

优选法介绍

(初 稿)

柯 召

四川大学数学系

毛主席语录

路线是个纲，纲举目张。

鼓足干劲，力争上游，多快好省地建设社会主义。

自然科学是人们争取自由的一种武装。
……人们为着要在自然界里得到自由，就要用自然科学来了解自然，克服自然和改造自然，从自然里得到自由。

实践、认识、再实践、再认识，这种形式，循环往复以至无穷，而实践和认识之每一循环的内容，都比较地进到了高一级的程度。

我们不但要提出任务，而且要解决完成任务的方法问题。

目 录

一、前言	(1)
二、单因素	(3)
§1. 0.618 法	(3)
§2. 分数法	(4)
§3. 单峰和对称点	(6)
§4. 0.618 是那里来的?	(7)
§5. F_n 是怎样得来的?	(9)
§6* 最优的单因素优选法	(12)
§7. 平分法	(16)
三、多因素	(18)
§1. 双因素降维法	(18)
§2* 三因素降维法	(19)
§3. 双变数和等高线	(21)
§4. 双因素逐段推进法	(21)
§5. 平行线法	(25)
§6. 平行面法	(27)
§7. 陡度法	(28)
§8. 平行切线法	(29)
§9. 抓主要矛盾	(29)
四、每次可以做几个试验怎么办?	(31)
§1. 问题的提出	(31)
§2. 每次可以做偶数个试验预给次数的安排	(32)
§3. 每次可以做奇数个试验预给次数的安排	(35)
§4. 另一种问题的提出	(38)

§5. 每次可做偶数个试验的比例分割法	(39)
§6. 每次可做奇数个试验的比例分割法	(40)
§7* 广义 F -数	(41)
§8* $I_n^{(b)}$ 的一般公式和留下区间的长度	(44)
§9. b, n 的选择	(46)
五、随机情况	(49)
§1. 单因素随机情况	(49)
§2. 双因素随机情况——调优法	(52)
§3* 三因素调优法	(59)
六、再说几句	(68)
§1. 分数法、黄金分割法和 0.618 法	(68)
§2. 单峰、单谷、多峰、鞍点	(74)
§3. 灵活运用	(78)
§4. 析因试验设计	(84)
§5* 几何规划	(88)
§6. 结束语	(90)

一、前 言

在生产斗争和科学实验中，经常遇到这样的问题：

怎样选取合适的配方、合适的操作条件和制作过程，使产品质量最好，数量最多？

在质量的标准要求下，怎样使生产周期最短，成本最低？

已有的仪器怎样调试，使其性能最好？

也许有人说我们可以做大量的试验，把所有的可能性都做穷尽了，就能找到最好的方案和过程。但是大量的试验需要大量的时间、人力和物力，是少慢差费，而不是多快好省，而且有时还不一定是可能办得到的。比方说：炼某种合金钢，要用某种化学元素来加强其强度。这种元素少了不好，多了也不好。假定已经作出或从理论上算出加入量在 1000 克到 2000 克之间，要求确定最好的加入量是几克？如果从 1001 克，1002 克，……逐一地做下去，一千个试验后才能发现最好的选择，或者说才能找到最好点。这种方法叫做“均分法”。这一方法显然是既浪费精力、时间，又浪费原材料，而且有时还不一定可能。譬如说，在炼钢中除去某元素的含量外，还有一个温度的因素影响。假设有十个选择可能，要用“均分法”找最好的含量和温度，就有

$$1000 \times 10 = 10000,$$

即一万个可能性。如果再加一个时间的因素，假设也有十个可能的选择，就有

$$1000 \times 10 \times 10 = 100000,$$

即十万个可能性了，要全部做完，是不大可能的。

虽然在实际工作中，一般都不是按照“均分法”来安排试验的，但是往往需要经过多次摸索，有较大的盲目性。从实践中总结提高出来的优选法，是在伟大领袖毛主席的哲学思想指导下，利用数学方法，指导我们尽量减少试验次数，达到迅速选择生产斗争和科学实验的最优方案的目的。例如在一个因素时，只要做 19 次就可以代替一万多次试验。对于上面所说的例子，用优选法就会变不大可能完成为可能完成。这是一个符合社会主义建设总路线的科学方法。

优选法在科学实验和生产中应用，已获得成效。北京电子管厂，在生产跃进形势中出现了钼丝严重缺少，当时电子管生产面临停工待料。他们开展了利用“废”钼丝的群众运动。这些钼丝，由于产地、批号、出厂日期不同，每盘钼丝退火温度差异很大，过去一点一点试验，难于找到合适的退火温度，即使终于找到了，但钼丝已在试验中消耗了大部分，收效很小。后来应用优选法做试验，只用几次试验，很快就可以确定每盘钼丝的合适退火温度，分别进行热处理，把过去大量积存的废钼丝复活了，已用废钼丝一百万米，节约资金十万元。上海炼油厂试验添加剂降低润滑油的凝固点。过去半年试验了一百三十七次，凝固点只降到零下 40 度。后来工人群众认真学习毛主席的光辉著作《矛盾论》和《实践论》，用优选法选择化学材料配比，改用国

内资源丰富的廉价材料，两个星期做了八次试验，使凝固点降到零下46度，大大超过以前半年的水平。这样的例子是很多的，在这里就不多说了。

优选法并不神秘，是劳动人民创造的，“**在某种意义上说，最聪明，最有才能的，是最有实践经验的战士。**”有实践经验的劳动人民，一定会很好地掌握这一方法，并能有所发明创造，使这一方法得到进一步的发展。

在应用优选法时，我们一定要遵循毛主席的教导：“**坚持政治挂帅，加强党的领导，大搞群众运动，实行两参一改三结合，大搞技术革新和技术革命。**”

在毛泽东思想的指导下，“优选法”可以作为广大工农兵在生产斗争和科学实验中的一个辅助工具。无论是具体分析问题、抓主要矛盾、确定实验范围的时候，或在实验过程中，还是总结提高时，都离不开战无不胜的毛泽东思想和直接从事生产实践的工人同志们。

优选法必须通过群众运动的方式才能收效。而群众运动能够搞得好，能够持久深入，全靠党的领导。只有在党的领导下，大搞群众运动，才能使优选法在生产斗争和科学实验中起到应有的作用，更好地为社会主义建设服务。

二、单 因 素

§ 1 0.618 法

0.618 法又叫折纸法。我们还是从前面所提到的炼钢中加入某一元素的含量出发,来说明这个方法。

首先,请记住一个数 0.618 (这个数是怎么来的,在 § 4 中将予以说明),并用一个有刻度的纸条来表达试验范围 1000 克~2000 克,如图所示:



在这张纸条长度的 0.618 倍的地方划上一条线,在这条线所标出的刻度处做一试验,即在

$$1000 + (2000 - 1000) \times 0.618 = 1618 \text{ 克}$$

处做一试验,如下图所示:

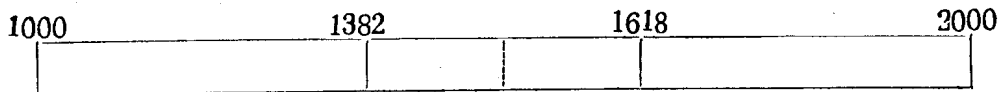


一般的,是在

$$\boxed{\text{头}} + (\boxed{\text{尾}} - \boxed{\text{头}}) \times 0.618$$

处做第一个试验。

然后把纸条对折,在刻线所对到的地方,再划一条线,这条线在 1382 克处,有如下图所示:



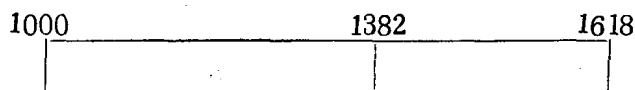
它也可以由对称性得到,即

$$1000 + 2000 - 1618 = 1382 \text{ 克}$$

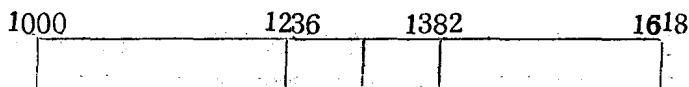
上面的计算启发我们得到一个公式:

$$\boxed{\text{头}} + \boxed{\text{尾}} - \boxed{\text{前一点}} = \boxed{\text{后一点}}$$

再按 1382 克做一次试验。对两次试验进行比较, “有比较才能鉴别。有鉴别, 有斗争, 才能发展。” 如果 1382 克的试验结果较好, 我们在 1618 克处, 把纸条的右边一段剪去, 如下图所示 (如果 1618 克试验较好, 则在 1382 克处剪去左边一段):



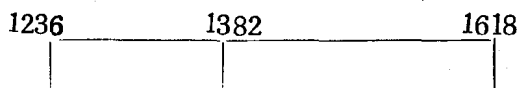
再把这个留下来的纸条对折, 又可划出一条线在 1236 克处, 如下图所示:



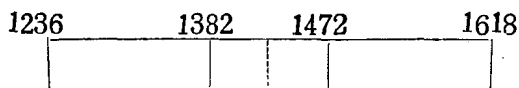
它也可以用前一公式得到:

$$1000 + 1618 - 1382 = 1236 \text{ 克}$$

依 1236 克做试验, 再和 1382 克的试验结果比较, 如果仍然是 1382 克的试验结果较好, 则在 1236 处剪去左边一段, 如下图所示:



再对折, 再做试验, 再比较, 再剪去一段, 如下图:



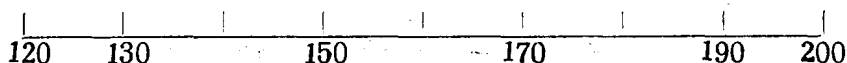
依此类推, 继续做下去, 每次留下好点所在的那一段。这样, 不要几次, 纸条便剪得差不多了, 最优点也就找到了。这个方法叫做 0.618 法。

单因素优选法的整个过程就是先找出试验范围长度的 0.618 倍的地方, 在这点做试验, 依中对折, 找出下一点, 在此点做试验, 比较后剪去一段, 保留好点所在的那一段, 循环往复地进行, 一次比一次更接近所要求的好点, 一直达到预定的精确度。

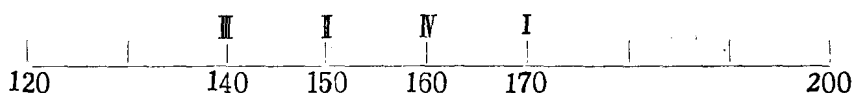
§2 分数法

有时由于各种原因, (例如进行一次试验费用较高或时间较长等等) 只允许做一定个数的试验时, 在试验范围内怎样选取试点最优? 我们先举一个具体例子:

某单位要找一个化学反应的较好温度, 已知在 120°C 时不起反应, 而在 200°C 碳化。按具体条件, 希望做 4 次试验得出结论。开始想按下图:



在 130°C , 150°C , 170°C , 190°C 做 4 个试验, 精度为 $\pm 20^{\circ}\text{C}$. 后来改为如图的安排:



先在 I 处做试验, 对折在 II 处做试验。得出 II 比 I 好, 去掉 $170^{\circ}\text{C} \sim 200^{\circ}\text{C}$ 这一段, 又对折在 III 处做试验, 还是 II 较好。又去掉 $120^{\circ}\text{C} \sim 140^{\circ}\text{C}$ 这一段。再在 IV 处做试验, 仍是 I 好。于是得出温度在 150° 时较好, 精度达到 $\pm 10^{\circ}\text{C}$ 。同样做 4 个试验, 安排不同, 精度提高一倍。

这后一种安排是把试验范围分为 8 等分, 第一试验点选取在全长 $\frac{5}{8}$ 的地方, 用 $\frac{5}{8}$ 代替上节的 0.618, 同上节做法一样, 对折找出一试点做试验, 要求 4 次找到最优点所在的区间其长度 $= \frac{2}{8} \times \text{全长}$ 。

同样, 分试验范围为 13 等分, 从全长的 $\frac{8}{13}$ 处出发, 5 次试验便找到最优点; 所在的区间, 其长度 $= \frac{2}{13} \times \text{全长}$; 分试验范围为 21 等分, 从全长 $\frac{13}{21}$ 出发, 6 次试验便找到最优点所在的区间, 其长度 $= \frac{2}{21} \times \text{全长}$ 等等。这是一种比较实用的分数法。

这些分数是这样构成的: 我们叫

$$\begin{aligned} F_0 &= 1, & F_1 &= 1, & F_2 &= F_0 + F_1 = 1 + 1 = 2, \\ F_3 &= F_2 + F_1 = 2 + 1 = 3, & F_4 &= F_3 + F_2 = 3 + 2 = 5, \\ F_5 &= F_4 + F_3 = 5 + 3 = 8, & F_6 &= F_5 + F_4 = 8 + 5 = 13, \\ F_7 &= F_6 + F_5 = 13 + 8 = 21, & F_8 &= F_7 + F_6 = 21 + 13 = 34, \dots \end{aligned}$$

一般的, 有

$$F_{n+1} = F_n + F_{n-1}, \quad n = 1, 2, 3, 4, \dots$$

这些 F_n 是怎样得出来的, 将在 §5 中给以说明。我们叫这些数为 F 一数。

用 $\frac{F_n}{F_{n+1}}$ 组成分数, 即得上面提到的那些分数:

$$\frac{1}{2}, \frac{2}{3}, \frac{3}{5}, \frac{5}{8}, \frac{8}{13}, \frac{13}{21}, \frac{21}{34}, \dots$$

用数串

$$1, 2, 3, 5, 8, 13, 21, 34, 55, 89, 144, \dots$$

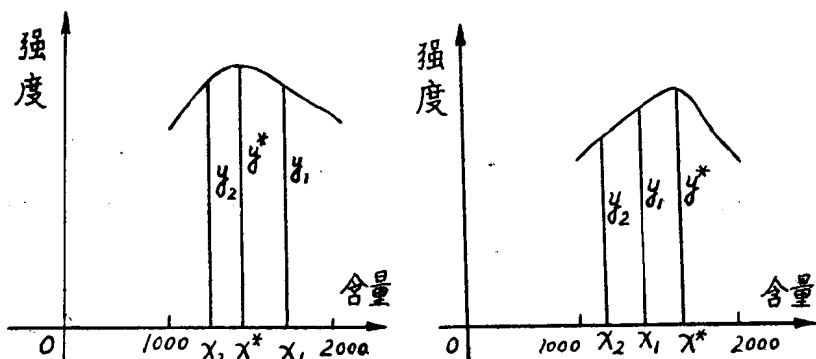
中相邻两个数, 用小的 F_n 做分子, 大的 F_{n+1} 做分母得到的分数 $\frac{F_n}{F_{n+1}}$ 来代替上节中所说的 0.618 这个数, 用对折的方法去做, 就可以在做 n 次试验后使得最后的留下区间长等于 $\frac{2}{F_{n+1}} \times \text{试验范围的长度}$ 。而且在这个留下区间的中点做过一次试验。

故精度为 $\pm \frac{1}{F_{n+1}} \times \text{试验范围的长度}$ 。例如, 取分数 $\frac{89}{144}$ 来确定第一个试点, 则在

做 10 次试验后达到最后留下区间长等于 $\frac{2}{144} \times$ 试验范围的长度, 而且在这个留下区间的中点做过一次试验。如果用均分法就要做 143 次。

§3 单峰和对称点

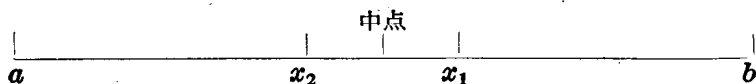
(1) 有人可能要问, 在优选过程中, 最优试验点为什么不会丢掉? 让我们仍旧拿炼钢做例子。通常加进某元素后, 随着含量的增加, 强度会慢慢好起来, 到一定程度后, 又慢慢坏下去, 它可以如图用曲线表示出来:



我们的任务是找最高强度 y^* 所对应的含量最优点 x^* 。很明显, 在 x^* 的左边, 随着含量增加, 强度也增加; 在 x^* 的右边, 随着含量的增加, 强度却减少, 这样的现象, 我们叫做单峰: 图中的曲线, 只是一个示意。对于这个曲线的具体形象我们是不知道的, 如果已经画出了这条曲线, 那末最优点就已经知道, 不必进行优选了。

任取两个含量 x_1 和 x_2 并假定 x_2 在 x_1 的左边。如果 x^* 在 x_1 和 x_2 之间, 则无论去掉 $[1000, x_2]$ 这一段还是 $[x_1, 2000]$ 这一段, x^* 都在留下的线段内。如果 x_1, x_2 都在 x^* 的左边, 那末试验结果必然是 x_1 比 x_2 好, 因此去掉的是 $[1000, x_2]$ 这一段, x^* 也不会去掉。同样的可以讨论 x_1 和 x_2 都在 x^* 的右边时的情况。总之, 最优点是不会丢掉的。

(2) 有人还会问, 用折纸法进行优选, 为什么一定要如图所示选对中点对称的两个试验点进行试验呢?



我们在优选法中是在 $[a, b]$ 线段中选取一点 x_1 做试验后, 再取一点 x_2 做试验, 再进行比较, 那一点较好。现在的问题是: x_1, x_2 取在那里最好? 在还没有做试验前, 那个点好是不知道的。当只做过 x_1 处的试验, x_1 和 x_2 的试验结果那个好还是不知道的, 也即是 x_1 的比 x_2 的好和 x_2 的比 x_1 的好的可能性是相同的。因此, 去掉 $[a, x_2]$ 段和去掉 $[x_1, b]$ 段的可能性是相同的。这便要求这两个线段一样长, 即 x_1 和 x_2 两点对 a, b 的中点是对称的, 叫做对称点, 如果 $[a, x_2]$ 段和 $[x_1, b]$ 段不一样

长。设 $[a, x_2]$ 比 $[x_1, b]$ 段短，试验结果可能去掉 $[a, x_2]$ 这一段，而留下 $[x_2, b]$ 这一段。如图所示，当初就应该把第二个试验点选在 x_1 的对称点 x_2' 那个地方，

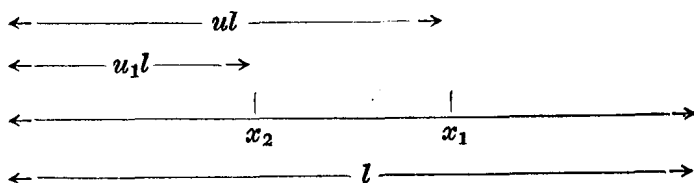


那末不管试验结果去掉 $[x_1, b]$ 段或者是 $[a, x_2']$ 段，留下的那一段都比 $[x_2, b]$ 短。

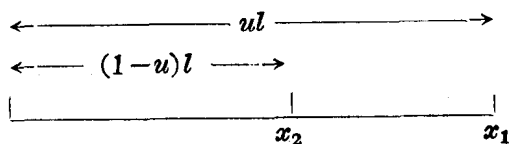
§4 0.618 是那里来的？

为什么要选取试验范围长度的 0.618 倍那一点作为第一个试验点？0.618 是那里来的？现在我们来回答这个问题。

(1) 如图，如果我们选取第一、第二个试验点 x_1, x_2 分别在试验范围长度 l 的 u 倍和 u_1 倍的地方。并假定数 u 是最好的选择。



那末由 §3 的道理，知道 $u_1 l$ 是 ul 的对称点。 ul 的右端的长是 $(1-u)l$ ，所以 $u_1 = 1-u$ 假设在这两点 x_1, x_2 做两个试验后，比较效果的好坏，切去右端，即得下面的图形



现在 x_2 是全长 ul 的第一试验点，也应该在全长 ul 的 u 倍那个地方为最好，所以得出方程：

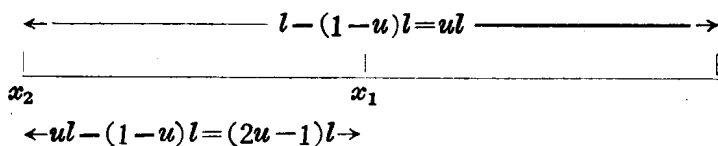
$$u^2 = 1 - u.$$

解出它的正根

$$u = \frac{\sqrt{5} - 1}{2} = 0.618033989 \dots$$

用 u 来选取试点的方法叫做黄金分割法。因为 u 是平面几何学上黄金分割法的比值。取定的四位小数近似值，就是 0.618。

(2) 有人也许要问下面的问题：如果比较 x_1, x_2 两点的试验，在点 x_1 处的试验效果较好，切去左端，得出下图：



如果令 x_2, x_1 两点间的长度为留下全长的 u 倍, 就得

$$u^2 = 2u - 1,$$

得出 $u=1$, 而不是 $\frac{\sqrt{5}-1}{2}$, 这又该怎样解释呢?

这个问题很容易回答。刚才是说 x_1 位于 l 的 u 倍处, 所以切掉右端后, x_2 也应位于新的长度 ul 的 u 倍地方。现在 x_2 是位于长 l 的 $1-u$ 倍处, 所以切掉左端后, x_1 也应位于新的长度 ul 的 $1-u$ 倍处, 由于 x_2, x_1 间的长度为 $2u-1$, 所以

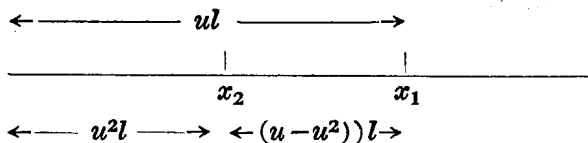
$$2u-1 = (1-u)u,$$

简化这个方程, 仍然得出

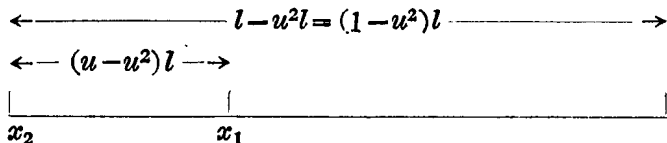
$$u^2 = 1-u.$$

因为你令 $(2u-1)l$ 等于全长 ul 的 u 倍是错误的, 所以得出错误的结果。

(3) 如果我们不用对称点这个关系, 也可以得出 $\frac{\sqrt{5}-1}{2}$ 这个数。如图, 切去右



端时, x_2 位于留下的长度 ul 的 u 倍, 即在 u^2l 的地方。那末 x_2, x_1 间的长度应为 $ul - u^2l = (u-u^2)l$ 。如果比较 x_1, x_2 两点的试验结果时, 在 x_1 点的试验结果较好, 切去左端, 因为我们的方法是对任意的情况来说的, 所以对某一种情形, 会切去右端, 对另一种情形, 会切去左端。我们的方法, 要对这两情形都能适合。得出下面的图形



因为原来 x_2 在全长 l 的 u^2 倍地方, 所以 x_1, x_2 间的长度也应为留下长度 $(1-u^2)l$ 的 u^2 倍, 但 x_1, x_2 间的长度为 $(u-u^2)l$ 所以得出

$$u-u^2 = u^2(1-u^2).$$

即 $u(1-u) = u^2(1-u)(1+u).$

因 u 不能等于 0 或 1, 两即约去 $u(1-u)$, 得出

$$1 = u(1+u),$$

仍然是上面说过的正根为 $\frac{\sqrt{5}-1}{2}$ 的方程:

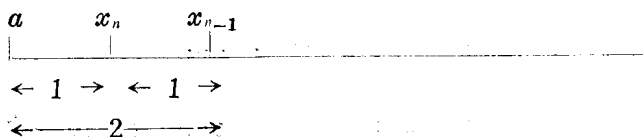
$$u^2 = 1 - u.$$

(4) 我们取 0.618 是 $\frac{\sqrt{5}-1}{2}$ 的四位小数近似值。根据实际需要, 也可以取 0.6, 0.62 或比 0.618 更精确的近似值 0.61803, 0.618034, 等等。但是位数取多了, 计算起来不方便, 取小了, 准确度又差一些, 所以一般以取四位小数近似值 0.618 较好。这就是 0.618 的由来。

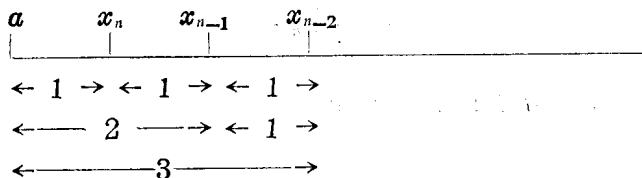
§5 F_n 是怎样得来的?

在分数法中, 我们用到数 F_n . 现在要问这些数是怎样得来的?

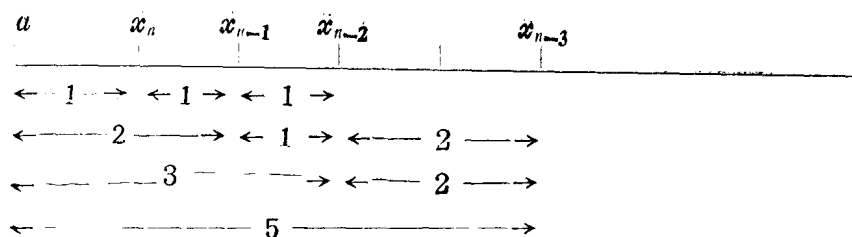
(1) 为说明起来方便一些, 设想每次切去的部份都在试点右端。做了 n 个试验。把第 n 次试点 x_n 放在离 a 点长为 1 所在的地方, 第 $n-1$ 次试点 x_{n-1} 放在离 a 点长为 2 所在的地方把试点的次序倒转过来进行分析。如图:



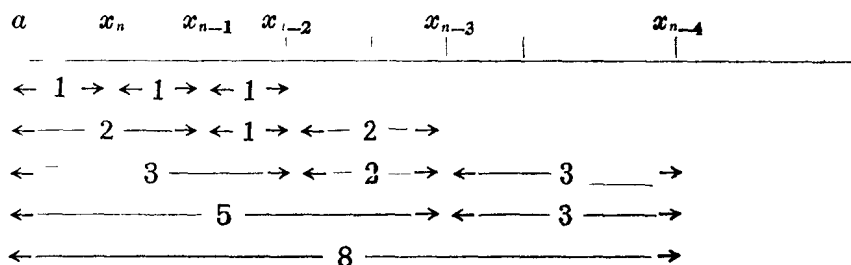
因为在做完第 n 次和第 $n-1$ 次试验后, 切去的是 x_{n-1} 的右端, 应用对称点的道理, 在 x_{n-1} 右端切去的长等于 ax_n 的长, 即等于 1. 所以第 $n-2$ 次试点一定在离 a 点长为 3 的地方, 如图:



在做完第 $n-1$ 次和第 $n-2$ 次试验后, 切去的 x_{n-2} 右端部份的长度要等于 ax_{n-1} 的长 2, 所以第 $n-3$ 次试点一定在离 a 点长为 5 的地方, 得出下图:



在做完第 $n-2$ 次和第 $n-3$ 次试验后，切去的 x_{n-3} 右端部分长度要等于 ax_{n-2} 的长度 3，所以第 $n-4$ 次试点是在离 a 点长为 8 的地方，有如下图所示：



照这样子，继续做下去，就得出一串数

$$1, 1, 2, 3, 5, 8, 13, 21, \dots$$

从上图可以看得很清楚，由第三个数开始它们每一个数都是前面两个数的和。如叫 $F_0 = F_1 = 1$ ，就会有：

$$F_{n+1} = F_n + F_{n-1}, \quad n = 1, 2, 3, 4 \dots$$

(2)* [註] 我们从 $\frac{\sqrt{5}-1}{2}$ ，也可以得出这些数 F_n 来。因为 $\frac{\sqrt{5}-1}{2}$ 满足方程

$$u^2 = 1 - u,$$

即得

$$u = \frac{1}{1+u}. \quad (1)$$

把 u 的式子代入上式右节分母中的 u ，得出：

$$u = \frac{1}{1 + \frac{1}{1+u}}. \quad (2)$$

[註] 以后凡是遇到如有 * 号的章节段落，可以略去不看，这对于阅读其他章节，并无妨碍。

再把 (1) 式代入 (2) 式右节中的 u , 得出:

$$u = \frac{1}{1 + \frac{1}{1 + \frac{1}{1 + u}}}$$

如此继续做下去, 我们得出 u 的一个连分数展开式:

$$u = \frac{1}{1 + \frac{1}{1 + \frac{1}{1 + \frac{1}{1 + \frac{1}{1 + \dots}}}}}$$

如果切去分母中第一个加号的后面部分, 就得出 1; 如果切去分母中第二个加号的后面部分, 就得出 $\frac{1}{2}$; 切去第三个加号的后面部分, 得出 $\frac{2}{3}$; 切去第四个加号的后面部分, 得出 $\frac{3}{5}$; 依此类推, 我们得出一串分数:

$$1, \frac{1}{2}, \frac{2}{3}, \frac{3}{5}, \frac{5}{8}, \frac{8}{13}, \frac{13}{21}, \frac{21}{34}, \dots$$

它们正好就是 $\frac{F_n}{F_{n+1}}$, $n=0, 1, 2, 3, \dots$, 都是 $\frac{\sqrt{5}-1}{2}$ 的渐近分数。

(3)* 我们还可以用归纳法证明:

$$F_n = \frac{1}{\sqrt{5}} \left\{ \left(\frac{1+\sqrt{5}}{2} \right)^{n+1} - \left(\frac{1-\sqrt{5}}{2} \right)^{n+1} \right\}. \quad (3)$$

因为 $n=0$ 时

$$F_0 = \frac{1}{\sqrt{5}} \left\{ \frac{1+\sqrt{5}}{2} - \frac{1-\sqrt{5}}{2} \right\} = 1,$$

在 $n=1$ 时,

$$\begin{aligned} F_1 &= \frac{1}{\sqrt{5}} \left\{ \left(\frac{1+\sqrt{5}}{2} \right)^2 - \left(\frac{1-\sqrt{5}}{2} \right)^2 \right\} \\ &= \frac{1}{\sqrt{5}} \left\{ \frac{6+2\sqrt{5}}{4} - \frac{6-2\sqrt{5}}{4} \right\} = 1, \end{aligned}$$

所以 (1) 式对于 $n=0$ 和 1 是成立的。假设 (3) 式对于 $n=k-1$ 和 $k-2$ 是成立的。

现在来证明 (3) 式对 $n=k$ 能够成立, 因而 (3) 式对于任意 n 都是成立的。因为已知

$$F_k = F_{k-1} + F_{k-2}$$

故知:

$$\begin{aligned} F_k &= \frac{1}{\sqrt{5}} \left\{ \left(\frac{1+\sqrt{5}}{2} \right)^k - \left(\frac{1-\sqrt{5}}{2} \right)^k \right\} + \frac{1}{\sqrt{5}} \left\{ \left(\frac{1+\sqrt{5}}{2} \right)^{k-1} - \left(\frac{1-\sqrt{5}}{2} \right)^{k-1} \right\} \\ &= \frac{1}{\sqrt{5}} \left\{ \left(\frac{1+\sqrt{5}}{2} \right)^{k-1} \left(\frac{1+\sqrt{5}}{2} + 1 \right) - \left(\frac{1-\sqrt{5}}{2} \right)^{k-1} \left(\frac{1-\sqrt{5}}{2} + 1 \right) \right\} \\ &= \frac{1}{\sqrt{5}} \left\{ \left(\frac{1+\sqrt{5}}{2} \right)^{k-1} \left(\frac{6+2\sqrt{5}}{4} \right) - \left(\frac{1-\sqrt{5}}{2} \right)^{k-1} \left(\frac{6-2\sqrt{5}}{4} \right) \right\} \\ &= \frac{1}{\sqrt{5}} \left\{ \left(\frac{1+\sqrt{5}}{2} \right)^{k-1} \left(\frac{1+\sqrt{5}}{2} \right)^2 - \left(\frac{1-\sqrt{5}}{2} \right)^{k-1} \left(\frac{1-\sqrt{5}}{2} \right)^2 \right\} \\ &= \frac{1}{\sqrt{5}} \left\{ \left(\frac{1+\sqrt{5}}{2} \right)^{k+1} - \left(\frac{1-\sqrt{5}}{2} \right)^{k+1} \right\}. \end{aligned}$$

这就证明了 (3) 式, 它是 F_n 的一般表示式。

同时我们也很容易得出

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{F_n}{F_{n+1}} = u = \frac{\sqrt{5}-1}{2}. \quad (4)$$

因为

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{F_n}{F_{n+1}} = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{F_n}{F_n + F_{n-1}} = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{1 + \frac{F_{n-1}}{F_n}}.$$

但

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{F_n}{F_{n+1}} = \lim_{n \rightarrow \infty} \frac{F_{n-1}}{F_n}.$$

叫它做 u , 就得出

$$u = \frac{1}{1+u},$$

这就是 (1) 式, 所以 (4) 式是成立的。

§ 6* 最优的单因素优选法

在单因素的情形下, 我们已经介绍了两个优选方法, 一个是分数法, 一个是黄金分割法。现在我们来证明, 在事先给定试验次数时对任意函数来说, 用分数法来优选最好。

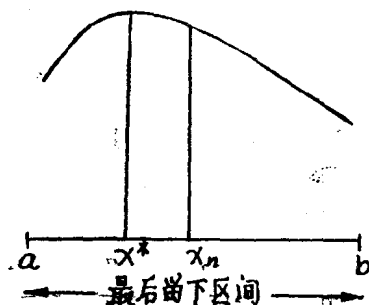
先来说明一下“最好”的意义。

如图，在最后留下的区间中包含着所求的最优点 x^* 和已做过试验的最优试点 x_n 。我们用符号 d 表示最优点和最优点间的最大可能距离，即

$d = x^*$ 和 x_n 的最大可能距离。

因为 x_n 是知道的， x^* 是不知道的。在图上， x^* 可以落在 ab 中的任何一点，所以 d 是 ax_n 和 x_nb 这两段中较长一段的长度。

设开始的试验范围的长度为 l ，叫



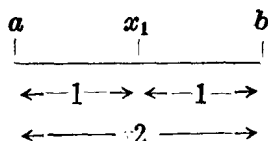
$$\text{精确度} = \frac{d}{l}.$$

在给定的试验次数为 n 时，我们说优选法 A 比优选法 B 好，是指对于同一个长为 l 试验范围，对于任意单峰函数来说，用 A 去优选经过 n 次试验后所得出的精确度 R_A 比用 B 去优选在试验次数不超过 n 时所得出的精确度 R_B 要好一些，亦即 $R_A < R_B$ 。如果我们固定 d 的数值，假设用优选法 A 去优选，经过 n 次试验后，可以使最大的试验范围达到 l_A ，而用优选法 B 去优选，在试验次数不超过 n 时可以使最大的试验范围达到 l_B ，那末在 $l_A > l_B$ 时，我们说优选法 A 比 B 好，因为在此时， $\frac{d}{l_A} < \frac{d}{l_B}$ 。这是一个问题的两种说法，实质上是完全一样的。现在用后一种说法来证明本节开头所提出的结论，就是说要证明用分数法做 n 次试验来优选，比用任何其他方法来优选而试验次数不超过 n 时，所达到的最大试验范围都要大一些。

为简便计，固定 $d=1$ 。用归纳法来证明：

由 §2 知，分数法作 n 次试验后的精度 $d = \frac{1}{F_{n+1}} \times \text{试验范围长度}$ ，若固定 $d=1$ ，则试验范围 $l_n = F_{n+1}$ 。

在 $n=1$ 时， $l_1 = F_2 = 2$ ，试点在中点，如下图：



反之，当 $l_1=2$ 时，试点除在中点处外，偏左偏右都将有 $d>1$ 。如果 $l_1>2$ ，那末把 x_1 放在 ab 线段的任何一点，显然都会使 $\frac{d}{l_1} > \frac{1}{2}$ 。

在 $n=2$ 时， $l_2 = F_3 = 3$ ，试点位置如图：