

CALCULUL APROXIMATIV AL EXTREMELOR UNEI FUNCȚII*)

DE

F. RADÓ

(Cluj)

Comunicare prezentată la Colocviul de analiză numerică din 8-13 decembrie 1960, Cluj

1. Metoda de calcul aproximativ al extremelor unei funcții de o variabilă reală, dată în această notă, este aplicabilă în cazurile când nu există derivata sau este greoi de a o scrie efectiv.

Presupunem, pentru a fixa ideile, că funcția $f(x)$ are un minim de abscisă x_0 în intervalul $I_0 = [a, b]$, este descrescătoare în $[a, x_0]$ și crescătoare în $[x_0, b]$.

Fie $c, d \in I_0$, $c < d$. Dacă $f(c) < f(d)$, avem $x_0 \in [a, d]$, iar dacă $f(c) \geq f(d)$, avem $x_0 \in [c, b]$. Notăm cu I_1 intervalul $[a, d]$ în primul caz, respectiv intervalul $[c, b]$ în al doilea caz. Intervalul I_1 conține în interiorul său unul din punctele c, d și alegem încă un punct $\xi_1 \in I_1$; astfel intervalul I_1 este împărțit în trei intervale parțiale. Prin același procedeu pe care l-am aplicat mai sus intervalului I_1 , se găsește că x_0 se află într-un interval I_2 , format prin reunirea a două intervale parțiale vecine. Continuând în acest fel obținem un șir de intervale

$$I_0 \supset I_1 \supset I_2 \supset \dots \supset I_n \supset \dots, \quad (1)$$

care toate conțin punctul x_0 .

Se vede ușor că punctele $\xi_n \in I_n$, $n = 1, 2, \dots$, pot fi alese în așa fel ca $I_n \rightarrow 0$. De exemplu, dacă se ia pentru ξ_n mijlocul celui mai mare dintre cele două intervale în care I_n se găsește împărțit, atunci $I_n \rightarrow 0$. Extremitățile intervalului I_n furnizează valori aproximative pentru x_0 prin lipsă și exces.

2. Ne propunem să determinăm punctele c, d și ξ_n astfel ca șirul de intervale (1) să tindă cât mai rapid posibil către zero. Sînt necesare două precizări:

*) Această lucrare se publică și în limba franceză în revista „Mathematica” 3(26), 1961.

a) Punctele c, d și ξ_n nu determină șirul (1); funcția $f(x)$ ne arată care două din cele trei intervale parțiale ale lui I_{n-1} formează intervalul I_n . Ne situăm în ipoteza cea mai defavorabilă pentru rapiditatea convergenței: presupunem că la fiecare pas se lasă la o parte acela dintre cele două intervale parțiale de la margine, care este mai scurt (în caz de egalitate, oricare dintre ele). În această ipoteză, problema noastră devine independentă de funcția $f(x)$.

b) Vom zice că o alegere a punctelor c, d, ξ_n , precum și șirul $\{l_n\}$ al lungimii intervalelor care rezultă din această alegere și ipoteza a) sînt optime, dacă condiția următoare este satisfăcută: pentru orice altă alegere a punctelor c, d, ξ_n și pentru șirul $\{\lambda_n\}$ al lungimilor intervalelor corespunzătoare există un număr natural N_λ , astfel ca $l_n \leq \lambda_n$, pentru $n \geq N_\lambda$.

TEOREMA 1. Există un singur șir optim, care se obține luînd pentru c și d punctele care împart intervalul I_0 în medie și extremă rație $((d-a)^2 = (b-a)(b-d), c-a = b-d)$ și pentru ξ_n simetricul în raport cu mijlocul lui I_n al punctului de diviziune situat în I_n .

Considerăm pentru demonstrație intervalul $I_0 = [0, b]$ și punctele c_0, d_0 , care împart acest interval în medie și extremă rație (fig. 1)

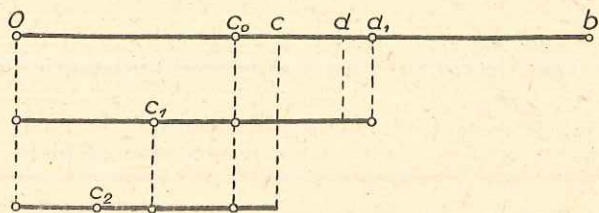


Fig. 1

$$c_0 = \frac{3-\sqrt{5}}{2} b, \quad d_0 = \frac{\sqrt{5}-1}{2} b.$$

Luăm în intervalul $I_1^0 = [0, d_0]$ punctul $c_1 = d_0 - c_0$, care împreună cu c_0 divide pe I_1^0 în medie și extremă rație; păstrăm în continuare intervalul $I_2^0 = [0, c_0]$ în care se mai ia $c_2 = c_0 - c_1$, ș. a. m. d. $l_0 = b, l_1 = d_0, l_2 = c_0, l_3 = c_1, \dots, l_n = \frac{\sqrt{5}-1}{2} l_{n-1}$.

Să considerăm pe de altă parte punctele oarecare c, d, ξ_n , ($c < d$) care determină intervalele I_0, I_1, I_2, \dots de lungimi $\lambda_0 = b, \lambda_1, \lambda_2, \dots$. Distingem două cazuri:

- Dacă $c \notin (c_0, d_0)$ sau $d \notin (c_0, d_0)$ atunci evident $\lambda_1 \geq l_1$.
- Fie acum $c, d \in (c_0, d_0)$. Ajunge să considerăm cazul

$$\frac{c+d}{2} \geq \frac{c_0+d_0}{2},$$

căci putem aplica la nevoie o simetrie în raport cu mijlocul intervalului I_0 . Avem

$$cd = \left(\frac{c+d}{2}\right)^2 - \left(\frac{d-c}{2}\right)^2 > \left(\frac{c_0+d_0}{2}\right)^2 - \left(\frac{d_0-c_0}{2}\right)^2 = c_0 d_0,$$

sau

$$\lambda_1 \lambda_2 > l_1 l_2$$

și

$$\frac{\lambda_1}{l_1} = \frac{d}{d_0} > \frac{\frac{b}{2}}{\frac{\sqrt{5}-1}{2} b} = \frac{\sqrt{5}+1}{4}.$$

Așadar avem în toate cazurile:

$$\lambda_1 > \frac{\sqrt{5}+1}{4} l_1 \quad (2)$$

și

$$\lambda_1 < l_1 \rightarrow \lambda_1 \lambda_2 > l_1 l_2. \quad (3)$$

Notăm

$$\alpha_n = \frac{\lambda_n}{l_n}, \quad n = 0, 1, \dots$$

Aplicînd raționamentul prin care am ajuns la relațiile (2) și (3) intervalului I_n de lungime λ_n în loc de I_0 , obținem că aceste relații rămîn valabile dacă înlocuim pe λ_1 cu λ_n, λ_2 cu λ_{n+1}, l_1 cu $\alpha_{n-1} l_n$ și l_2 cu $\alpha_{n-1} l_{n+1}$

$$\lambda_n > \frac{\sqrt{5}+1}{4} \alpha_{n-1} l_n$$

$$\lambda_n < \alpha_{n-1} l_n \rightarrow \lambda_n \lambda_{n+1} > \alpha_{n-1}^2 l_n l_{n+1}.$$

Deci avem $\alpha_0 = 1$,

$$\alpha_n > \frac{\sqrt{5}+1}{4} \alpha_{n-1} \quad (4)$$

și

$$\alpha_n < \alpha_{n-1} \rightarrow \alpha_n \alpha_{n+1} > \alpha_{n-1}^2. \quad (5)$$

Din (5) se deduce că dacă $\alpha_n < \alpha_{n-1}$, atunci $\alpha_{n+1} > \alpha_{n-1}$. Rezultă că dintre doi termeni consecutivi ai șirului $\{\alpha_n\}$, cel puțin unul este mai mare egal cu oricare termen anterior și

$$\alpha_{n+i} < \alpha_n \rightarrow \alpha_{n+i-1} \geq \alpha_n, \quad \alpha_{n+i+1} > \alpha_n, \quad i = 1, 2, \dots \quad (6)$$

Fie

$$n_1, n_2, \dots, n_k, \dots \quad (7)$$

indicii n pentru care $\alpha_n < 1$. Ținând seamă că $\alpha_0 = 1$, din (6) avem

$$\alpha_{n_1+1} = \theta > 1.$$

Din $\alpha_{n_2} < \theta = \alpha_{n_1+1}$ rezultă $\alpha_{n_2-1} \geq \theta$ și ținând seamă de (5)

$$\alpha_{n_2+1} > \alpha_{n_2-1}^2 \cdot \frac{1}{\alpha_{n_2}} > \theta^2.$$

și în general

$$\alpha_{n_k+1} > \theta^k. \quad (8)$$

Din (6) și $\alpha_{n_k+1} < 1$ deducem $\alpha_{n_k+1-1} > \theta^k$, iar din (4)

$$1 > \alpha_{n_k+1} > \frac{\sqrt{5}+1}{4} \theta^k. \quad (9)$$

Deoarece $\theta^k \rightarrow \infty$, cînd $k \rightarrow \infty$, relația (9) poate fi verificată numai pentru k mai mic decît un număr natural k_0 și astfel șirul (7) conține un număr finit de termeni. Dacă $n > N_k = n_{k_0}$, avem $\alpha_n \geq 1$ și $\lambda_n \geq l_n$. Am demonstrat că șirul $\{l_n\}$ este optim.

Pentru a arăta unicitatea șirului optim, să observăm întîi că dacă șirurile $\{l_n\}$ și $\{\lambda_n\}$ nu coincid, atunci există un indice $n = \nu$ astfel ca $\alpha_\nu \neq 1$; avem $\alpha_\nu > 1$ sau $\alpha_{\nu+1} > 1$, iar din (6) rezultă că pentru o infinitate de indici n , $\alpha_n > 1$ sau $\lambda_n > l_n$.

Să presupunem că și șirul $\{l'_n\}$ este optim și cele două șiruri $\{l_n\}$ și $\{l'_n\}$ nu coincid. Există un număr natural N'_i , astfel ca $n > N'_i$,

$$l'_n \geq l_n;$$

dar pentru o infinitate de indici n avem $l'_n > l_n$. Contradicția la care am ajuns arată unicitatea șirului optim.

3. Procedeu de aproximare de la nr. 1 poate fi aplicat sub următoarea formă modificată:

Presupunem iarăși că funcția $f(x)$ admite minimumul $f(x_0)$ în $I_0 = [a, b]$ și că $f(x)$ descrește în $[a, x_0]$ și crește în $[x_0, b]$. Alegem punctul $c \in (a, b)$ în mod arbitrar, iar punctul d ca abscisa minimumului polinomului de interpolare al funcției $f(x)$ pe nodurile a, b, c

$$d = \frac{1}{2} \frac{(b^2 - c^2)f(a) + (c^2 - a^2)f(b) + (a^2 - b^2)f(c)}{(b-c)f(a) + (c-a)f(b) + (a-b)f(c)}. \quad (10)$$

Determinăm ca la nr 1 intervalul I_1 . Considerăm polinomul de interpolare al funcției $f(x)$ cu nodurile în capetele lui I_1 și în acela dintre punctele c și d care se află în interiorul lui I_1 ; notăm abscisa minimumului acestui polinom de interpolare cu ξ_1 , ș. a. m. d.

Acest procedeu modificat prezintă o analogie cu metoda părților proporționale pentru aflarea rădăcinilor unei ecuații $F(x) = 0$. Dacă $F(x)$ este o funcție convexă sau concavă în intervalul considerat, atunci se știe că rădăcina ecuației este mai mică, respectiv mai mare decît valoarea ei aproximativă aflată prin metoda părților proporționale. Există o proprietate analoagă și în cazul procedurii noastre modificate.

Funcția $f(x)$ este convexă de ordinul 2 în intervalul $[a, b]$, dacă diferența divizată

$$[x_1, x_2, x_3, x_4; f] > 0 \quad (11)$$

pentru nodurile distincte $x_i \in [a, b]$; $i=1, 2, 3, 4$. Fie $L(x_1, x_2, x_3; f|x)$ polinomul de interpolare al funcției $f(x)$ pe nodurile x_1, x_2, x_3 . Condiția (11) este echivalentă cu următoarea proprietate geometrică: pentru $a \leq x_1 < x_2 < x_3 \leq b$

$$L(x_1, x_2, x_3; f|x) < f(x), \quad \text{dacă } x_3 < x \leq b. \quad (12)$$

Din (12) rezultă că diferența $L(x_1, x_2, x_3; f|x) - f(x)$ ia în intervalele (a, x_1) , (x_1, x_2) , (x_2, x_3) și (x_3, b) respectiv semnele $+$, $-$, $+$, $-$ [1]. Dacă $f(x)$ este o funcție derivabilă în $[a, b]$, proprietatea de mai sus subsistă și în cazul cînd două din nodurile x_1, x_2, x_3 se confundă, înțelegînd în acest caz prin L polinomul de interpolare al lui Lagrange-Hermite.

TEOREMA 2. Fie $f(x)$ o funcție convexă de ordinul 2 și odată derivabilă în $[a, b]$ și $a < c < b$, $f(c) < f(a)$, $f(c) < f(b)$. În aceste ipoteze funcția $f(x)$ admite în $[a, b]$ un singur minim de abscisă x_0 și $x_0 \geq d$, unde numărul d este dat de formula (10). Egalitatea $x_0 = d$ este posibilă numai dacă $d = c$.

Existența unui minim este evidentă. Să presupunem că avem două minime în $[a, b]$ de abscise x_0 și x_1 , $x_0 < x_1$. $P(x) = L(x_0, x_0, x_1; f|x)$ trebuie să fie în intervalul (x_0, x_1) deasupra curbei $f(x)$, ceea ce este în contradicție cu faptul că $P(x)$ crește în acest interval. Rezultă că avem un singur minim x_0 în $[a, b]$.

Pentru a demonstra că $x_0 \geq d$, ne folosim de următoarea proprietate elementară a parabolilor P_1 și P_2 , avînd axele paralele cu Oy , cu ramurile infinite îndreptate spre $y > 0$ și care se intersectează în două puncte $A(a', a'')$ și $B(b', b'')$: cea parabolă are minimumul mai apropiat de punctul de intersecție cu ordonata mai mare, care între A și B se situează sub cealaltă. În fig. 2, P_1 se află sub P_2 în (a, b) și $a'' > b''$, deci $m_1 < m_2$, unde m_1, m_2 sînt abscisele minimelor celor două parabol.

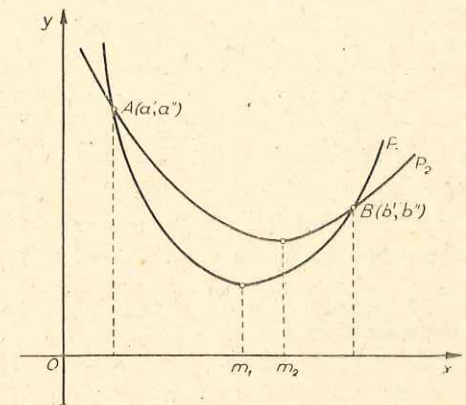


Fig. 2

Să presupunem că punctele a, b, c, d sînt așezate în următoarea ordine : $a < d < c < b$ (fig. 3). Dacă $x_0 \geq c$, teorema 2 are loc, deci putem presupune că $x_0 < c$. Notăm

$$P_1(x) = L(a, c, b; f|x)$$

$$P_2(x) = L(a, x_0, x_0; f|x).$$

În intervalul (x_0, b) avem $P_2(x) < f(x)$, deci $P_2(c) < f(c)$. Dar $f(c) = P_1(c)$, așa dar $P_2(c) - P_1(c) < 0$. Pe de altă parte în (a, c) , $P_1(x) < f(x)$,

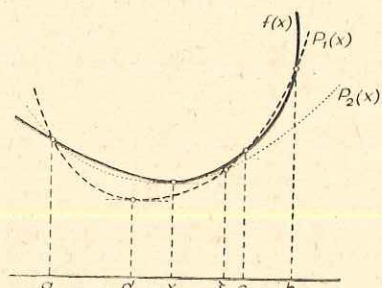


Fig. 3

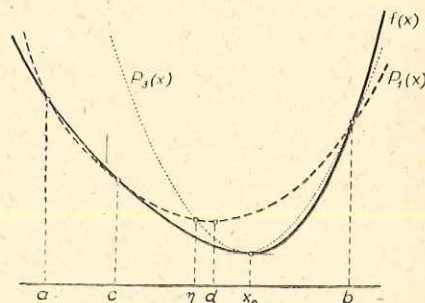


Fig. 4

deci $P_1(x_0) < f(x_0)$ sau $P_2(x_0) - P_1(x_0) > 0$. Rezultă că există un punct $\xi \in (a, c)$ astfel ca $P_1(\xi) = P_2(\xi) < P_1(a) = P_2(a)$. Din proprietatea relativă la cele două parabole rezultă că $d < x_0$.

Să presupunem acum ordinea $a < c < d < b$ (fig. 4). $P_1(x) = L(a, c, b; f|x) > f(x)$ în (c, b) , deci $P_1(d) > f(d)$. Dar $P_1(d) = \min_{a \leq x \leq b} P_1(x)$, deci $f(d) < P_1(c) = f(c)$, $f(d) < f(b)$, de unde rezultă că $c < x_0 < d$. Notăm

$$P_3(x) = L(x_0, x_0, b; f|x).$$

Avem $P_1(c) = f(c) < P_3(c)$ și $P_1(x_0) > f(x_0) = P_3(x_0)$. Deci există η astfel ca $c < \eta < x_0 < b$ și $P_1(\eta) = P_3(\eta) < P_1(b) = P_3(b)$. Rezultă $d < x_0$.

În sfîrșit, dacă $c = d$, ținînd seama că în (a, c) avem $f(x) > L(a, c, b; f|x) > f(c)$, rezultă că în acest caz x_0 nu poate fi situat între a și d și cu aceasta teorema 2 este complet demonstrată.

Observații. 1°. Avem o teoremă analogă pentru funcții concave în $[a, b]$, definite prin $[x_1, x_2, x_3, x_4; f] < 0$. Făcînd pentru o funcție concavă schimbarea de variabilă independentă $x' = \frac{a+b}{2} - x$, funcția f devine convexă și putem aplica teorema 2. Așadar teorema 2 rămîne valabilă dacă schimbăm în ipoteză „funcția convexă” cu „concavă” și în concluzie relația $x_0 \geq d$ în $x_0 \leq d$.

2°. Teorema 2 este utilă în calculul numeric deoarece cu ajutorul ei putem stabili de multe ori, în care din cele trei intervale parțiale ale

lui $[a, b]$ se găsește x_0 și nu mai este nevoie să continuăm calculul cu reunitrea a două intervale parțiale. Această situație se prezintă în următoarele cazuri : 1) ordinea este : $a < c < d < b$; atunci $d < x_0 < b$; 2) ordinea punctelor este $a < d < c < b$ și $f(d) < f(c)$; atunci $d < x_0 < c$.

ПРИБЛИЖЕННОЕ ИСЧИСЛЕНИЕ ЭКСТРЕМУМОВ ФУНКЦИЙ

КРАТКОЕ СОДЕРЖАНИЕ

Дан метод приближенного исчисления экстремумов функции одной вещественной переменной, для случаев когда производная не существует или трудно написать ее эффективно.

Для определенности предполагается, что функция имеет минимум с абсциссой x_0 в интервале $I_0 = [a, b]$, является убывающей в $[a, x_0]$ и возрастающей в $[x_0, b]$. Пусть $c, d \in I_0$, $c < d$. Если $f(c) > f(d)$, имеем $x_0 \in [a, d]$, а если $f(c) \geq f(d)$, имеем $x_0 \in [c, b]$; обозначаем через I_0 интервал $[a, d]$ в первом случае, соответственно интервал $[c, b]$, во втором случае. Интервал I_1 содержит одну из точек c, d и выбираем еще точку $\xi_1 \in I_1$; таким образом I_1 разделен на три частичных интервала. Подобным образом находим, что x_0 находится в интервале I_2 , образованном двумя соседними частичными интервалами. Продолжая так, получаем ряд интервалов

$$I_0 \supset I_1 \supset I_2 \supset \dots \supset I_n \supset \dots, \quad (1)$$

которые все содержат точку x_0 .

Можно легко видеть что точки $\xi_n \in I_n$ могут быть выбраны таким образом, что $I_n \rightarrow 0$. Ставится вопрос выбора точек c, d, ξ_n таким образом, что ряд (1) стремился бы как можно быстрее к нулю в следующем смысле: ряд $l_0, l_1, \dots, l_n, \dots$ длин интервалов называется оптимальным, когда для всякого другого ряда $\lambda_0 = l_0, \lambda_1, \dots, \lambda_n, \dots$ полученного другим выбором точек c, d, ξ_n , можно найти N_λ так, чтобы $l_n \leq \lambda_n$ для $n < N$. В настоящей работе эта задача решена в предположении, что у каждого шага перехода от интервала к другому, из двух краевых частичных интервалов отлагается в сторону более короткий. Решение задачи дано теоремой:

ТЕОРЕМА 1. Существует только один оптимальный ряд, который получается если выбирать для c и d точки, разделяющие интервал I_0 в среднем и краевом отношении $((d-a)^2 = (b-a)(b-d), c-a = b-d)$ и для ξ_n симметричную по середине интервала I_n предшествующей точки деления, лежащей в I_{n-1} .

Описанный способ приближения может быть изменен следующим образом: выбираем $c \in (a, b)$ произвольно, а для d берем абсциссу минимума интерполяционного полинома функции $f(x)$ в узлах a, b, c , данных формулой (10) и поступается аналогично в случае последовательных интервалов I_n .

ТЕОРЕМА 2. Пусть $f(x)$ выпуклая функция 2-ого порядка и дифференцируемая в $[a, b]$ и $a < c < b$, $f(c) < f(a)$, $f(c) < f(b)$. В этих предположениях имеем для абсциссы единственного минимума x_0 функции $f(x)$, $x_0 \geq d$, где d дан формулой (10). Равенство $x_0 = d$ возможно только если $d = c$.

Существует аналогичный результат для вогнутых функций. Теорема 2 полезна, так как она показывает нам во многих случаях, который из трех частичных интервалов содержит x_0 и таким образом нет необходимости продолжения исчислений с объединением двух частичных интервалов.

LE CALCUL APPROXIMATIF DES EXTRÊMES D'UNE FONCTION

RÉSUMÉ

On donne une méthode de calcul approximatif des extrêmes d'une fonction d'une variable réelle pour les cas où la dérivée n'existe pas ou bien lorsqu'il est difficile de l'écrire effectivement.

On suppose, afin de fixer les idées, que la fonction $f(x)$ a un minimum d'abscisse x_0 dans l'intervalle $I_0 = [a, b]$, qu'elle est décroissante dans $[a, x_0]$ et croissante dans $[x_0, b]$. Soit $c, d \in I_0$, $c < d$. Si $f(c) < f(d)$, on a $x_0 \in [a, d]$, et si $f(c) \geq f(d)$, on a $x_0 \in [c, b]$. Notons par I_1 l'intervalle $[a, d]$ dans le premier cas, respectivement l'intervalle $[c, b]$ dans le second cas. L'intervalle I_1 contient dans son intérieur l'un des points c, d , et l'on choisit encore un point $\xi_1 \in I_1$; de cette manière I_1 est divisé en trois intervalles partiels. On trouve que x_0 est situé dans un intervalle I_2 , formé de la réunion de deux intervalles partiels voisins. En continuant ce procédé, on obtient une suite d'intervalles

$$I_0 \supset I_1 \supset I_2 \supset \dots \supset I_n \supset \dots, \quad (1)$$

qui contiennent tous le point x_0 .

On remarque aisément que les points $\xi \in I_n$ peuvent être choisis de telle manière que $I_n \rightarrow 0$. Le problème se pose de choisir les points c, d, ξ_n tels que la suite (1) tende le plus rapidement possible vers zéro dans le sens suivant: la suite $l_0, l_1, \dots, l_n, \dots$ de la longueur des intervalles est dit *optimum* si pour toute autre suite $\lambda = l_0, \lambda_1, \dots, \lambda_n, \dots$ que l'on obtient par un autre choix des points c, d, ξ_n , on peut trouver N_λ tel que $l_n \leq \lambda_n$ pour $n > N$. Dans le travail ce problème a été résolu dans l'hypothèse qu'à chaque pas de passage d'un intervalle à l'intervalle suivant on écarte le plus court des deux intervalles partiels marginaux. La solution du problème est donnée par le:

THÉORÈME 1. Il existe une seule suite optimale, que l'on obtient en prenant pour c et d les points qui divisent l'intervalle I_0 en moyenne et extrême raison $(d-a)^2 = (b-a)(b-d)$, $c-a = b-d$ et pour ξ_n le symétrique par rapport au milieu de I_n du point de division antérieur situé dans I_n .

Le procédé d'approximation décrit peut être modifié de la façon suivante: on choisit $c \in (a, b)$ de manière arbitraire, et pour d on prend l'abscisse du minimum du polynôme d'interpolation de la fonction $f(x)$ sur les noeuds a, b, c , donnée par la formule (10) et on procède de manière analogue avec les intervalles successifs I_n .

THÉORÈME 2. Soit $f(x)$ une fonction convexe de 2-ème ordre et une fois dérivable dans $[a, b]$ et $a < c < b$, $f(c) < f(a)$, $f(c) < f(b)$. Dans ces hypothèses on a pour l'abscisse du seul minimum x_0 de la fonction $f(x)$, $x_0 \geq d$, où d est fourni par la formule (10). L'égalité $x_0 = d$ est possible seulement si $d = c$.

Il existe un résultat analogue pour les fonctions concaves. Le théorème 2 est utile car il indique dans maints cas dans lequel des trois intervalles partiels est situé x_0 , et, par conséquent, il n'est pas nécessaire de continuer le calcul en réunissant deux intervalles partiels.

BIBLIOGRAFIE

1. T. POPOVICIU, Sur quelques propriétés des fonctions d'une ou de deux variables réelles. *Mathematica*, VIII, 1-85 (1934).

Primit la 23. I. 1961