

# Calcul numeric

## Valori și vectori proprii

Paul Irofti  
Andrei Pătrașcu  
Cristian Rusu

Departmentul de Informatică  
Facultatea de Matematică și Informatică  
Universitatea din București  
Email: `prenume.nume@fmi.unibuc.ro`



- ▶ Motivație
- ▶ Definiții
- ▶ Descompunerea valorilor proprii (general și simetric)
- ▶ Calculul valorilor proprii
- ▶ Exemple
- ▶ Comparatie cazul general vs. cazul simetric
- ▶ Algoritmul Hessenberg + iterații
- ▶ Algoritmul QR



- ▶ Ecuații diferențiale
- ▶ Modele biologice/medicale
- ▶ Grafuri
- ▶ Machine learning (reducere dimensională)
- ▶ Modele Markov
- ▶ Mecanica cuantică (matrix mechanics)
- ▶ Transformări geometrice
- ▶ multe altele ...



- ▶ Ecuatii diferențiale
- ▶ Modele biologice/medicale
- ▶ Grafuri
- ▶ Machine learning (reducere dimensională)
- ▶ Modele Markov
- ▶ Mecanica cuantică (matrix mechanics)
- ▶ Transformări geometrice
- ▶ multe altele ...



# Definiții: valori și vectori proprii

- ▶ avem o matrice pătrată  $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{n \times n}$
- ▶ atunci  $\lambda \in \mathbb{C}$  este o valoare proprie a lui  $\mathbf{A}$  dacă

$$p(\lambda) = \det(\lambda \mathbf{I} - \mathbf{A}) = 0$$

- ▶  $p(\lambda)$  se numește polinomul caracteristic a lui  $\mathbf{A}$
- ▶ avem și  $\mathbf{v} \in \mathbb{C}^n$  care se numește vector propriu și pentru care

$$\mathbf{A}\mathbf{v} = \lambda\mathbf{v}$$



# Definiții valori și vectori proprii

- ▶ avem o matrice **pătrată**  $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{n \times n}$
- ▶ atunci  $\lambda \in \mathbb{C}$  este o valoare proprie a lui  $\mathbf{A}$  dacă

$$p(\lambda) = \det(\lambda \mathbf{I} - \mathbf{A}) = 0$$

- ▶  $p(\lambda)$  se numește polinomul caracteristic a lui  $\mathbf{A}$
- ▶ avem și  $\mathbf{v} \in \mathbb{C}^n$  care se numește vector propriu și pentru care

$$\mathbf{A}\mathbf{v} = \lambda\mathbf{v}$$

de ce trebuie  $\mathbf{A}$  să fie pătrată?



# Definiții: valori și vectori proprii

- ▶ avem o matrice pătrată  $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{n \times n}$
- ▶ atunci  $\lambda \in \mathbb{C}$  este o valoare proprie a lui  $\mathbf{A}$  dacă

$$p(\lambda) = \det(\lambda \mathbf{I} - \mathbf{A}) = 0$$

- ▶  $p(\lambda)$  se numește polinomul caracteristic a lui  $\mathbf{A}$
- ▶ avem și  $\mathbf{v} \in \mathbb{C}^n$  care se numește vector propriu și pentru care

$$\mathbf{A}\mathbf{v} = \lambda\mathbf{v}$$

chiar dacă  $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{n \times n}$  totuși avem  $\lambda \in \mathbb{C}$  și  $\mathbf{v} \in \mathbb{C}^n$  (poate chiar  $\mathbf{A} \in \mathbb{C}^{n \times n}$  dar noi nu ne ocupăm de acest caz)

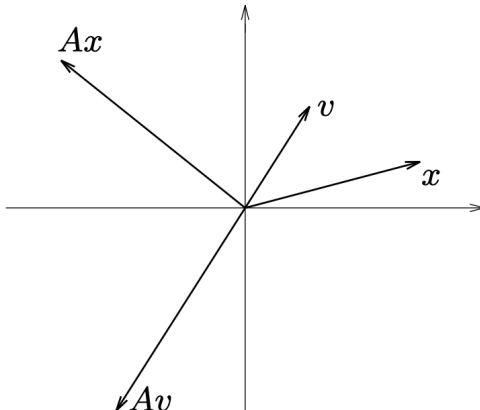


# Interpretare valori și vectori proprii

- ▶ relația următoare ne spune că matricea **A** se comportă ca un număr în anumite situații

$$\mathbf{A}\mathbf{v} = \lambda\mathbf{v}$$

- ▶ putem interpreta rezultatul în următorul fel:





# Descompunerea valorilor proprii (cazul general)

Pentru  $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{n \times n}$ .

Dacă avem  $\mathbf{A}\mathbf{v}_i = \lambda_i\mathbf{v}_i$  pentru  $i = 1, \dots, n$  atunci avem defapt

$$\mathbf{A} \begin{bmatrix} \mathbf{v}_1 & \mathbf{v}_2 & \dots & \mathbf{v}_n \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \mathbf{v}_1 & \mathbf{v}_2 & \dots & \mathbf{v}_n \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \lambda_1 & & & \\ & \lambda_2 & & \\ & & \ddots & \\ & & & \lambda_n \end{bmatrix}$$

adică

$$\mathbf{A}\mathbf{V} = \mathbf{V}\mathbf{D} \text{ sau } \mathbf{A} = \mathbf{V}\mathbf{D}\mathbf{V}^{-1}.$$



# Descompunerea valorilor proprii (cazul simetric)

Pentru  $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{n \times n}$  și  $\mathbf{A} = \mathbf{A}^T$ .

Dacă avem  $\mathbf{A}\mathbf{v}_i = \lambda_i\mathbf{v}_i$  pentru  $i = 1, \dots, n$  atunci avem defapt

$$\mathbf{A} \begin{bmatrix} \mathbf{v}_1 & \mathbf{v}_2 & \dots & \mathbf{v}_n \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \mathbf{v}_1 & \mathbf{v}_2 & \dots & \mathbf{v}_n \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \lambda_1 & & & \\ & \lambda_2 & & \\ & & \ddots & \\ & & & \lambda_n \end{bmatrix}$$

adică

$$\mathbf{A}\mathbf{V} = \mathbf{V}\mathbf{D} \text{ sau } \mathbf{A} = \mathbf{V}\mathbf{D}\mathbf{V}^T.$$

(adică,  $\mathbf{V}^{-1} = \mathbf{V}^T$ )



# Descompunerea valorilor proprii (cazul simetric)

Pentru  $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{n \times n}$  și  $\mathbf{A} = \mathbf{A}^T$ .

Dacă avem  $\mathbf{A}\mathbf{v}_i = \lambda_i\mathbf{v}_i$  pentru  $i = 1, \dots, n$  atunci avem defapt

$$\mathbf{A} \begin{bmatrix} \mathbf{v}_1 & \mathbf{v}_2 & \dots & \mathbf{v}_n \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \mathbf{v}_1 & \mathbf{v}_2 & \dots & \mathbf{v}_n \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \lambda_1 & & & \\ & \lambda_2 & & \\ & & \ddots & \\ & & & \lambda_n \end{bmatrix}$$

adică

$$\mathbf{A}\mathbf{V} = \mathbf{V}\mathbf{D} \text{ sau } \mathbf{A} = \mathbf{V}\mathbf{D}\mathbf{V}^T.$$

(adică,  $\mathbf{V}^{-1} = \mathbf{V}^T \Rightarrow \mathbf{V}$  este orthonormală:  $\mathbf{V}\mathbf{V}^T = \mathbf{V}^T\mathbf{V} = \mathbf{I}_n$ )



# Calcul valori și vectori proprii

Algoritmul (uman) pentru calcul:

- ▶ Pasul 1: calculăm polinomul caracteristic  $p(\lambda)$
- ▶ Pasul 2: rezolvăm ecuația  $p(\lambda) = 0$
- ▶ Pasul 3: pentru fiecare  $\lambda$  calculăm vectorul propriu  $\mathbf{A}\mathbf{v} = \lambda\mathbf{v}$



# Exemplu calcul valori și vectori proprii

- ▶ se dă matricea

$$\mathbf{A} = \begin{bmatrix} 2 & 1 \\ 1 & 2 \end{bmatrix}$$

- ▶ Pasul 1: calculăm polinomul caracteristic

$$p(\lambda) = \det(\lambda \mathbf{I}_2 - \mathbf{A}) = \det \left( \begin{bmatrix} \lambda - 2 & -1 \\ -1 & \lambda - 2 \end{bmatrix} \right) = \lambda^2 - 4\lambda + 3$$

- ▶ Pasul 2: rezolvăm ecuația

$$p(\lambda) = 0 \longrightarrow \lambda^2 - 4\lambda + 3 = 0 \longrightarrow (\lambda - 1)(\lambda - 3) = 0$$

- ▶ Pasul 3: pentru fiecare  $\lambda$  calculăm vectorul propriu



## Exemplu calcul valori și vectori proprii (continuare)

- ▶ Pasul 3: pentru fiecare  $\lambda$  calculăm vectorul propriu
- ▶ pentru  $\lambda_1 = 1$ :

$$\mathbf{A}\mathbf{v}_1 = \mathbf{v}_1 \longrightarrow (\mathbf{I}_2 - \mathbf{A})\mathbf{v}_1 = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix} \longrightarrow \begin{bmatrix} 1 & -1 \\ -1 & 1 \end{bmatrix} \mathbf{v}_1 = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix} \longrightarrow \mathbf{v}_1 = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix}$$

- ▶ pentru  $\lambda_2 = 3$

$$\mathbf{A}\mathbf{v}_2 = 3\mathbf{v}_2 \longrightarrow (3\mathbf{I}_2 - \mathbf{A})\mathbf{v}_2 = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix} \longrightarrow \begin{bmatrix} -1 & -1 \\ -1 & -1 \end{bmatrix} \mathbf{v}_2 = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix} \longrightarrow \mathbf{v}_2 = \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \end{bmatrix}$$



## Exemplu calcul valori și vectori proprii (continuare)

► concluzia, matricea  $\mathbf{A} = \begin{bmatrix} 2 & 1 \\ 1 & 2 \end{bmatrix}$  are valori/vectori proprii:

$$\lambda_1 = 1, \mathbf{v}_1 = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix} \text{ și } \lambda_2 = 3, \mathbf{v}_2 = \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \end{bmatrix}$$



## Exemplu calcul valori și vectori proprii (continuare)

► concluzia, matricea  $\mathbf{A} = \begin{bmatrix} 2 & 1 \\ 1 & 2 \end{bmatrix}$  are valori/vectori proprii:

$$\lambda_1 = 1, \mathbf{v}_1 = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix} \text{ și } \lambda_2 = 3, \mathbf{v}_2 = \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \end{bmatrix}$$

► și putem verifica că  $\mathbf{A} = \mathbf{V}\mathbf{D}\mathbf{V}^T$  (pentru că  $\mathbf{A}$  este simetrică).

$$\mathbf{V}^T \mathbf{A} \mathbf{V} = \begin{bmatrix} 1 & -1 \\ 1 & 1 \end{bmatrix} \mathbf{A} \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ -1 & 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 2 & 0 \\ 0 & 6 \end{bmatrix}$$

de ce nu e bine?





## Exemplu calcul valori și vectori proprii (continuare)

- concluzia, matricea  $\mathbf{A} = \begin{bmatrix} 2 & 1 \\ 1 & 2 \end{bmatrix}$  are valori/vectori proprii:

$$\lambda_1 = 1, \mathbf{v}_1 = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix} \text{ și } \lambda_2 = 3, \mathbf{v}_2 = \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \end{bmatrix}$$

- și putem verifica că  $\mathbf{A} = \mathbf{V}\mathbf{D}\mathbf{V}^T$  (pentru că  $\mathbf{A}$  este simetrică).

$$\mathbf{V}^T \mathbf{A} \mathbf{V} = \begin{bmatrix} 1 & -1 \\ 1 & 1 \end{bmatrix} \mathbf{A} \begin{bmatrix} 1 & 1 \\ -1 & 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 2 & 0 \\ 0 & 6 \end{bmatrix}$$

de ce nu e bine? pentru că  $\mathbf{V}\mathbf{V}^T = 2\mathbf{I}_2$  și noi avem nevoie de  $\mathbf{V}\mathbf{V}^T = \mathbf{I}_2$



## Exemplu calcul valori și vectori proprii (continuare)

► concluzia, matricea  $\mathbf{A} = \begin{bmatrix} 2 & 1 \\ 1 & 2 \end{bmatrix}$  are valori/vectori proprii:

$$\lambda_1 = 1, \mathbf{v}_1 = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix} \text{ și } \lambda_2 = 3, \mathbf{v}_2 = \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \end{bmatrix}$$

► și putem verifica că  $\mathbf{A} = \mathbf{VDV}^T$  (pentru că  $\mathbf{A}$  este simetrică).

$$\left( \frac{1}{\sqrt{2}} \mathbf{v}^T \right) \mathbf{A} \left( \frac{1}{\sqrt{2}} \mathbf{v} \right) = \begin{bmatrix} \frac{1}{\sqrt{2}} & -\frac{1}{\sqrt{2}} \\ \frac{1}{\sqrt{2}} & \frac{1}{\sqrt{2}} \end{bmatrix} \mathbf{A} \begin{bmatrix} \frac{1}{\sqrt{2}} & \frac{1}{\sqrt{2}} \\ -\frac{1}{\sqrt{2}} & \frac{1}{\sqrt{2}} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 3 \end{bmatrix}$$

acum e bine



# Calcul valori și vectori proprii

Algoritmul (uman) pentru calcul:

- ▶ Pasul 1: calculăm polinomul caracteristic  $p(\lambda)$
- ▶ Pasul 2: rezolvăm ecuația  $p(\lambda) = 0$
- ▶ Pasul 3: pentru fiecare  $\lambda$  calculăm vectorul propriu  $\mathbf{A}\mathbf{v} = \lambda\mathbf{v}$

Acest algoritm se poate implementa eficient pe un calculator?



# Calcul valori și vectori proprii

Algoritmul (uman) pentru calcul:

- ▶ Pasul 1: calculăm polinomul caracteristic  $p(\lambda)$
- ▶ Pasul 2: rezolvăm ecuația  $p(\lambda) = 0$
- ▶ Pasul 3: pentru fiecare  $\lambda$  calculăm vectorul propriu  $\mathbf{A}\mathbf{v} = \lambda\mathbf{v}$

Pasul 1: trebuie să calculăm determinant de o matrice  $n \times n$  Câte elemente sunt în suma determinantului? Pentru  $n = 2, n = 3$ ?



# Calcul valori și vectori proprii

Algoritmul (uman) pentru calcul:

- ▶ Pasul 1: calculăm polinomul caracteristic  $p(\lambda)$
- ▶ Pasul 2: rezolvăm ecuația  $p(\lambda) = 0$
- ▶ Pasul 3: pentru fiecare  $\lambda$  calculăm vectorul propriu  $\mathbf{A}\mathbf{v} = \lambda\mathbf{v}$

Pasul 1: trebuie să calculăm determinant de o matrice  $n \times n$  Câte elemente sunt în suma determinantului? În general  $n!$  ( $n$  factorial)



# Calcul valori și vectori proprii

Algoritmul (uman) pentru calcul:

- ▶ Pasul 1: calculăm polinomul caracteristic  $p(\lambda)$
- ▶ Pasul 2: rezolvăm ecuația  $p(\lambda) = 0$
- ▶ Pasul 3: pentru fiecare  $\lambda$  calculăm vectorul propriu  $\mathbf{Av} = \lambda\mathbf{v}$

Pasul 2: cum rezolvăm o ecuație de grad  $n$ ?



# Calcul valori și vectori proprii

Algoritmul (uman) pentru calcul:

- ▶ Pasul 1: calculăm polinomul caracteristic  $p(\lambda)$
- ▶ Pasul 2: rezolvăm ecuația  $p(\lambda) = 0$
- ▶ Pasul 3: pentru fiecare  $\lambda$  calculăm vectorul propriu  $\mathbf{Av} = \lambda\mathbf{v}$

Pasul 2: cum rezolvăm o ecuație de grad  $n$ ? Avem formule doar pentru  $n < 5$ , pentru  $n \geq 5$  doar algoritmi aproximativi.



# Calcul valori și vectori proprii

Algoritmul (uman) pentru calcul:

- ▶ Pasul 1: calculăm polinomul caracteristic  $p(\lambda)$
- ▶ Pasul 2: rezolvăm ecuația  $p(\lambda) = 0$
- ▶ Pasul 3: pentru fiecare  $\lambda$  calculăm vectorul propriu  $\mathbf{A}\mathbf{v} = \lambda\mathbf{v}$

Algoritmul pentru calcul:

- ▶ rapid, preferabil:  $O(n^3)$  adică la fel de complicat ca CMMP, nu vrem nimic combinatorial
- ▶ răspuns aproximativ: vom avea ceva eroare cu siguranță (teorie Galois-Abel din matematică abstractă)
- ▶ nu vrem să rezolvăm  $n$  sisteme de ecuații  $O(n^4)$





# Calcul valori și vectori proprii

- ▶ algoritmul uman este foarte bun pentru matrice  $2 \times 2$  sau  $3 \times 3$  dar îngrozitor pentru cazul general
- ▶ algoritmul numeric este complet diferit față de algoritmul uman
- ▶ defapt, algoritmul numeric este atât de eficient încât logica va fi inversată: când vrem rădăcinile unui polinom vom rezolva o problemă de valori/vectori proprii. exemplu: dacă vrem să rezolvăm  $\lambda^4 + 2\lambda^3 + 3\lambda^2 + 4\lambda + 5 = 0$  atunci vrem valorile proprii ale matricei:

$$\mathbf{A} = \begin{bmatrix} 0 & 0 & 0 & -5 \\ 1 & 0 & 0 & -4 \\ 0 & 1 & 0 & -3 \\ 0 & 0 & 1 & -2 \end{bmatrix}$$



# Calcul valori și vectori proprii (când lucrurile nu merg bine)

Exemplul anterior a fost simplu, dar ce se întâmplă când

$$\mathbf{A} = \begin{bmatrix} 3 & 1 \\ 0 & 3 \end{bmatrix}$$

- ▶ polinomul caracteristic este  $p(\lambda) = (\lambda - 3)^2$  deci  $\lambda_{1,2} = 3$
- ▶ vectori proprii?  $(3\mathbf{I}_2 - \mathbf{A})\mathbf{v}_1 = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 0 & -1 \\ 0 & 0 \end{bmatrix} \mathbf{v}_1 = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix}$
- ▶ deci cum arată  $\mathbf{v}$ ?



# Calcul valori și vectori proprii (când lucrurile nu merg bine)

Exemplul anterior a fost simplu, dar ce se întâmplă când

$$\mathbf{A} = \begin{bmatrix} 3 & 1 \\ 0 & 3 \end{bmatrix}$$

- ▶ polinomul caracteristic este  $p(\lambda) = (\lambda - 3)^2$  deci  $\lambda_{1,2} = 3$
- ▶ vectori proprii?  $(3\mathbf{I}_2 - \mathbf{A})\mathbf{v}_1 = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix} \rightarrow \begin{bmatrix} 0 & -1 \\ 0 & 0 \end{bmatrix} \mathbf{v}_1 = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \end{bmatrix}$
- ▶ deci cum arată  $\mathbf{v}$ ?  $\mathbf{v} = \begin{bmatrix} a \\ 0 \end{bmatrix}, a \in \mathbf{R}$
- ▶ problema: matricea  $\mathbf{A}$  este defectă, adică are un singur vector propriu (nu doi)



# Calcul valori și vectori proprii (comparație)

	cazul general	cazul simetric
<b>A</b> defect?	da, se poate	nu, nu se poate matrice simetrice nu sunt defecte
valori proprii	$\lambda \in \mathbb{C}$	$\lambda \in \mathbb{R}$
vectori proprii	se poate să nu existe toți	există toți și sunt ortogonali
descompunerea	$\mathbf{A} = \mathbf{VDV}^{-1}$	$\mathbf{A} = \mathbf{VDV}^T$
algoritmul	algoritmul QR	Hessenberg + iterații
complexitate	$\frac{50}{3}n^3$	$6n^3$



# Algoritmul Hessenberg + iterații (cazul simetric)

Un algoritm conceptual simplu, dar eficient:

- ▶ folosind transformări Hessenberg, aducem matricea simetrică la formă tri-diagonală
- ▶ începem un proces iterativ (teoretic infinit) care reduce forma tri-diagonală la formă diagonală (folosind rotații Givens)



# Algoritmul Hessenberg + iterații (cazul simetric)

$$\text{Fie } \mathbf{A} = \begin{bmatrix} 4 & 1 & -2 & 2 \\ 1 & 2 & 0 & 1 \\ -2 & 0 & 3 & -2 \\ 2 & 1 & -2 & -1 \end{bmatrix}$$

$$\text{► Primul pas: folosim matricea } \mathbf{Q}_1 = \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & -1/3 & 2/3 & -2/3 \\ 0 & 2/3 & 2/3 & 1/3 \\ 0 & -2/3 & 1/3 & 2/3 \end{bmatrix}$$

$$\text{► avem: } \mathbf{A}_2 = \mathbf{Q}_1 \mathbf{A} \mathbf{Q}_1^T = \begin{bmatrix} 4 & -3 & 0 & 0 \\ -3 & 10/3 & 1 & 4/3 \\ 0 & 1 & 5/3 & -4/3 \\ 0 & 4/3 & -4/3 & -1 \end{bmatrix}$$



# Algoritmul Hessenberg + iterații (cazul simetric)

▶ Al doile pas: folosim matricea  $\mathbf{Q}_2 =$

$$\begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & -3/5 & -4/5 \\ 0 & 0 & -4/5 & 3/5 \end{bmatrix}$$

▶ avem:  $\mathbf{A}_3 = \mathbf{Q}_2 \mathbf{A}_2 \mathbf{Q}_2^T =$

$$\begin{bmatrix} 4 & -3 & 0 & 0 \\ -3 & 10/3 & -5/3 & 0 \\ 0 & -5/3 & -33/25 & 68/75 \\ 0 & 0 & 68/75 & 149/75 \end{bmatrix}$$

- ▶ această matrice are doar 3 diagonale diferite de zero
- ▶ pornind de la  $\mathbf{A}_3$  începe un proces iterativ pentru a reduce matricea la diagonală
- ▶ avem că  $\mathbf{A}_3 = \mathbf{Q}_2 \mathbf{Q}_1 \mathbf{A} \mathbf{Q}_1^T \mathbf{Q}_2^T$  iar  $\mathbf{A}_\infty$  va fi diagonal



# Algoritmul QR (cazul general)

- ▶ considerat unul dintre cei mai importanți algoritmi ai ultimului secol
- ▶ este complet iterativ
- ▶ folosește descompunerea QR (au același nume, dar sunt două proceduri diferite: algoritmul QR și descompunerea QR)
- ▶ calculează  $\mathbf{A} = \mathbf{U}\mathbf{T}\mathbf{U}^H$  unde  $\mathbf{T}$  este o matrice superior triunghiulară complexă iar  $H$  înseamnă simetric și complex conjugat
- ▶  $\mathbf{T}$  conține de diagonală blocuri Jordan (care conțin valori proprii în perechi complex conjugate)





# Algoritmul QR (cazul general)

---

## Algorithm 1: Algoritmul QR

---

**Data:**  $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{n \times n}$  astfel încât  $\mathbf{A} = \mathbf{U}\mathbf{T}\mathbf{U}^H$

**Result:**  $\mathbf{T} \in \mathbb{C}^{n \times n}$  superior triunghiular,  $\mathbf{U} \in \mathbb{C}^{n \times n}$  unitar  
(adică orthogonal și complex  $\mathbf{U}\mathbf{U}^H = \mathbf{U}^H\mathbf{U} = \mathbf{I}_n$ )

- ▶ Inițializează  $\mathbf{A}_0 \leftarrow \mathbf{A}$ ,  $\mathbf{U}_0 \leftarrow \mathbf{I}_n$
- ▶ Pentru  $i = 1, \dots, \infty$ :
  - ▶ descompunerea QR:  $\mathbf{Q}_i, \mathbf{R}_i = \text{QR}(\mathbf{A}_{i-1})$
  - ▶  $\mathbf{A}_i \leftarrow \mathbf{R}_i\mathbf{Q}_i$
  - ▶  $\mathbf{U}_i \leftarrow \mathbf{U}_{i-1}\mathbf{Q}_i$
- ▶ Returnează  $\mathbf{T} = \mathbf{A}_\infty$  și  $\mathbf{U} = \mathbf{U}_\infty$

---

Observați că:

$$\begin{aligned}\mathbf{A}_i &= \mathbf{Q}_i^H \mathbf{A}_{i-1} \mathbf{Q}_i = \mathbf{Q}_i^H \mathbf{Q}_{i-1}^H \mathbf{A}_{i-2} \mathbf{Q}_{i-1} \mathbf{Q}_i \\ &= \mathbf{Q}_i^H \mathbf{Q}_{i-1}^H \dots \mathbf{Q}_1^H \mathbf{A}_0 \mathbf{Q}_1 \dots \mathbf{Q}_{i-1} \mathbf{Q}_i \\ &= \mathbf{U}_i^H \mathbf{A} \mathbf{U}_i\end{aligned}$$



- ▶ e greu să calculăm eficient și corect valori/vectori proprii
- ▶ multe complicații (numere complexe, vectori nu există, etc.)
- ▶ dificultățile sunt fundamentale și vin din matematică abstractă
- ▶ bibliotecile actuale au implementări eficiente: codul sursă are sute de mii de linii de cod
- ▶ Algorimul QR și algoritmul Hessenberg + iterații
- ▶ multe aplicații, vedem câteva la seminar

