1} - \frac{f(u_{n+1})}{f'(x_{n+1}^*)}. \end{cases} \quad (16)$$

ت ترکیب روش هالی همچون سایر روش های از مرتبه سه با (۱۲) یا (۱۳) روشی با مرتبه همگرایی پنج می باشد، ولی برای کاستن از تعداد اعمال بهتر است آن را با (۱۱) و با نام روش هالی اصلاح شده ترکیب کنیم که مرتبه همگرایی آن با استناد به قضیه ۲، شش می باشد. در فرمول هالی x_{n+1}^* حضور ندارد و بنابراین نیازی به استفاده از رابطه (*) نیست.

$$\begin{cases} u_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)f'(x_n)}{[f'(x_n)]^2 - \frac{1}{2}f(x_n)f''(x_n)}, \\ x_{n+1} = u_{n+1} - \frac{f(u_{n+1})}{f'(u_{n+1})}. \end{cases} \quad (17)$$

۳ محاسبه مرتبه همگرایی روش ها

با استفاده از بسط تیلور تابع $f(x_n)$ و مشتقات اول و دوم آن حول r (ریشه تابع f) فرمول های خطای

$$\begin{cases} e_{n+1} = c_2 e_n^2 + o(e_n^3), \\ e_{n+1} = -c_2^2 e_n^2 + o(e_n^3) \end{cases}$$

به ترتیب برای روش های نیوتن و شرودر حاصل می شود که در آن ها $e_n = x_n - r$ و $c_k = \frac{f^{(k)}(r)}{k!f'(r)}$ به ازای $k = 2, 3, \dots$ است. این روابط نشان می دهند که مرتبه همگرایی این روش ها حد اقل دو می باشد.

در مورد روش های مرتبه سوم روابط خطای زیر را داریم:

$$\begin{aligned}
 e_{n+1} &= \left(c_2^2 + \frac{c_3}{2}\right)e_n^3 + O(e_n^4) && \text{- روش میانگین حسابی نیوتن} \\
 e_{n+1} &= \left(c_2^2 - \frac{1}{4}c_3\right)e_n^3 + O(e_n^4) && \text{- روش نقطه میانی نیوتن} \\
 e_{n+1} &= \frac{1}{2}c_3e_n^3 + O(e_n^4) && \text{- روش واسطه موزون نیوتن} \\
 e_{n+1} &= (c_2^2 - c_3)e_n^3 + O(e_n^4) && \text{- روش هالی} \\
 e_{n+1} &= \left(2c_2^2 - \frac{1}{2}c_3\right)e_n^3 + O(e_n^4) && \text{- روش نیوتن-گائوس}
 \end{aligned}$$

برای تعیین مرتبه همگرایی روش های از مراتب بالا، روش های مرتبه سوم بیان شده را به فرم کلی

$$u_{n+1} = g_3(x_n) \quad (18)$$

در نظر گرفته و اولین قضیه را می آوریم.

قضیه ۱ فرض می کنیم تابع $f: D \subset R \rightarrow R$ در بازه باز D دارای یک ریشه ساده r است و در این بازه مشتقات اول، دوم و سوم را داراست. در این صورت روش های تعریف شده با (۱۲) و (۱۳)، که در آن ها u_{n+1} در (۱۸) معرفی شده و در فرمول

$$u_{n+1} - r = Ae_n^3 + O(e_n^4) \quad (19)$$

برای برخی $A \neq 0$ و $e_n = x_n - r$ صدق می کنند، دارای مرتبه همگرایی پنج هستند.

اثبات چون $f(r) = 0$ ، پس بسط تیلور تابع $f(u_{n+1})$ حول نقطه r را به صورت

$$f(u_{n+1}) = f'(r)[(u_{n+1} - r) + O((u_{n+1} - r)^2)]$$

در نظر می گیریم و همچنین با استفاده از تقسیم چند جمله ای ها می توان نوشت:

$$\frac{1}{f'(x_{n+1}^*)} = \frac{1}{f'(r)} [1 - 2c_2^2 e_n^2 + 4c_2(c_2^2 - c_3)e_n^3 + O(e_n^4)]$$

اکنون با کمک این روابط فرمول (۱۲) را به صورت

$$\begin{aligned}
 x_{n+1} - r &= u_{n+1} - r - [(u_{n+1} - r) - 2c_2^2 e_n^2 (u_{n+1} - r) + O(e_n^6)] \\
 &= 2c_2^2 e_n^2 (u_{n+1} - r) + O(e_n^6) = 2c_2^2 A e_n^5 + O(e_n^6).
 \end{aligned}$$

می نویسیم و به طریق مشابه مرتبه همگرایی (۱۳) به صورت زیر محاسبه می شود:

$$x_{n+1} - r = \left(2c_2^2 - \frac{3}{2}c_3\right)Ae_n^5 + O(e_n^6).$$

در واقع با ترکیب هر پنج روش مرتبه سوم معرفی شده با فرمول های (۱۲) یا (۱۳) می توان ده روش مرتبه پنجم به دست آورد. به هر حال هفت روش ذکر نشده در مقایسه با روش های تعریف شده توسط (۱۴) تا (۱۶) به محاسبه مازاد از مشتق اول نیاز دارند و بنابراین کارایی کمتری دارند. با به کارگیری فرمول های خطا و قضیه ۱ نتیجه می شود که برای روش های (۱۴) تا (۱۶) معادلات خطای زیر برقرارند:

$$e_{n+1} = c_2^2 (2c_2^2 + c_3) e_n^5 + O(e_n^6) \quad \text{روش معرفی شده بوسیله (۱۴):}$$

$$e_{n+1} = (2c_2^2 - \frac{3}{2}c_3)(c_2^2 - \frac{1}{4}c_3) e_n^5 + O(e_n^6) \quad \text{روش تعریف شده با (۱۵):}$$

$$e_{n+1} = c_2^2 c_3 e_n^3 + O(e_n^6) \quad \text{روش توصیف شده به وسیله (۱۶):}$$

قضیه ۲ با مفروضات قضیه ۱، ترکیب روش های از مرتبه سه با رابطه (۱۱) روش هایی با مرتبه همگرایی شش تولید می کند.

اثبات برای رابطه (۱۱) با جایگزین نمودن u_{n+1} به جای x_n در فرمول خطای نیوتن خواهیم داشت:

$$\begin{aligned} x_{n+1} - r &= u_{n+1} - r - \frac{[(u_{n+1} - r) + c_2(u_{n+1} - r)^2 + O((u_{n+1} - r)^3)]}{[1 + 2c_2(u_{n+1} - r) + O((u_{n+1} - r)^2)]} \\ &= c_2(u_{n+1} - r)^2 + O((u_{n+1} - r)^3) \end{aligned}$$

که استفاده از (۱۹) نتیجه مطلوب را به صورت $x_{n+1} - r = c_2 A e_n^6 + O(e_n^7)$ به دست می دهد.

ترکیب هر یک از روش های مرتبه سوم با (۱۱) روشی از مرتبه شش را تولید می کند که از بین این ها فقط ترکیب (۱۷) را به دلیل کارایی بهترش در نظر می گیریم. فرمول خطای این روش $e_{n+1} = c_2(c_2^2 - c_3)e_n^6 + O(e_n^7)$ است.

۱ آزمون ها و مقایسه روش ها

روش های معرفی شده در تعداد ارزیابی های توابع و همینطور در تعداد اعمال حسابی در هر تکرار با هم متفاوتند. برای مقایسه روش ها به اختصار روش های نیوتن، شرودر و هالی را به ترتیب با نمادهای SCH، CN و HL و روش های مرتبه سوم (۷) تا (۱۰) را به ترتیب با نمادهای AN، MN، HN و NG و روش های مرتبه پنجم (۱۴) تا (۱۶) را به ترتیب با نمادهای AN5، MN5 و HN5 و روش مرتبه شش (۱۷) را با HL6 نشان می دهیم.

با استفاده از [4] شاخص کارایی را به صورت $p^{\frac{1}{w}}$ تعریف می کنیم که p مرتبه روش و w تعداد ارزیابی های توابع در هر تکرار از یک روش است. شاخص کارایی روش ها را در جدول ۱ می آوریم.

CN	SCH	NG	AN,MN,HN,HL	AN5,MN5,HN5	HL6
$\sqrt{2} \cong 1.414$	$\sqrt[3]{2} \cong 1.260$	$\sqrt[4]{3} \cong 1.316$	$\sqrt[3]{3} \cong 1.442$	$\sqrt[4]{5} \cong 1.495$	$\sqrt[3]{6} \cong 1.431$

جدول ۱. مقایسه شاخص کارایی روش ها

در ادامه هریک از این روش ها را برای تقریب ریشه r توابع انتخابی

$$f_1(x) = x^3 + 4x^2 - 10; \quad r = 1.3652300134141$$

$$f_2(x) = xLn(x) - \cos(x); \quad r = 1.26668360567426$$

$$f_3(x) = e^x - 3\cos^2(x) + 5x; \quad r = 0.286017295428356$$

به کار گرفته و نتایج را در جدول های ۲ تا ۴ می آوریم. این جدول ها شامل تعداد تکرارها (n) زمان انجام محاسبات (T) بر حسب ثانیه و مقدار تقریبی ریشه (x_n) با معیار توقف $|f(x_n)| < 10^{-14}$ برای دستیابی به ریشه مورد نظر هستند.

	T	n	x_n	$f(x_n)$
CN	0.036151	5	1.3652300134141	0
SCH	0.056851	5	1.3652300134141	0
NG	0.069174	5	1.3652300134141	8.9×10^{-15}
AN	0.050837	3	1.3652300134141	0
MN	0.025676	3	1.3652300134141	-3.6×10^{-15}
HN	0.024961	3	1.3652300134141	0
HL	0.028207	3	1.3652300134141	0
AN5	0.021746	2	1.3652300134141	0
MN5	0.022196	2	1.3652300134141	0
HN5	0.019795	2	1.3652300134141	0
HN6	0.026541	2	1.3652300134141	0

جدول ۲. اطلاعات مربوط به تابع f_1 با تقریب اولیه $x_0 = 1.8$

	T	n	x_n	$f(x_n)$
CN	0.610255	5	1.26668360567426	2.2×10^{-16}
SCH	0.780674	5	1.26668360567426	2.2×10^{-16}
NG	0.671505	3	1.26668360567426	7.2×10^{-16}
AN	0.530780	3	1.26668360567426	2.2×10^{-16}
MN	0.452732	3	1.26668360567426	-3.3×10^{-16}
HN	0.530222	3	1.26668360567426	2.2×10^{-16}
HL	0.468445	3	1.26668360567426	-1.3×10^{-15}
AN5	0.421051	2	1.26668360567426	2.2×10^{-16}
MN5	0.468920	2	1.26668360567426	-9.5×10^{-15}
HN5	0.264722	2	1.26668360567426	2.2×10^{-16}
HN6	0.531263	2	1.26668360567426	2.2×10^{-16}

جدول ۳. اطلاعات مربوط به تابع f_2 با تقریب اولیه $x_0 = 0.9$

	T	n	x_n	$f(x_n)$
CN	0.781660	5	0.286017295428356	-2.2×10^{-16}
SCH	1.171487	5	0.286017295428356	-4.4×10^{-16}
NG	0.968011	3	0.286017295428356	-2×10^{-15}
AN	0.702713	3	0.286017295428356	-4.4×10^{-16}
MN	0.624448	3	0.286017295428356	-2.2×10^{-16}
HN	0.639550	3	0.286017295428356	-6.7×10^{-16}
HL	0.734477	3	0.286017295428356	-2.2×10^{-16}
AN5	0.640121	2	0.286017295428356	-2.2×10^{-16}
MN5	0.609457	2	0.286017295428356	-4.4×10^{-16}
HN5	0.374678	2	0.286017295428356	-6.7×10^{-16}
HN6	0.780925	2	0.286017295428356	-2.2×10^{-16}

جدول ۴. اطلاعات مربوط به تابع f_3 با تقریب اولیه $x_0 = 0$

نتیجه گیری

اصلاحاتی از روش نیوتن با مراتب همگرایی بالا را معرفی نمودیم که روش های مرتبه پنج دارای شاخص کارایی بهتری هستند. روش های معرفی شده در مقایسه با روش های شرودر و هالی به دلیل عدم نیاز به محاسبه مشتق دوم به مجموعه وسیع تری از توابع قابل استفاده هستند.

روش NG با این که نسبت به سایر روش های جدید مدت زمان اجرای زیادی لازم دارد ولی در حل دستگاه های معادلات به دلیل نیاز به محاسبه تنها یک ماتریس ژاکوبین بر روش هایی همچون AN، HN، AN5 و HN5 از لحاظ تعداد محاسبات کمتر ارجحیت خواهد داشت.

آزمون های عددی نشان می دهند که روش های جدید از لحاظ تعداد تکرارها (برای رسیدن به دقت یکسان) مقرون به صرفه اند. از بین کلیه روش های مورد بحث زمان های انجام محاسبات برای روش HN5 نسبت به بقیه روش ها کمتر است و لذا این روش بر دیگر روش ها ارجحیت دارد.

منابع

- [1] Frontini M., Sormani E., (2003), Some variants of Newton's method with third-order convergence, J. Comput. Appl. Math. 140, 419-426.
- [2] Frontini M., Sormani E., (2003), Modified Newton's method with third convergence and multiple roots, J. Comput. Appl. Math. 156, 345-354.
- [3] Homeier H.H.H., (2005), On Newton-type methods with cubic convergence, J. Comput. Appl. Math. 176, 425-432.
- [4] Gautschi W., (1997), Numerical Analysis: An Introduction, Birkhauser, Basel.
- [5] Grau M., Diaz-Barrero J.L., (2006), An improvement of the Euler-Chebyshev iterative method, J. Math. Anal. Appl. 315, 1-7.
- [6] Ozban A.Y., (2004), Some new variants of Newton's method, Appl. Math. Lett. 17, 677-682.
- [7] Weerakoon S., Fernando T.G.I., (2000), A variant of Newton's method with accelerated third-order convergence, Appl. Math. Lett. 13, 87-93.
- [8] Ahdi Aghdam, S. REzapour, R., Ghosi, S., (2010) Newton like Iterative Methods for solving the system of Nonlinear Equations, Journal of Applied Mathematics, 23, 1-10.