

数值计算复习笔记

徐大鹏

2017年6月12日

Part I

概论

提到的考点：1.1 – 1.3.9 适定的、不适定的；误差来源和表示、条件数；机器精度；舍入误差；大数吃小数、抵消。

条件数：解的相对变化与输入数据相对变化的比值。

$$\text{condition number} = \frac{\left| \frac{(\hat{y}-y)}{y} \right|}{\left| \frac{(\hat{x}-x)}{x} \right|} = \left| \frac{\frac{\Delta y}{y}}{\frac{\Delta x}{x}} \right| = \left| \frac{x \cdot \Delta y}{y \cdot \Delta x} \right|$$

条件数刻画了问题的病态性，病态性的另一种说法是敏感性。也就是如果输入数据只变化了一点点，那么输出数据会变化多少。这个概念和在数学建模的敏感性分析中使用的概念相一致。如果敏感性越强，意味着输入数据变化相同的范围，输出数据会有更大的变化，在上述定义式中，也就是分子更大，这样的结果就是条件数更大。

使用导数的概念可以得到条件数在某一点 x 的近似表示。

$$\text{condition number} = \left| \frac{x}{y} \cdot \frac{\Delta y}{\Delta x} \right| \stackrel{x \rightarrow \infty}{=} \left| \frac{x}{y} \cdot y'(x) \right| \stackrel{y=f(x)}{=} \left| \frac{x \cdot f'(x)}{f(x)} \right|$$

这种表示形式的最大好处在于，只和自变量 x 相关，便于分析和计算。上面这种形式的条件数是最常用的计算形式，必须熟记。

对于反函数 $x = f^{-1}(y) = g(y)$ 而言，它的条件数是

$$\text{condition number} \stackrel{y \rightarrow \infty}{=} \left| \frac{y \cdot g'(y)}{x} \right| = \left| \frac{y \cdot \frac{1}{f'(x)}}{x} \right| = \left| \frac{y}{x \cdot f'(x)} \right| = \left| \frac{f(x)}{x \cdot f'(x)} \right|$$

正好就是原函数的条件数的倒数。

条件数的概念会和第二章线性方程组、第五章非线性方程组有联系。
当 x 或 y 为零时，无法计算条件数，只能使用绝对条件数代替。

$$\text{absolute condition number} = \left| \frac{\Delta y}{\Delta x} \right|$$

浮点系统可以使用四个参数完备地表示：基数 β 、精度 p 、 L 、 U 。它们的含义是什么？

$$x = \pm \left(\sum_{i=0}^p \frac{d_i}{\beta^i} \right) \beta^E$$

正规化浮点系统的下溢限

$$\text{UFL} = \beta^L$$

上溢限

$$\text{OFL} = \beta^{U+1}(1 - \beta^{-p})$$

正规化浮点数的总个数

$$2(\beta - 1)\beta^{p-1}(U - L + 1) + 1$$

截断舍入的机器精度

$$\epsilon_{mach} = \beta^{1-p}$$

最近舍入的机器精度

$$\epsilon_{mach} = \frac{1}{2}\beta^{1-p}$$

机器精度的含义是什么？

舍入误差分析的标准模型：

$$\text{fl}(x \text{ op } y) = (x \text{ op } y)(1 + \delta)$$

其中op可以是加、减、乘、除中的任意一种，相对扰动 $|\delta| \leq \epsilon_{mach}$ 。

Part II

线性方程组

提到的考点：2.3 — 2.4.8 范数、性质、条件数、误差限、影响因素、残差；
高斯消去法、LU分解。2.5 特殊线性方程组的解法：对称正定方程组的求解、

带状方程组的求解。2.6 迭代法（参考第11章）：雅克比方法、高斯-赛德尔方法、SOR方法。

向量的 p -范数：

$$\|\mathbf{x}\|_p = \left(\sum_{i=1}^n |x_i|^p \right)^{\frac{1}{p}}$$

注意表达式里，每一个分量 x_i 都取了绝对值。

矩阵范数：定义 $m \times n$ 的矩阵 \mathbf{A} 的（向量诱导）范数是

$$\|\mathbf{A}\| = \max_{\mathbf{x} \neq \mathbf{0}} \frac{\|\mathbf{A}\mathbf{x}\|}{\|\mathbf{x}\|}$$

使用向量1-范数、 ∞ -范数的结果不太容易推导，直接记住形式：

$$\|\mathbf{A}\|_1 = \max_j \sum_{i=1}^m |a_{ij}|$$

$$\|\mathbf{A}\|_\infty = \max_i \sum_{j=1}^n |a_{ij}|$$

一个是按行求和，一个是按列求和。

矩阵条件数的性质：

- 对任意 \mathbf{A} ， $\text{cond}(\mathbf{A}) \geq 1$ 。
不会证。
- 对任意 \mathbf{A} 及非零标量 γ ， $\text{cond}(\gamma\mathbf{A}) = \text{cond}(\mathbf{A})$ 。
- 对任意对角阵， $\mathbf{D} = \text{diag}(d_i)$ ， $\text{cond}(\mathbf{D}) = \frac{\max_i |d_i|}{\min_i |d_i|}$ 。
显然。

条件数 $\text{cond}(\mathbf{A})$ 刻画了矩阵接近奇异的程度。行列式 $\det(\mathbf{A})$ 刻画了矩阵是否是奇异的。

第2.3.4节主要讲了求解线性方程组的误差限表示、误差限和什么相关，以及如何推导误差限的问题。推导得到了两个主要结论。第一个是，右端向量带有扰动的方程组 $\mathbf{A}(\mathbf{x} + \Delta\mathbf{x}) = \mathbf{b} + \Delta\mathbf{b}$ 的解的估计式是

$$\frac{\|\Delta\mathbf{x}\|}{\|\mathbf{x}\|} \leq \text{cond}(\mathbf{A}) \cdot \frac{\|\Delta\mathbf{b}\|}{\|\mathbf{b}\|}$$

第二个是，矩阵 \mathbf{A} 的元素带有扰动的方程组 $(\mathbf{A} + \mathbf{E})(\mathbf{x} + \Delta\mathbf{x}) = \mathbf{b}$ 的解的估计式是

$$\frac{\|\Delta\mathbf{x}\|}{\|\mathbf{x} + \Delta\mathbf{x}\|} \leq \text{cond}(\mathbf{A}) \frac{\|\mathbf{E}\|}{\|\mathbf{A}\|}$$

注意直接使用不等式推得的第二个结论中，左边分母上是带扰动的输入 $\mathbf{x} + \Delta \mathbf{x}$ 。

使用更精确的方法改进第二个结论？然后可以得到最终的结论：

$$\frac{\|\Delta \mathbf{x}\|}{\|\mathbf{x}\|} \leq \text{cond}(\mathbf{A}) \left(\frac{\|\Delta \mathbf{b}\|}{\|\mathbf{b}\|} + \frac{\|\mathbf{E}\|}{\|\mathbf{A}\|} \right)$$

上式左侧的分式是向前误差，右侧的分式是向后误差。条件数是输出误差对输入误差的一个估计。一个输入数据的误差输入数据的误差就是数据传播误差。浮点系统的数据传播误差的大小由机器精度 ϵ_{mach} 决定。可以将上式写成这种形式

$$\frac{\|\Delta \mathbf{x}\|}{\|\mathbf{x}\|} \lesssim \text{cond}(\mathbf{A}) \epsilon_{mach}$$

矩阵条件数 $\text{cond}(\mathbf{A})$ 太大的原因：

1. 矩阵本身是接近奇异的，也就是行向量之间接近线性相关；
2. 观测的数据相差太大，比如某个列向量大了很多个数量级

残差：

$$\mathbf{r} = \mathbf{b} - \mathbf{A}\hat{\mathbf{x}}$$

相对残差：

$$\frac{\|\mathbf{r}\|}{\|\mathbf{A}\| \cdot \|\hat{\mathbf{x}}\|}$$

稳定算法产生的相对残差总是很小。

线性方程组的求解：相互等价的两种算法，Gauss消去法和LU分解。这

$$\mathbf{M}_k \mathbf{a} = \begin{bmatrix} 1 & \cdots & 0 & 0 & \cdots & 0 \\ \vdots & \ddots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & \cdots & 1 & 0 & \cdots & 0 \\ 0 & \cdots & -m_{k+1} & 1 & \cdots & 0 \\ \vdots & \ddots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & \cdots & -m_n & 0 & \cdots & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} a_1 \\ \vdots \\ a_k \\ a_{k+1} \\ \vdots \\ a_n \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} a_1 \\ \vdots \\ a_k \\ 0 \\ \vdots \\ 0 \end{bmatrix}$$

里，我们构造了一个初等消去阵

$$\mathbf{M}_k = \mathbf{I} - \mathbf{m} \mathbf{e}_k^T$$

，其中

$$\mathbf{m} = (0, \cdots, 0, m_{k+1}, \cdots, m_n)$$

考虑到 $m_i = a_i/a_k$ ，上式可写作

$$\mathbf{m} = (0, \dots, 0, \frac{a_{i+1}}{a_k}, \dots, \frac{a_n}{a_k})$$

\mathbf{M}_k 是一个单位下三角矩阵，然后后面就很显然了，果然没什么好推的。

选主元：每次循环时选择最大的元素作为主元，因为主元 a_k 出现在 $m_i = a_i/a_k$ 的分母上。如果 a_k 比较小，会产生一个非常大的乘数 m_i ，从而造成大数吃小数的（抵消）问题，导致误差。选主元的结果是在 \mathbf{A} 上乘以了一个排列矩阵 \mathbf{P} ，使

$$\mathbf{PA} = \mathbf{LU}$$

这样，求解 $\mathbf{Ax} = \mathbf{b}$ 的问题等价转化为求解 $\mathbf{PAx} = \mathbf{Pb}$ 的问题。特别注意，排列阵 \mathbf{P} 具有性质

$$\mathbf{P}^{-1} = \mathbf{P}^T$$

另外，这个性质实际上说明排列阵 \mathbf{P} 是一个正交矩阵。

高斯-若当（Gauss-Jordan）消去法：这种方法的区别在于，开始于

$$\left[\mathbf{A} \mid \mathbf{I} \right]$$

但是行化简的方式，是将非对角线上的元素一次消去，是一种彻底的消元法。消元后，乘以一个对角矩阵将左侧矩阵的对角元素化为全1。最终得到的结果是

$$\left[\mathbf{I} \mid \mathbf{A}^{-1} \right]$$

这种方法更适合于求出逆矩阵 \mathbf{A}^{-1} 。

对称正定方程组：如果 \mathbf{A} 是对称正定的，那么 $\mathbf{A} = \mathbf{LL}^T > 0$

Part III

线性最小二乘

提到的考点：正规方程组、增广方程组、QR分解（House-Hold方法、Givens旋转、Gram-Schmidt正交化方法）、奇异值分解。

House-Hold变换。

$$\mathbf{H} = \mathbf{I} - 2 \frac{\mathbf{vv}^T}{\mathbf{v}^T \mathbf{v}}$$
$$\mathbf{HH}^T = \mathbf{I} - 2 \frac{\mathbf{vv}^T}{\mathbf{v}^T \mathbf{v}}$$

Part IV

非线性方程组

提到的考点：5.1, 5.4 — 5.5.5：收敛速度、收敛性；二分法、牛顿法、反二次方法。迭代收敛准则。例题5.9

Part V

插值

提到的考点：7.3 三种基函数：单项式、拉格朗日、牛顿。7.3.1 — 7.3.3, 7.3.5 余项定理。7.4.2 三次样条。例题7.6

Part VI

积分和微分

提到的考点：待定系数法。8.3 牛顿科特斯方法、高斯方法。简单求积公式构造出复杂的求积公式。8.6 差分公式和推导。积分：代数精度、验证法确定。