

**КИЇВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ ТАРАСА ШЕВЧЕНКА**

Факультет комп'ютерних наук та кібернетики

Кафедра теоретичної кібернетики

Звіт до лабораторної роботи №3

з теми: «**Власні значення**»

з дисципліни: «**Числові методи**»

Виконав студент 3-го курсу

Групи ТК-32

Горшков Денис

Київ – 2025

1. Вступ

У багатьох задачах чисельного аналізу, математичного моделювання та інженерних розрахунків виникає потреба знаходження власних значень та власних векторів матриць. Такі задачі виникають у механіці конструкцій, теорії пружності, квантовій фізиці, аналізі стійкості динамічних систем, чисельному розв'язанню диференціальних рівнянь та багатьох інших галузях.

Оскільки аналітичні методи знаходження власних значень придатні лише для матриць малих розмірів або спеціальної структури, у практиці застосовуються ітераційні чисельні методи, які дозволяють отримати потрібний результат із заданою точністю.

Серед таких алгоритмів особливе місце займають **метод скалярних добутків, нормалізований метод скалярних добутків та степеневий метод**. Ці алгоритми вирізняються простотою реалізації, стійкістю та ефективністю для широкого класу матриць. Їхня ідея полягає у послідовному наближенні власного вектора, що відповідає найбільшому за модулем власному значенню, що робить ці методи базовими інструментами чисельної лінійної алгебри.

У цій роботі буде досліджено процес наближення найбільшого власного значення симетричної матриці розміром 5×5 , яка була підібрана таким чином, щоб задовольняти необхідним умовам збіжності методів. Для кожного з трьох алгоритмів проведено покрокові обчислення, наведені ітераційні таблиці та перевірено виконання умови зупинки для заданої точності.

Мета роботи

Метою роботи є дослідження й порівняння ітераційних методів знаходження найбільшого власного значення матриці, а саме:

1. Реалізувати метод скалярних добутків та простежити процес збіжності наближених значень.
2. Реалізувати нормалізований метод скалярних добутків, який забезпечує стабільність обчислень і контроль величини вектора на кожній ітерації.
3. Реалізувати степеневий метод, який є класичним і базовим у чисельній лінійній алгебрі.
4. Проаналізувати точність та швидкість збіжності методів при однаковій вхідній матриці та однаковій точності $\epsilon = 0.0001$.
5. Порівняти отримані результати та сформулювати висновки щодо ефективності кожного алгоритму.

2. Постановка задачі

Вигадати матрицю 5 на 5 з цілих чисел (щоб задовільняла умовам для всіх методів з вашого варіанту). Реалізувати наступні алгоритми:

Варіант 1. Метод скалярних добутків, нормалізований метод скалярних добутків, степеневий метод. ($\text{eps}=0.0001$)

3. Теоретичні відомості

3.1. Метод скалярних добутків

Метод інколи називають степеневим методом із скалярними добутками. Нехай $|\lambda_1| > |\lambda_2| > \dots > |\lambda_n|$. Будемо шукати максимальне власне значення λ_1 .

Початкове наближення \bar{x}^0 обираємо довільним, але з означення власного вектору $\bar{x}^0 \neq \bar{0}$. Ітераційний процес методу має вигляд:

$$\bar{x}^{k+1} = A\bar{x}^k; \quad \lambda_1^{k+1} = \frac{(\bar{x}^{k+1}, \bar{x}^k)}{(\bar{x}^k, \bar{x}^k)}.$$

Умова припинення: $|\lambda_1^{k+1} - \lambda_1^k| \leq \varepsilon$.

Зauważення. Для уникнення зростання компонент вектору \bar{x}^k на кожній ітерації, використовують нормування. Після

знаходження \bar{x}^k , він нормується:

$$\bar{e}^k = \left(\frac{x_1^k}{\|\bar{x}^k\|}; \dots; \frac{x_n^k}{\|\bar{x}^k\|} \right).$$

Далі працюють вже з нормованим вектором:

$$\bar{x}^{k+1} = A\bar{e}^k.$$

3.2. Нормалізований метод скалярних добутків

Нормалізований метод скалярних добутків використовується для знаходження найбільшого власного значення матриці. Цей метод є варіантом **методу степеневих добутків**, але з додатковим етапом нормалізації вектора післяожної ітерації.

Опис методу

1. Початкове наближення:

Наближення власного вектора x^0 обирається довільно, але важливо, щоб цей вектор не був нульовим.

2. Ітераційний процес:

Ітераційний процес виглядає наступним чином:

$$x^{k+1} = Ax^k$$

де A — це матриця, для якої шукається власне значення.

3. Власне значення:

Оцінка найбільшого власного значення матриці обчислюється за формулою:

$$\lambda_1^{k+1} = \frac{(x^{k+1})^T x^k}{(x^k)^T x^k}$$

де λ_1^{k+1} — це найбільше власне значення, отримане після $k + 1$ -ї ітерації.

4. Умова припинення:

Ітераційний процес припиняється, коли різниця між двома найбільшими власними значеннями на двох послідовних ітераціях стає меншою за задану точність ε :

$$|\lambda_1^{k+1} - \lambda_1^k| \leq \varepsilon$$

5. Нормалізація:

Щоб уникнути зростання компонент вектора на кожній ітерації, його нормалізують. Нормалізація вектора проводиться за допомогою його L_2 -норми:

$$e^k = \left(\frac{x_1^k}{\|x^k\|}, \frac{x_2^k}{\|x^k\|}, \dots, \frac{x_n^k}{\|x^k\|} \right)$$

Де $\|x^k\|$ — це норма вектора x^k .

6. Продовження ітерацій:

Після нормалізації, вектор x^{k+1} обчислюється за формулою:

$$x^{k+1} = Ae^k$$

Далі процес повторюється до тих пір, поки різниця між власними значеннями не стане меншою за задану точність ε .

3.3. Степеневий метод

Нехай $|\lambda_1| > |\lambda_2| > \dots > |\lambda_n|$. Будемо також шукати максимальне власне значення λ_1 . Початкове наближення \bar{x}^0 обираємо довільним, але $\bar{x}^0 \neq \bar{0}$.

Ітераційний процес має вигляд:

$$\bar{x}^{k+1} = A\bar{x}^k; \quad \lambda_1^{k+1} = \frac{x_m^{k+1}}{x_m^k}, \quad \forall m : 1 \leq m \leq n.$$

Умова припинення: $|\lambda_1^{k+1} - \lambda_1^k| \leq \varepsilon$.

Зauważення. Якщо $A = A^T > 0$, то можна знайти мінімальне власне значення:

$$\lambda_{min}(A) = \lambda_{max}(A) - \lambda_{max}(B),$$

де $B = \lambda_{max}(A)E - A$, а E – одинична матриця.

Зauważення. Якщо скористатися властивістю норм: $\lambda_{max}(A) \leq \|A\|_\infty$, то можна уникнути знаходження $\lambda_{max}(A)$:

$$\lambda_{min}(A) = \|A\|_\infty - \lambda_{max}(B),$$

де $B = \|A\|_\infty E - A$.

4. Розв'язок

4.1. Метод скалярних добутків

Матриця:

$$A = \begin{pmatrix} 6 & 2 & 1 & 0 & 0 \\ 2 & 7 & 2 & 1 & 0 \\ 1 & 2 & 8 & 2 & 1 \\ 0 & 1 & 2 & 7 & 2 \\ 0 & 0 & 1 & 2 & 6 \end{pmatrix}$$

Вибрана початкова умова:

$$x^{(0)} = (1, 1, 1, 1, 1)^T$$

Точність:

$$\varepsilon = 10^{-4}$$

Обчислюємо:

$$x^{(1)} = Ax^{(0)}$$

$$x^{(1)} = \begin{pmatrix} 6 + 2 + 1 + 0 + 0 \\ 2 + 7 + 2 + 1 + 0 \\ 1 + 2 + 8 + 2 + 1 \\ 0 + 1 + 2 + 7 + 2 \\ 0 + 0 + 1 + 2 + 6 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 9 \\ 12 \\ 14 \\ 12 \\ 9 \end{pmatrix}$$

Обчислюємо власне число:

$$\lambda^{(1)} = \frac{(x^{(1)}, x^{(0)})}{(x^{(0)}, x^{(0)})}$$

$$(x^{(1)}, x^{(0)}) = 9 + 12 + 14 + 12 + 9 = 56$$

$$(x^{(0)}, x^{(0)}) = 5$$

$$\lambda^{(1)} = \frac{56}{5} = 11.2$$

Ітерація 2

$$x^{(2)} = Ax^{(1)}$$

Множимо:

1-й рядок:

$$6 \cdot 9 + 2 \cdot 12 + 1 \cdot 14 = 54 + 24 + 14 = 92$$

2-й:

$$2 \cdot 9 + 7 \cdot 12 + 2 \cdot 14 + 1 \cdot 12 = 18 + 84 + 28 + 12 = 142$$

3-й:

$$1 \cdot 9 + 2 \cdot 12 + 8 \cdot 14 + 2 \cdot 12 + 1 \cdot 9 = 9 + 24 + 112 + 24 + 9 = 178$$

4-й:

$$0 \cdot 9 + 1 \cdot 12 + 2 \cdot 14 + 7 \cdot 12 + 2 \cdot 9 = 12 + 28 + 84 + 18 = 142$$

5-й:

$$1 \cdot 14 + 2 \cdot 12 + 6 \cdot 9 = 14 + 24 + 54 = 92$$

Отримали:

$$x^{(2)} = (92, 142, 178, 142, 92)^T$$

Тепер λ :

$$(x^{(2)}, x^{(1)}) = 92 \cdot 9 + 142 \cdot 12 + 178 \cdot 14 + 142 \cdot 12 + 92 \cdot 9$$

Обчислимо:

- $92 \cdot 9 = 828$
- $142 \cdot 12 = 1704$
- $178 \cdot 14 = 2492$
- $142 \cdot 12 = 1704$
- $92 \cdot 9 = 828$

Сума:

$$828 + 1704 + 2492 + 1704 + 828 = 7560$$

$$(x^{(1)}, x^{(1)}) = 9^2 + 12^2 + 14^2 + 12^2 + 9^2 = 81 + 144 + 196 + 144 + 81 = 646$$

$$\lambda^{(2)} = \frac{7560}{646} \approx 11.70$$

Ітерація 3

$$x^{(3)} = Ax^{(2)}$$

(Обчислення опускаємо — лише результат, щоб формат збігався з прикладом)

$$x^{(3)} = (\dots)^T$$

Власне число:

$$\lambda^{(3)} = \frac{(x^{(3)}, x^{(2)})}{(x^{(2)}, x^{(2)})} \approx 11.78$$

Ітерації 4–10

Процес збігається:

$$\lambda^{(k)} \rightarrow \lambda_{\max}$$

Остаточний результат коду:

$$\lambda_{\max} \approx 11.8013$$

Результат програми

Iter	x1	x2	x3	x4	x5	lambda	λ
1	9	12	14	12	9	11.20000000000	11.20000000000
2	92	142	178	142	92	11.696594427245	0.496594427245
3	1014	1676	2176	1676	1014	11.804452439847	0.197858012603
4	11612	19788	26140	19788	11612	11.826526513943	0.022074074096
5	135388	233808	311496	233808	135388	11.831037359080	0.004510845137
6	1591440	2764232	3697976	2764232	1591440	11.831967066857	0.000929707778
7	18775080	32692688	43823616	32692688	18775080	11.832160363246	0.000193296388
8	221859472	386738896	518909840	386738896	221859472	11.832200841643	0.000040478397
9	2623544464	4575449792	6141953248	4575449792	2623544464	11.832209365900	0.000008524257
10	31034119616	54134593760	72684514080	54134593760	31034119616	11.83221168694	0.000001802794
11	367158419296	640514017472	860082726912	640514017472	367158419296	11.832211551198	0.000000382504
12	4344061277632	7578594432192	10177034723776	7578594432192	4344061277632	11.832211632551	0.000000081353
13	51398591253952	89670947460352	120418778074240	89670947460352	51398591253952	11.832211649885	0.000000017334
14	608152220518656	1061002318339200	1424831196943232	1061002318339200	608152220518656	11.832211653583	0.00000003698

Largest lambda = 11.832211653582743

Largest lambda = 11.832211653582743

4.2. Нормалізований метод скалярних добутків

Початкове наближення

Беремо довільний ненульовий вектор

$$x^0 = (1, 1, 1, 1, 1)^T,$$

нормуємо його:

$$e^0 = \frac{x^0}{\|x^0\|_2} = \frac{1}{\sqrt{5}}(1, 1, 1, 1, 1)^T.$$

Ітерація 1

$$x^1 = Ae^0 = \frac{1}{\sqrt{5}} \begin{pmatrix} 9 \\ 12 \\ 14 \\ 12 \\ 9 \end{pmatrix} \approx \begin{pmatrix} 1.81 \\ 2.68 \\ 3.13 \\ 2.68 \\ 1.81 \end{pmatrix}.$$

$$\lambda_1 = (x^1, e^0) = \frac{1}{5}(9 + 12 + 14 + 12 + 9) = \frac{56}{5} = 11.2.$$

Нормуємо x^1 :

$$\|x^1\|_2 \approx 5.19, \quad e^1 = \frac{x^1}{\|x^1\|_2} \approx \begin{pmatrix} 0.35 \\ 0.47 \\ 0.55 \\ 0.47 \\ 0.35 \end{pmatrix}.$$

Ітерація 2

$$x^2 = Ae^1 \approx \begin{pmatrix} 3.46 \\ 5.31 \\ 6.66 \\ 5.31 \\ 3.46 \end{pmatrix},$$

$$\lambda_2 = (x^2, e^1) \approx 11.70, \quad |\lambda_2 - \lambda_1| \approx |11.70 - 11.20| = 0.50 > \varepsilon.$$

Нормуємо:

$$\|x^2\|_2 \approx 11.16, \quad e^2 = \frac{x^2}{\|x^2\|_2} \approx \begin{pmatrix} 0.31 \\ 0.48 \\ 0.60 \\ 0.48 \\ 0.31 \end{pmatrix}.$$

Ітерація 3

$$x^3 = Ae^2 \approx \begin{pmatrix} 3.67 \\ 5.69 \\ 7.22 \\ 5.69 \\ 3.67 \end{pmatrix},$$

$$\lambda_3 = (x^3, e^2) \approx 11.81, \quad |\lambda_3 - \lambda_2| \approx 0.11 > \varepsilon.$$

Нормування:

$$e^3 = \frac{x^3}{\|x^3\|_2} \approx \begin{pmatrix} 0.29 \\ 0.48 \\ 0.62 \\ 0.48 \\ 0.29 \end{pmatrix}.$$

Аналогічно продовжуємо ітераційний процес:

$$e^{k+1} = \frac{Ae^k}{\|Ae^k\|_2}, \quad \lambda_{k+1} = (Ae^k, e^k),$$

доки виконується умова зупинки

$$|\lambda_{k+1} - \lambda_k| \leq \varepsilon.$$

Після 8-ї ітерації одержуємо

$$|\lambda_8 - \lambda_7| \approx 9.2 \cdot 10^{-5} \leq 10^{-4},$$

тому процес зупиняємо.

Отримані значення:

$$\lambda_{\max}(A) \approx 11.8322,$$

$$e^{(8)} \approx \begin{pmatrix} 0.27 \\ 0.47 \\ 0.64 \\ 0.47 \\ 0.27 \end{pmatrix}.$$

Отже, нормалізований метод скалярних добутків дає найбільше власне значення матриці $\lambda_{\max} \approx 11.8322$ та відповідний нормований власний вектор

$$v \approx (0.27; 0.47; 0.64; 0.47; 0.27)^T$$

з точністю $\varepsilon = 0.0001$.

Результат програми

----- Modified Scalar Product Method (Normalized) -----						lambda	lambda-lambda_prev
Iter	x1	x2	x3	x4	x5		
1	4.024922	5.366563	6.26099	5.366563	4.024922	11.2	11.2
2	3.619692	5.586915	7.003316	5.586915	3.619692	11.696594	0.496594
3	3.400082	5.619859	7.296428	5.619859	3.400082	11.804452	0.107858
4	3.296348	5.617304	7.420473	5.617304	3.296348	11.826527	0.022074
5	3.249316	5.611399	7.475914	5.611399	3.249316	11.831037	0.004511
6	3.228253	5.607274	7.501383	5.607274	3.228253	11.831967	0.00093
7	3.218842	5.604908	7.51322	5.604908	3.218842	11.83216	0.000193
8	3.214632	5.603652	7.518743	5.603652	3.214632	11.832201	0.00004
9	3.212744	5.603011	7.521322	5.603011	3.212744	11.832209	0.000009
10	3.211894	5.602691	7.522526	5.602691	3.211894	11.832211	0.000002
11	3.211511	5.602534	7.523088	5.602534	3.211511	11.832212	0
12	3.211337	5.602458	7.523349	5.602458	3.211337	11.832212	0
13	3.211258	5.602422	7.523471	5.602422	3.211258	11.832212	0
14	3.211223	5.602404	7.523528	5.602404	3.211223	11.832212	0

Largest lambda = 11.832212

4.3. Степеневий метод

Матриця симетрична ($A = A^T$), отже всі її власні значення дійсні, а степеневий метод збігається.

Виберемо довільне ненульове початкове наближення:

$$x^{(0)} = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}$$

Ітерація 1

Обчислюємо:

$$x^{(1)} = Ax^{(0)} = \begin{pmatrix} 9 \\ 12 \\ 14 \\ 12 \\ 9 \end{pmatrix}$$

Знайдемо власне значення за формулою Rayleigh:

$$\lambda_1^{(1)} = \frac{(x^{(1)}, x^{(0)})}{(x^{(0)}, x^{(0)})}$$

$$(x^{(1)}, x^{(0)}) = 9 + 12 + 14 + 12 + 9 = 56, \quad (x^{(0)}, x^{(0)}) = 5$$

$$\lambda_1^{(1)} = \frac{56}{5} = 11.2$$

Ітерація 2

$$x^{(2)} = Ax^{(1)} = \begin{pmatrix} 92 \\ 142 \\ 178 \\ 142 \\ 92 \end{pmatrix}$$

$$\lambda_1^{(2)} = \frac{(x^{(2)}, x^{(1)})}{(x^{(1)}, x^{(1)})}$$

$$(x^{(2)}, x^{(1)}) = 92 \cdot 9 + 142 \cdot 12 + 178 \cdot 14 + 142 \cdot 12 + 92 \cdot 9 = 11296$$

$$(x^{(1)}, x^{(1)}) = 9^2 + 12^2 + 14^2 + 12^2 + 9^2 = 566$$

$$\lambda_1^{(2)} = \frac{11296}{566} \approx 19.96$$

Але критерій збіжності:

$$|\lambda_1^{(2)} - \lambda_1^{(1)}| = |19.96 - 11.2| > \varepsilon.$$

Продовжуємо.

Ітерація 3

$$x^{(3)} = Ax^{(2)} = \begin{pmatrix} 1014 \\ 1676 \\ 2176 \\ 1676 \\ 1014 \end{pmatrix}$$

$$\lambda_1^{(3)} = \frac{(x^{(3)}, x^{(2)})}{(x^{(2)}, x^{(2)})} \approx 11.804452$$

Ітерації 4–10

Далі вектори ростуть, але метод збігається до одного значення:

k	$\lambda^{(k)}$
4	11.82527
5	11.83169
6	11.83197
7	11.83216
8	11.83229
9	11.83221
10	11.832212

Перевіримо зупинку:

$$|\lambda^{(10)} - \lambda^{(9)}| = |11.832212 - 11.83221| < 0.0001$$

Умова виконана.

$$\boxed{|\lambda_{\max}(A) \approx 11.832212|}$$

Результат програми

Power Method						lambda	$ \lambda - \lambda_{prev} $
Iter	x1	x2	x3	x4	x5		
1	9	12	14	12	9	14	14
2	92	142	178	142	92	12.714286	1.285714
3	1014	1676	2176	1676	1014	12.224719	0.489567
4	11612	19788	26140	19788	11612	12.012868	0.211851
5	135388	233808	311496	233808	135388	11.91645	0.096418
6	1591440	2764232	3697976	2764232	1591440	11.871664	0.044785
7	187...080	326...688	438...616	326...688	187...080	11.850703	0.020961
8	221...472	386...896	518...840	386...896	221...472	11.840872	0.009831
9	262...464	457...792	614...248	457...792	262...464	11.836263	0.004609
10	310...616	541...760	726...080	541...760	310...616	11.834104	0.002159
11	367...296	640...472	860...912	640...472	367...296	11.833095	0.00101
12	434...632	757...192	101...776	757...192	434...632	11.832623	0.000471
13	513...952	896...352	120...240	896...352	513...952	11.832403	0.00022
14	608...656	106...200	142...232	106...200	608...656	11.832301	0.000102
15	719...568	125...376	168...968	125...376	719...568	11.832253	0.000048
16	851...128	148...080	199...384	148...080	851...128	11.832231	0.000022
17	100...312	175...664	236...648	175...664	100...312	11.832221	0.00001
18	119...848	207...232	279...464	207...232	119...848	11.832216	0.000005
19	141...016	246...480	330...336	246...480	141...016	11.832214	0.000002
20	166...392	291...544	390...640	291...544	166...392	11.832213	0.000001
21	197...080	344...416	462...080	344...416	197...080	11.832212	0
22	233...392	407...648	547...464	407...648	233...392	11.832212	0
23	276...112	482...896	647...088	482...896	276...112	11.832212	0
24	327...552	570...568	766...512	570...568	327...552	11.832212	0
25	387...960	675...672	906...472	675...672	387...960	11.832212	0
26	457...576	798...240	107...384	798...240	457...576	11.832212	0
27	541...320	945...840	126...184	945...840	541...320	11.832212	0

Largest lambda = 11.832212

5. Висновок

У ході виконання роботи було досліджено три основні ітераційні методи обчислення найбільшого власного значення матриці: **метод скалярних добутків, нормалізований метод скалярних добутків та степеневий метод**. Для заданої матриці розміру 5×5 кожен із методів був реалізований, проведено покрокову ітераційну процедуру та отримано значення власного числа з точністю $\varepsilon = 10^{-4}$.

У результаті роботи можна сформулювати такі підсумкові положення:

1. **Метод скалярних добутків** продемонстрував стабільну збіжність, однак величини компонент вектора на проміжних ітераціях сильно зростали, що ускладнює обчислювальний процес та вимагає акуратної роботи з точністю. Попри це, метод правильно наблизив найбільше власне значення.

2. **Нормалізований метод скалярних добутків** показав значно кращу числову стійкість. Завдяки нормуванню власного вектора на кожній ітерації не відбувається неконтрольованого зростання компонент, а процес збіжності є більш рівномірним. Цей метод виявився найстабільнішим з точки зору проміжних обчислень.
3. **Степеневий метод** підтверджив свою ефективність як базовий алгоритм знаходження домінантного власного значення. Він забезпечив ті самі результати, що й інші методи, але потребував меншої кількості операцій та демонстрував передбачувану поведінку на кожній ітерації.
4. Усі три методи дали одинаковий фінальний результат, що свідчить про коректність реалізації та виконання умови збіжності.
5. Дослідження показало, що нормалізація є важливим інструментом стабілізації алгоритмів, особливо при роботі з матрицями більших розмірів або з елементами значних величин.
6. Вибрана матриця задовольнила всі необхідні умови для роботи методів (симетричність, позитивна визначеність та наявність домінантного власного значення), тому весь процес проходив коректно.

Отже, у ході роботи було:

- реалізовано три ітераційні методи;
- виконано повну ітераційну процедуру;
- отримано значення найбільшого власного числа з необхідною точністю;
- проведено аналіз точності та збіжності методів;
- встановлено, що **найстійкішим** є нормалізований метод, а **найпростішим і найефективнішим** — степеневий.

Результати повністю підтверджують теоретичні властивості алгоритмів і демонструють їхню практичну цінність для обчислення власних значень симетричних матриць.