ZÁPOČTOVÝ PROJEKT 1

Le Xuan My

$$\|A\|_2 := \max_{v \in \mathbb{R}^n} \frac{\|Av\|_2}{\|v\|_2} = \max_{\sigma \text{ je singulární číslo } A} \sigma$$

$$Ax = b$$

$\varkappa(A) := \|A\|_2 \, \|A^{-1}\|_2$ číslo podmíněnosti

$$\begin{pmatrix} \varepsilon & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$$

A1 : $\varepsilon \approx 1$

$$A_\theta = \begin{pmatrix} 1+\theta & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}, \quad \varepsilon = 1+\theta \approx 1, \quad \theta \approx 0, \quad \theta \geq 0$$

a) $\varkappa(A_\theta) = \|A\|_2 \, \|A^{-1}\|_2 = \dfrac{\lambda_{max}}{\lambda_{min}}$, $\lambda_{max}, \lambda_{min}$ MAX a MIN vl. čísla A

pro A symetrické, poz. definitní

$$A^T = \begin{pmatrix} 1+\theta & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} = A \qquad \text{symetrická} \quad \checkmark$$

$$\det(A - \lambda E) = \det \begin{pmatrix} 1+\theta-\lambda & 1 \\ 1 & 1-\lambda \end{pmatrix} = (1+\theta-\lambda)(1-\lambda) - 1 =$$

$$= \cancel{1} - \lambda + \theta - \theta\lambda - \lambda + \lambda^2 \cancel{-1} = \lambda^2 - 2\lambda - \theta\lambda + \theta =$$

$$= \lambda^2 + (-2-\theta)\lambda + \theta = 0$$

$$D = (2+\theta)^2 - 4\theta = 4 + 4\theta + \theta^2 - 4\theta = \theta^2 + 4$$

$$\lambda = \frac{2+\theta \pm \sqrt{\theta^2+4}}{2}$$

pozitivní definitnost $\Leftrightarrow$ znaménka vl. čísel

$$\left.\begin{aligned} &\text{MIN} \quad \lambda_1 = \tfrac{1}{2}\left(2+\theta - \sqrt{\theta^2+4}\right) > 0 \\ &\text{MAX} \quad \lambda_2 = \tfrac{1}{2}\left(2+\theta + \sqrt{\theta^2+4}\right) > 0 \end{aligned}\right\} \Rightarrow \text{PD} \quad \checkmark$$

$$\varkappa(A_0) = \frac{\lambda_{max}}{\lambda_{min}} = \frac{\cancel{\frac{1}{2}}}{\cancel{\frac{1}{2}}} \; \frac{2+\theta-\sqrt{\theta^2+4}}{2+\theta+\sqrt{\theta^2+4}} =$$

$$= \frac{2+\theta}{2+\theta} \; \frac{1-\frac{\sqrt{\theta^2+4}}{2+\theta}}{1+\frac{\sqrt{\theta^2+4}}{2+\theta}} =$$

pro θ malinké : $\sqrt{\theta^2+4} = 2\sqrt{1+\frac{\theta^4}{4}} = 2\left(1+\frac{1}{2}\cdot\frac{\theta^2}{4}+\mathcal{O}(\theta^4)\right)$

$$\varkappa(A_0) = \left(\frac{2+\theta-\left(2+\frac{\theta^2}{4}\right)+\mathcal{O}(\theta^4)}{2+\theta+\left(2+\frac{\theta^2}{4}\right)+\mathcal{O}(\theta^4)}\right)^{-1} \approx \left(\frac{\theta-\frac{\theta^2}{4}}{4+\theta+\frac{\theta^2}{4}}\right)^{-1} = \underline{\underline{\frac{16+4\theta+\theta^2}{4\theta-\theta^2}}}$$

b) $\begin{pmatrix} \varepsilon & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$

$$x_1 = \frac{\det A_{\theta 1}}{\det A_\theta} = 0 \quad , \quad x_2 = \frac{\det A_{\theta 2}}{\det A_\theta} = 1$$

$$\det A_{\theta 1} = \begin{vmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 1 \end{vmatrix} = 0 \qquad \det A_{\theta 2} = \begin{vmatrix} \varepsilon & 1 \\ 1 & 1 \end{vmatrix} = \varepsilon - 1$$

$$\det A_\theta = \begin{vmatrix} \varepsilon & 1 \\ 1 & 1 \end{vmatrix} = \varepsilon - 1$$

c) $\begin{pmatrix} \varepsilon & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} = b + \begin{pmatrix} \alpha \\ \beta \end{pmatrix} = \underbrace{\begin{pmatrix} 1+\alpha \\ 1+\beta \end{pmatrix}}_{:=\tilde{b}}$

$$\det A_{\theta 1} = \begin{vmatrix} 1+\alpha & 1 \\ 1+\beta & 1 \end{vmatrix} = 1+\alpha-1-\beta = \alpha-\beta$$

$$\det A_{\theta 2} = \begin{vmatrix} \varepsilon & 1+\alpha \\ 1 & 1+\beta \end{vmatrix} = \varepsilon+\varepsilon\beta-1-\alpha = 1+\theta+\beta+\theta\beta-1-\alpha =$$
$$= \theta+\beta+\theta\beta-\alpha$$

$$\det A_\theta = \begin{vmatrix} \varepsilon & 1 \\ 1 & 1 \end{vmatrix} = \varepsilon - 1 = 1+\theta-1 = \theta$$

$$x_1 = \frac{\alpha-\beta}{\theta} \qquad x_2 = 1+\beta-\frac{\alpha-\beta}{\theta}$$

d) $x = \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \end{pmatrix}$, $\tilde{x} = \begin{pmatrix} \frac{\alpha-\beta}{\theta} \\ 1+\beta-\frac{\alpha-\beta}{\theta} \end{pmatrix} = x + \begin{pmatrix} \frac{\alpha-\beta}{\theta} \\ \beta-\frac{\alpha-\beta}{\theta} \end{pmatrix}$

$A_\theta x = b$

$$A_\theta \tilde{x} = \tilde{b} = b + \begin{pmatrix}\alpha\\ \beta\end{pmatrix} = A_\theta x + \begin{pmatrix}\alpha\\ \beta\end{pmatrix} \Rightarrow \tilde{x} = x + A_\theta^{-1}\begin{pmatrix}\alpha\\ \beta\end{pmatrix}$$

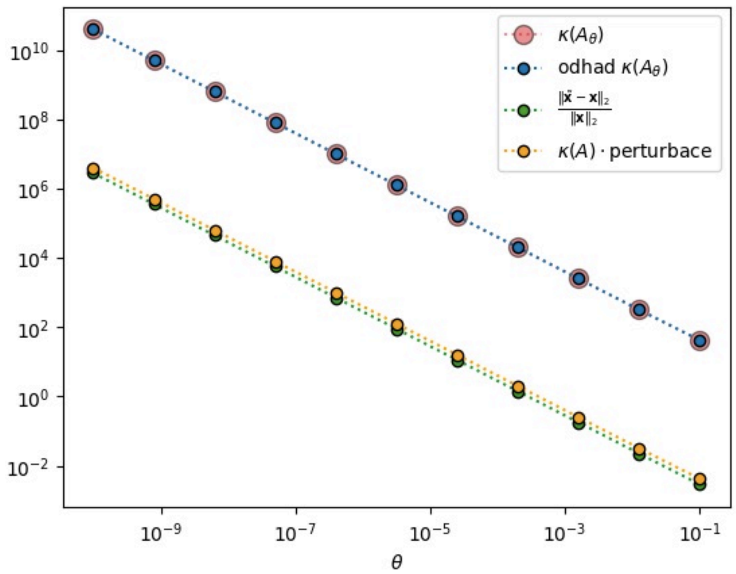
$$A_\theta^{-1} = \begin{pmatrix}1+\theta & 1\\ 1 & 1\end{pmatrix}^{-1} = \frac{1}{\theta}\begin{pmatrix}1 & -1\\ -1 & 1+\theta\end{pmatrix}$$

Tedy celkově $\underline{\underline{\tilde{x} = x + \frac{1}{\theta}\begin{pmatrix}1 & -1\\ -1 & 1+\theta\end{pmatrix}\begin{pmatrix}\alpha\\ \beta\end{pmatrix}}}$.

POZNÁMKY KE KÓDU:

$$\frac{\|\Delta x\|}{\|x\|} \leq \underbrace{\|A\|\,\|A^{-1}\|}_{\varkappa(A_\theta)} \frac{\|\Delta b\|}{\|b\|}$$

$$\Delta x = \tilde{x} - x, \quad \Delta b = \tilde{b} - b = \begin{pmatrix}\alpha\\ \beta\end{pmatrix}$$



- „více" singulární matice A_θ (tzn. menší θ)
  $\Rightarrow$ větší číslo podmíněnosti $\Rightarrow$ větší rel. chyba řešení
- závislosti jsou lineární
- graficky jsme ověřili teorii lineární závislosti $\frac{\|\Delta x\|}{\|x\|} \leq \varkappa(A_\theta) \frac{\|\Delta b\|}{\|b\|}$
  (žlutý ● graf nad zeleným ●)

A1: případ $\theta \to 0$ (ZÚ) pro $\theta \to 0$ označme $A_\theta \equiv A_0$

a) $\varkappa(A_0) = \lim_{\theta \to 0+} \varkappa(A_\theta) = \lim_{\theta \to 0+} \frac{16 + 4\theta + \theta^2}{4\theta - \theta^2} = \text{"}\frac{16}{0+}\text{"} = \underline{\underline{+\infty}}$

b) $\underbrace{\begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}}_{A_0} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} = \underbrace{\begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}}_{b}$

A_0 je singulární $\Rightarrow$ $\nexists\ A_0^{-1}$ $\Rightarrow$ $\varkappa(A_0) = \|A\|\,\|A^{-1}\|$ nelze spočítat „klasicky".

Z a) víme, že $\varkappa(A_0) = \infty$ $\Rightarrow$ problém je extrémně špatně podmíněný; malé změny b mohou znamenat velkou rel. chybu řešení (nebo řešení $\nexists$?)

Řešíme $x_1 + x_2 = 1$ $\Rightarrow$ nekonečně mnoho řešení.

Malá perturbace:

$$\begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} \alpha \\ \beta \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1+\alpha \\ 1+\beta \end{pmatrix}$$

$$x_1 + x_2 = 1 + \alpha$$
$$x_1 + x_2 = 1 + \beta$$

$\Rightarrow$ pro $\alpha \neq \beta$ soustava nemá řešení

I velmi malá perturbace zničí řešitelnost soustavy, pokud je matice singulární.

c) LZ řádky matice $\Rightarrow$ det matice $= 0$, popis výše

Geometricky rovnice soustavy představují vzájemně rovnoběžné přímky v rovině.

- stejné rovnice $\Rightarrow$ stejné přímky $\Rightarrow$ ∞ mnoho průsečíků
- malá perturbace RHS $\Rightarrow$ různé rovnoběžné přímky $\Rightarrow$ $\emptyset$ průsečíků

d) $x_1 + x_2 = 1$ $\Rightarrow$ volme parametr x_1, pak x_2 lze dopočítat $x_2 = 1 - x_1$

Wilkinsonův polynom

$$p_\delta(x) := \underbrace{\prod_{i=1}^{20} (x-i) - \delta x^{19}}_{(x-20)(x-19)\cdots(x-1) - \delta x^{19}} = \alpha_{20} x^{20} + (\alpha_{19} - \delta) x^{19} + \alpha_{18} x^{18} + \dots + \alpha_0$$

$$p_0(x) = \prod_{i=1}^{20} (x-i) = \alpha_{20} x^{20} + \alpha_{19} x^{19} + \dots + \alpha_0$$

a) $\alpha_{19} = ?$

Použijeme jeden z Viètových vzorců:

$$x_1 + x_2 + \dots + x_{20} = \frac{-\alpha_{19}}{\alpha_{20}}$$

$$\alpha_{20} = 1$$

$$x_1 + \dots + x_n = 1 + 2 + \dots + 20 = \frac{(1+20)\cdot 20}{2} = \frac{420}{2} = 210$$

$$\Rightarrow \quad \underline{\underline{\alpha_{20} = -210}}$$