

Utilisation de méthodes de type Lanczos dans la bibliothèque MODULAD

J L Vaudescal

I N R I A

Domaine de Voluceau

78153 le Chesnay CEDEX France

email octobre@goofy.inria.fr

Résumé :

Cet article se propose d'indiquer aux utilisateurs de la bibliothèque MODULAD, l'existence des méthodes de calcul spectral de type Lanczos.

Ces méthodes sont très efficaces quand une faible partie du spectre est recherchée, ce qui est le cas dans beaucoup d'applications en analyse des données. Des comparaisons avec l'algorithme QR sont effectuées.

Mots Clés :

Problème aux valeurs propres, Méthodes de Lanczos, Méthode QR.