# Sisteme liniare - metode directe

Radu T. Trîmbiţaş

13 martie 2022

## 1 Eliminare gaussiană

Să considerăm sistemul liniar cu $n$ ecuaţii şi $n$ necunoscute

$$Ax = b, \tag{1}$$

unde $A \in \mathbb{K}^{n\times n}$, $b \in \mathbb{K}^{n\times 1}$ sunt date, iar $x \in \mathbb{K}^{n\times 1}$ trebuie determinat, sau scris pe componente

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \cdots + a_{1n}x_n = b_1 & (E_1) \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \cdots + a_{2n}x_n = b_2 & (E_2) \\ \vdots & \vdots \\ a_{n1}x_1 + a_{n2}x_2 + \cdots + a_{nn}x_n = b_n & (E_n) \end{cases} \tag{2}$$

### 1.1 Eliminare gaussiană cu pivotare parţială

Metoda este dată de algoritmul 1.

### 1.2 Eliminare gaussiană cu pivot scalat pe coloană

O tehnică care micşorează eroarea şi preîntâmpină anularea flotantă este *pivotarea parţială cu pivot scalat pe coloană*. Definim la început un factor de scară pentru fiecare linie

$$s_i = \max_{j=\overline{1,n}} |a_{ij}| \text{ or } s_i = \sum_{j=1}^{n} |a_{ij}|.$$

**Algoritmul 1** Rezolvă sistemul $Ax = b$ prin metoda eliminării a lui Gauss

**Intrare:** Matricea extinsă $A = (a_{ij}),\ i = \overline{1,n},\ j = \overline{1,n+1}$

**Ieşire:** Soluţiile $x_1, \ldots, x_n$ sau un mesaj de eroare

{Eliminare}

1: **for** $i := 1$ **to** $n-1$ **do**
2: Fie $p$ cel mai mic întreg $i \leq p \leq n$ , $a_{p_i} \neq 0$ şi $|a_{pi}| = \max_{i \leq j \leq n} |a_{ji}|$
3: **if** $\nexists\, p$ **then**
4: mesaj ('$\nexists$ soluţie unică'); STOP
5: **end if**
6: **if** $p \neq i$ **then**
7: $(E_p) \leftrightarrow (E_i)$
8: **end if**
9: **for** $j := i+1$ **to** $n$ **do**
10: $m_{ji} := a_{ji}/a_{ii}$;
11: $(E_j - m_{ji}E_i) \rightarrow (E_j)$;
12: **end for**
13: **end for**
14: **if** $a_{mn} = 0$ **then**
15: mesaj ('$\nexists$ soluţie unică'); STOP
16: **end if**

{Substituţie inversă}

17: $x_n := a_{n,n+1}/a_{nn}$;
18: **for** $i := n-1$ **downto** 1 **do**
19: $$x_i = \left[ a_{i,n+1} - \sum_{j=i+1}^{n} a_{ij}x_j \right] / a_{ii};$$
20: **end for**
21: Returnează $(x_1, \ldots, x_n)$ {succes} STOP.

Dacă există un $i$ a.î. $s_i = 0$, matricea este singulară. Paşii următori vor stabili interschimbările care se vor face. La al $i$-lea pas vom găsi cel mai mic întreg $p$, $i \leq p \leq n$, a.î.

$$\frac{|a_{pi}|}{s_p} = \max_{i \leq j \leq n} \frac{|a_{ji}|}{s_j}$$

şi apoi, $(E_i) \leftrightarrow (E_p)$. Scalarea ne garantează că cel mai mare element din fiecare coloană are înainte de comparaţiile necesare pentru schimbare mărimea relativă 1. Scalarea se realizează doar în comparaţii, nu efectiv în matrice, astfel că împărţirea cu factorul de scalare nu produce nici o eroare de rotunjire.

# 2 Descompunere (factorizare) LUP

Ideea din spatele descompunerii LUP este de a găsi 3 matrice pătratice de ordinul $n$ $L, U$ şi $P$ astfel încât

$$PA = LU \tag{3}$$

unde

- L este o matrice triunghiulară inferior;
- U este o matrice triunghiulară superior;
- P este o matrice de permutare.

Tripletul (L,U,P) se va numi **descompunere LUP** a matricei A. Orice matrice nesingulară posedă o astfel de descompunere.

Sistemul

$$Ax = b \tag{4}$$

se poate rezolva astfel

$$Ax = b \Longleftrightarrow LUx = Pb \Longleftrightarrow Ly = Pb \wedge Ux = y, \tag{5}$$

deoarece

$$Ax = P^{-1}LUx = P^{-1}Ly = P^{-1}Pb = b. \tag{6}$$

Având descompunerea LUP sistemul se poate rezolva cu algoritmul 2.

**Algoritmul 2** Rezolvă sistemul $Ax = b$ având descompunerea LUP

**Intrare:** Matricele $L$, $U$, vectorul $b$, vectorul de permutare $\pi$, toate de dimensiune $n$

**Ieşire:** Soluţiile $x_1, \ldots, x_n$

1: **for** $i := 1$ **to** $n$ **do**

2: $\quad y_i := b_{\pi[i]} - \sum_{j=1}^{i-1} l_{ij} y_j$;

3: **end for**

4: **for** $i := n$ **downto** 1 **do**

5: $\quad x_i = \left[ y_i - \sum_{j=i+1}^{n} u_{ij} x_j \right] / u_{ii}$;

6: **end for**

**Observaţie.** Am presupus că matricea P este reprezentată prin vectorul $\pi$.

Procedura care urmează (algoritmul 3) calculează descompunerea LUP. Ea reprezintă $P$ ca un vector $\pi$, iar $L$ şi $U$ sunt calculate în locul lui $A$, adică la terminare

$$a_{ij} = \begin{cases} l_{ij}, \text{ pentru } i > j, \\ u_{ij}, \text{ pentru } i \geq j. \end{cases}$$

**Algoritmul 3** Descompunere LUP

**Intrare:** Matricea $A$, de dimensiune $m$

**Ieşire:** Matricele $L$, $U$ şi $P$, toate de dimensiune $m$

$p = 1 : m$;
**for** $k := 1$ **to** $m - 1$ **do**
{Pivotare}
Alege $i \geq k$ care maximizeaza $|u_{ik}|$;
$A_{k,:} \leftrightarrow A_{i,:}$; {interschimbare}
$p_k \leftrightarrow p_i$;
$lin := i + 1 : m$;
{Calculez complementul Schur}
$A_{lin,k} := A_{lin,k} / A_{k,k}$;
$A_{lin,lin} := A_{lin,lin} - A_{lin,k} A_{k,lin}$;
**end for**
Extrage $L$, $U$, generează $P$;

**Exemplu.** Să se calculeze descompunerea LUP a matricei

```
A =
    2.0000  0       2.0000  0.6000
    3.0000  3.0000  4.0000 -2.0000
    5.0000  5.0000  4.0000  2.0000
   -1.0000 -2.0000  3.4000 -1.0000
```

Calculele decurg astfel

```
>> [l,u,p]=lup(A)
```

interschimb liniile 1 şi 3

```
A =

    5.0000  5.0000  4.0000  2.0000
    3.0000  3.0000  4.0000 -2.0000
    2.0000  0       2.0000  0.6000
   -1.0000 -2.0000  3.4000 -1.0000
```

calculez complementul Schur

```
A =
    5.0000  5.0000  4.0000  2.0000
    0.6000  3.0000  4.0000 -2.0000
    0.4000  0       2.0000  0.6000
   -0.2000 -2.0000  3.4000 -1.0000

A =
    5.0000  5.0000  4.0000  2.0000
    0.6000  0       1.6000 -3.2000
    0.4000 -2.0000  0.4000 -0.2000
   -0.2000 -1.0000  4.2000 -0.6000
```

interschimb liniile 2 şi 3

```
A =
   5.0000  5.0000 4.0000  2.0000
   0.4000 -2.0000 0.4000 -0.2000
   0.6000  0      1.6000 -3.2000
  -0.2000 -1.0000 4.2000 -0.6000
```

calculez complementul Schur

```
A =
    5.0000  5.0000 4.0000  2.0000
    0.4000 -2.0000 0.4000 -0.2000
    0.6000  0      1.6000 -3.2000
   -0.2000  0.5000 4.2000 -0.6000

A =
    5.0000  5.0000 4.0000  2.0000
    0.4000 -2.0000 0.4000 -0.2000
    0.6000  0      1.6000 -3.2000
   -0.2000  0.5000 4.0000 -0.5000
```

interschimb liniile 3 şi 4

```
A =
    5.0000  5.0000 4.0000  2.0000
    0.4000 -2.0000 0.4000 -0.2000
   -0.2000  0.5000 4.0000 -0.5000
    0.6000  0      1.6000 -3.2000
```

calculez complementul Schur

```
A =
    5.0000  5.0000 4.0000  2.0000
    0.4000 -2.0000 0.4000 -0.2000
   -0.2000  0.5000 4.0000 -0.5000
    0.6000  0      0.4000 -3.2000

A =
    5.0000  5.0000 4.0000  2.0000
```

```
    0.4000 -2.0000 0.4000 -0.2000
   -0.2000  0.5000 4.0000 -0.5000
    0.6000  0      0.4000 -3.0000
```

Rezultatele finale sunt

```
l =
    1.0000 0      0      0
    0.4000 1.0000 0      0
   -0.2000 0.5000 1.0000 0
    0.6000 0      0.4000 1.0000

u =
    5.0000  5.0000 4.0000  2.0000
    0      -2.0000 0.4000 -0.2000
    0       0      4.0000 -0.5000
    0       0      0      -3.0000
p =
    0 0 1 0
    1 0 0 0
    0 0 0 1
    0 1 0 0
```

verificare:

```
>> disp(l*u)

    5.0000  5.0000  4.0000  2.0000
    2.0000  0.0000  2.0000  0.6000
   -1.0000 -2.0000  3.4000 -1.0000
    3.0000  3.0000  4.0000 -2.0000

>> disp(p*A)

    5.0000  5.0000  4.0000  2.0000
    2.0000  0.0000  2.0000  0.6000
   -1.0000 -2.0000  3.4000 -1.0000
    3.0000  3.0000  4.0000 -2.0000
```

# 3 Descompunere (factorizare) Cholesky

O matrice hermitiană şi pozitiv definită se poate factoriza sub forma $A = LL^*$ sau $A = R^*R$, unde $L$ este o matrice triunghiulară inferior, iar $R$ este triunghiulară superior.

Pentru algoritm a se vedea notele de curs sau algoritmul 4.

**Algoritmul 4** Descompunere Cholesky

**Intrare:** Matricea $A$, hermitiană şi pozitiv definită
**Ieşire:** Matricea $R$, triunghiulară superior

$R := A$;
**for** $k := 1$ **to** $m$ **do**
  **for** $j := k + 1$ **to** $m$ **do**
    $R_{j,j:m} := R_{j,j:m} - R_{k,j:m}\overline{R_{k,j}}/R_{k,k}$
  **end for**
  $R_{k,k:m} := R_{k,k:m}/\sqrt{R_{k,k}}$
**end for**

# 4 Probleme

**Problema 1** *Implementaţi eliminarea gaussiană cu pivotare parţială sau scalată pe coloană (la alegere) în MATLAB.*

**Problema 2** *Să se implementeze descompunerea LUP. Să se scrie rutine pentru rezolvarea unui sistem folosind descompunerea LUP.*

**Problema 3** *Generaţi sisteme cu matrice aleatoare nesingulare ce au soluţia* $[1, \ldots, 1]^T$. *Rezolvaţi-le cu eliminare gaussiană şi descompunere LUP.*

**Problema 4** *Să se scrie rutine pentru descompunerea Cholesky a unei matrice hermitiene şi pozitiv definite şi rezolvarea unui sistem cu o astfel de matrice prin descompunere Cholesky. Testaţi rutinele pentru matrice generate aleator şi sisteme cu matrice aleatoare, dar cu soluţie cunoscută.*

**Problema 5** *Rezolvaţi sistemul*

$$\begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 & & \dots & 1 \\ -1 & 1 & 0 & & \dots & 1 \\ -1 & -1 & 1 & & \dots & 1 \\ -1 & -1 & -1 & 1 & \dots & 1 \\ \vdots & & \ddots & & \ddots & \vdots \\ -1 & \dots & -1 & -1 & & 1 \end{bmatrix} x = \begin{bmatrix} 2 \\ 1 \\ 0 \\ -1 \\ \vdots \\ -n+2 \end{bmatrix}$$

*prin descompunere LUP şi QR. Ce se observă? Explicaţi.*

# 5 Probleme suplimentare

**Problema 6** *Scrieţi rutine pentru descompunerea LUP in care permutarea sa se facă fizic şi logic (cu vectori de permutări) şi comparaţi timpii de execuţie al ambelor variante pentru sisteme cu dimensiunea între 100 şi 300.*