

## CURS#12

14. Analiza senzitivității/stabilității sistemelor de ecuații liniare pătratice: număr de condiționare a unei matrice; estimare riguroasă; estimare riguroasă pe componente.

### PROBLEME

1) Arătați că au loc inegalitățile

$$\frac{1}{n} \kappa_2(\mathbf{A}) \leq \kappa_1(\mathbf{A}) \leq n \kappa_2(\mathbf{A}), \quad \forall \mathbf{A} \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R}),$$

$$\frac{1}{n} \kappa_\infty(\mathbf{A}) \leq \kappa_2(\mathbf{A}) \leq n \kappa_\infty(\mathbf{A}), \quad \forall \mathbf{A} \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R}),$$

$$\frac{1}{n^2} \kappa_1(\mathbf{A}) \leq \kappa_\infty(\mathbf{A}) \leq n^2 \kappa_1(\mathbf{A}), \quad \forall \mathbf{A} \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R}).$$

## 3.7. ANALIZA SENZITIVITATII / STABILITATII SISTEMELOR LINIARE PĂTRATICE

Considerăm sistemul de ecuații liniare

$$(1) \boxed{A \underline{x} = \underline{b}}, \quad A \in \mathbb{M}_n(\mathbb{R}) \text{ inversabilă} \\ \underline{b} \in \mathbb{R}^n$$

Motivatie: Cum se comportă soluția sistemului (1) pentru dări perturbate, i.e. pentru perturbații  $\Delta A \in \mathbb{M}_n(\mathbb{R})$  și  $\Delta \underline{b} \in \mathbb{R}^n$  ale matricei sistemului (1)  $A \in \mathbb{M}_n(\mathbb{R})$ , respectiv ale membrului drept  $\underline{b} \in \mathbb{R}^n$ , în raport cu soluția exactă  $\underline{x}^* := A^{-1} \underline{b}$ ?

ANALIZĂ FOLOSIND DVS

$$A = U \sum V^T = \sum_{i=1}^n \sigma_i u_i v_i^T \quad (2)$$

$$\begin{cases} U := [u_1 \dots u_n] \in \mathbb{M}_n(\mathbb{R}): U^T U = I_n \\ V := [v_1 \dots v_n] \in \mathbb{M}_n(\mathbb{R}): V^T V = I_n \\ \Sigma := \text{diag}(\sigma_1, \dots, \sigma_n) \in \mathbb{M}_n(\mathbb{R}) \end{cases}$$

Inserarea (2) în (1) și obținem

$$\begin{aligned}
 & U^T \left| \sum V^T x = b \right. \\
 & \sum V^T x = U^T b \\
 & V | V^T x = \sum U^T b \Rightarrow \\
 & x = V \sum U^T b \\
 & = [v_1 \dots v_n] \text{diag}\left(\frac{1}{\sigma_1}, \dots, \frac{1}{\sigma_n}\right) \begin{bmatrix} u_1^T \\ \vdots \\ u_n^T \end{bmatrix} b \\
 & = [u_1 \dots u_n] \text{diag}\left(\frac{1}{\sigma_1}, \dots, \frac{1}{\sigma_n}\right) \begin{bmatrix} u_1^T b \\ \vdots \\ u_n^T b \end{bmatrix} \\
 & = \begin{bmatrix} u_1 \dots u_n \end{bmatrix} \begin{bmatrix} (u_1^T b) / \sigma_1 \\ \vdots \\ (u_n^T b) / \sigma_n \end{bmatrix} \\
 & = u_1 \frac{u_1^T b}{\sigma_1} + u_2 \frac{u_2^T b}{\sigma_2} + \dots + u_n \frac{u_n^T b}{\sigma_n} \Rightarrow \\
 & x = \boxed{\sum_{i=1}^n \frac{u_i^T b}{\sigma_i} u_i} \quad (3)
 \end{aligned}$$

OBS: Magnitudinea lui  $\sigma_n(A) = \sigma_{\min}(A)$  are un impact major asupra soluției  
 (3) a sistemului liniar (1)!

## NUMĂR DE CONDIȚIONARE

Considerăm, din nou, sistemul liniar

$$(1) \quad A \underline{x} = \underline{b}, \quad \begin{cases} A \in M_n(\mathbb{R}) \text{ inversabilă} \\ \underline{b} \in \mathbb{R}^n \end{cases}$$

Considerăm sistemul perturbat (parametrizat) asociat leii (1):

$$(2) \quad (A + \varepsilon F) \underline{x}(\varepsilon) = \underline{b} + \varepsilon \underline{f}$$

unde:

- $\varepsilon \in \mathbb{R}$  mic
  - $F \in M_n(\mathbb{R})$
  - $\underline{f} \in \mathbb{R}^n$
- $\left. \begin{array}{l} : A + \varepsilon F \in M_n(\mathbb{R}) \text{ invers} \\ (\text{Alegem } \varepsilon \in \mathbb{R}: \\ |\varepsilon| \|A^\top F\| < 1) \end{array} \right\}$

OBS :

- $\mathcal{E} \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$  perturbare a lui  $A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R})$ ;
- $\mathcal{E} f \in \mathbb{R}^n$  perturbare a lui  $b \in \mathbb{R}^n$ ;
- $\underline{x}(\varepsilon) \in \mathbb{R}^n$  solutia sistemului perturbat  
(2), i.e. depinde de parametru  $\varepsilon \in \mathbb{R}$ ;
- $\underline{x} := \underline{x}(0)$  solutia sistemului (1).

OBS :

$\underline{x}(\varepsilon) \in \mathbb{R}^n$  derivabilită într-o vecinătate  
a lui  $\varepsilon = 0 \Rightarrow$

Taylor

$$\boxed{\underline{x}(\varepsilon) = \underline{x}(0) + \varepsilon \dot{\underline{x}}(0) + O(\varepsilon^2)} \quad (3)$$

OBS : Vrem o estimare pt.  $\|\underline{x}(\varepsilon) - \underline{x}\|$ ,  
deci este suficient să determinăm  $\dot{\underline{x}}(0)$ !

- Înserăm (3) în (2) și obținem:

$$(A + \varepsilon F)(\underline{x} + \varepsilon \dot{\underline{x}}(0) + O(\varepsilon^2)) = b + \varepsilon f$$

$$A\underline{x} + \varepsilon (A\dot{\underline{x}}(0) + F\underline{x}) + O(\varepsilon^2) = b + \varepsilon f \Rightarrow$$

$$\Sigma^0: A\dot{\underline{x}} = \underline{b} \quad \checkmark \text{ verificat prin (1)}$$

$$\Sigma^1: A\dot{\underline{x}}(0) = \underline{f} - F\underline{x} \Rightarrow$$

$$\dot{\underline{x}}(0) = A^{-1}(\underline{f} - F\underline{x}) \quad (4)$$

• Revenim la (3) și obținem, pt orice normă vectorială și pt normă matricială indusă:

$$\begin{aligned}
 \|\underline{x}(\varepsilon) - \underline{x}\| &\stackrel{(3)}{=} \|\varepsilon \dot{\underline{x}}(0) + O(\varepsilon^2)\| \\
 &\leq |\varepsilon| \|\dot{\underline{x}}(0)\| + O(\varepsilon^2) \\
 &\stackrel{(4)}{=} |\varepsilon| \|A^{-1}(\underline{f} - F\underline{x})\| + O(\varepsilon^2) \\
 &\leq |\varepsilon| \|A^{-1}\| \cdot \|\underline{f} - F\underline{x}\| + O(\varepsilon^2) \\
 &\leq |\varepsilon| \|A^{-1}\| (\|\underline{f}\| + \|F\| \cdot \|\underline{x}\|) + O(\varepsilon^2) \\
 &= \|\underline{x}\| |\varepsilon| \|A^{-1}\| \left( \frac{\|\underline{f}\|}{\|\underline{x}\|} + \|F\| \right) + O(\varepsilon^2)
 \end{aligned}$$

Din (1), rezultă:

$$\|\underline{b}\| = \|A\underline{x}\| \leq \|A\| \cdot \|\underline{x}\| \Rightarrow$$

$$\boxed{\frac{1}{\|\underline{x}\|} \leq \frac{\|A\|}{\|\underline{b}\|}} \quad (5)$$

$$\begin{aligned}
 (5) &\leq \|\Sigma\| |\varepsilon| \|A^{-1}\| \left( \frac{\|\varepsilon f\|}{\|\underline{b}\|} \|A\| + \|F\| \right) + O(\varepsilon^2) \\
 &= \|\Sigma\| \underbrace{(\|A\| \cdot \|A^{-1}\|)}_{=: \kappa(A)} \left( \frac{|\varepsilon| \|\varepsilon f\|}{\|\underline{b}\|} + \frac{|\varepsilon| \|F\|}{\|A\|} \right) + O(\varepsilon^2) \\
 &= \|\Sigma\| \kappa(A) \left( \frac{\|\varepsilon f\|}{\|\underline{b}\|} + \frac{\|F\|}{\|A\|} \right) + O(\varepsilon^2) \Rightarrow
 \end{aligned}$$

Numărul de condiționare al lui A

Așa că obținem

$$\frac{\|\Sigma(\varepsilon) - \Sigma\|}{\|\Sigma\|} \leq \kappa(A) \left( \frac{\|\varepsilon F\|}{\|A\|} + \frac{\|\varepsilon f\|}{\|\underline{b}\|} \right) + O(\varepsilon^2) \quad (6)$$

i.e. numărul de condiționare al lui A,  $\kappa(A)$ , este o măsură a stabilității sistemului liniar (1) !

DEFINITION: Numărul de condiționare al lui  $A \in \mathbb{M}_n(\mathbb{R})$  asoc. normei matriciale  $\|\cdot\|$  pe  $\mathbb{M}_n(\mathbb{R})$  induată de normea vectorială

$\| \cdot \|$  pe  $\mathbb{R}^n$

$$k(A) := \begin{cases} \|A\| \|A^{-1}\|, & A \text{ inversabilă} \\ +\infty, & A \text{ neinversabilă} \end{cases} \quad (\Rightarrow)$$

OBS:

1) În general,  $k_p(A) := \|A\|_p \|A^{-1}\|_p$ , unde  $\| \cdot \|_p$  este normă matricială induată de normă vectorială  $\| \cdot \|_p$  pe  $\mathbb{R}^n$ ,  $p \in \{1, 2, \infty\}$ .

2) Pentru orice normă matricială induată de o normă vectorială,  $k(A) \geq 1$

Dece:

$$1 = \|I_n\| = \|A \cdot A^{-1}\| \leq \|A\| \cdot \|A^{-1}\| =: k(A)$$

↑  
pt orice normă matricială  
indusă de o normă vectorială

□

3)  $k(A)$  mare  $\Rightarrow A \in \mathcal{U}_n(\mathbb{R})$  rău conditionat;

$k(A)$  mic  $\Rightarrow A \in \mathcal{U}_n(\mathbb{R})$  bine conditionat.

4)  $k(A^{-1}) = k(A)$ ,  $\forall A \in \mathcal{U}_n(\mathbb{R})$

$$5) \quad \kappa(\alpha A) = \kappa(A), \quad \forall A \in U_n(\mathbb{R}), \quad \forall \alpha \in \mathbb{R}^*$$

$$6) \quad \kappa_p, \quad p \in \{1, 2, \infty\}, \quad \text{Sind äquivalente.}$$

Mai mehr, alle drei Relativen:

$$\frac{1}{n} \kappa_2(A) \leq \kappa_1(A) \leq n \kappa_2(A), \quad \forall A \in U_n(\mathbb{R})$$

$$\frac{1}{n} \kappa_\infty(A) \leq \kappa_2(A) \leq n \kappa_\infty(A), \quad \forall A \in U_n(\mathbb{R}) \quad (B)$$

$$\frac{1}{n^2} \kappa_1(A) \leq \kappa_\infty(A) \leq n^2 \kappa_1(A), \quad \forall A \in U_n(\mathbb{R})$$

Denn : EX!

# DETERMINANTUL și APROAPE SINGULARITATEA

Motivatie:

Stim  $\det A = 0 \Leftrightarrow A$  singulară.

Așa că,  $\det A \approx 0 \Leftrightarrow A$  aproape singulară?

$$1) \quad B_n := \begin{vmatrix} 1 & -1 & -1 & \dots & -1 \\ 0 & 1 & -1 & \dots & -1 \\ 0 & 0 & 1 & \dots & -1 \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & \dots & 1 \end{vmatrix} \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R}) \Rightarrow$$

$\det B_n = 1$  și  $K_{\infty}(B_n) = n^{2^{n-1}}$ , i.e. nu

există corelație între  $\det B_n$  și  $K_{\infty}(B_n)$ !

$$2) D_n := \text{diag} (10^{-1}, 10^{-1}, \dots, 10^{-1}) \in \mathcal{M}_n(\mathbb{R}) \Rightarrow$$

$\det D_n = 10^{-n}$  și  $K_p(D_n) = 1$ , i.e. nu

există corelație între  $\det D_n$  și  $K_p(D_n)$ !

# ESTIMARE RIGUROASĂ A SENZITIVITĂȚII / STABILITĂȚII SISTEMELOR LINIARE PĂTRATICE

Relația (6) arată legătura dintre  $\kappa(A)$  și  
viteza de variație a lui  $\underline{x}(\varepsilon)$  la  $\varepsilon = 0$ , i.e.  
 $\frac{\|\underline{x}(\varepsilon) - \underline{x}\|}{\|\underline{x}\|}$ . Cu toate acestea, relația (6)

deplinește de calegea lui  $\varepsilon$  "suficient de mică"  
și nu discută mărimea termenului  $O(\varepsilon^2)$ ,  
i.e. un inconvenient!

## LEMA #1:

$$A\underline{x} = \underline{b} \Rightarrow \begin{cases} A \in \mathcal{U}_n(\mathbb{R}) \text{ inversabilă} \\ \underline{b} \in \mathbb{R}^n \setminus \{\underline{0}_n\} \end{cases}$$

$$(A + \Delta A)\underline{y} = \underline{b} + \Delta \underline{b}, \quad \begin{cases} \Delta A \in \mathcal{U}_n(\mathbb{R}): \|\Delta A\| \leq \varepsilon \|A\| \\ \Delta \underline{b} \in \mathbb{R}^n: \|\Delta \underline{b}\| \leq \varepsilon \|\underline{b}\| \end{cases}$$

Dacă  $\varepsilon \kappa(A) =: r < 1$ , atunci

(i)  $A + \Delta A \in \mathcal{U}_n(\mathbb{R})$  inversabilă;

$\frac{\ \underline{y}\ }{\ \underline{x}\ } \leq \frac{1+r}{1-r}$	(9)
--	-----

Def:

$$(i) \|A^T \Delta A\| \leq \|A^{-1}\| \cdot \|\Delta A\| \leq \|A^{-1}\| \cdot \Sigma \|A\| = \\ = \Sigma (\|A\| \|A^{-1}\|) = \Sigma \kappa(A) =: r < 1 \Rightarrow$$

Theorem  $(E := A^{-1} \Delta A) \Rightarrow A + \Delta A \text{ } \underline{\text{um}}$

$$(ii) A + \Delta A = A(I_n + A^{-1} \Delta A) \Rightarrow$$

Sistemul perturbat devine

$$A(I_n + A^{-1} \Delta A) y = b + \Delta b$$

$$(I_n + A^{-1} \Delta A) y = A^{-1}(b + \Delta b)$$

$$(I_n + A^{-1} \Delta A) y = x + A^{-1} \Delta b$$

Pentru urmare obținem :

$$\boxed{y = (I_n + A^{-1} \Delta A)^{-1}(x + A^{-1} \Delta b)} \Rightarrow$$

$$\|y\| = \|(I_n + A^{-1} \Delta A)^{-1}(x + A^{-1} \Delta b)\| \\ \leq \|(I_n + A^{-1} \Delta A)^{-1}\| \underbrace{(\|x\| + \|A^{-1}\| \cdot \|\Delta b\|)}_{\leq \Sigma \|b\|} \\ \leq \frac{1}{1 - \|A^{-1} \Delta A\|} (\|x\| + \|A^{-1}\| \Sigma \|b\|)$$

Lema Banach

$$= \frac{1}{1 - \|A^{-1} \Delta A\|} \left( \|x\| + \|A^{-1}\| \frac{r}{\|A\| \cdot \|A^{-1}\|} \|b\| \right)$$

$$r := \Sigma K(A) = \Sigma \|A\| \cdot \|A^{-1}\|$$

$$= \frac{1}{1 - \|A^{-1} \Delta A\|} \left( \|x\| + r \frac{\|b\|}{\|A\|} \right)$$

$$= \frac{1}{1 - \|A^{-1} \Delta A\|} \left( \|x\| + r \frac{\|A \bar{x}\|}{\|A\|} \right)$$

$$\leq \frac{1}{1 - \|A^{-1} \Delta A\|} \left( \|x\| + r \frac{\|A\| \cdot \|x\|}{\|A\|} \right)$$

$$= \|x\| \frac{1+r}{1 - \|A^{-1} \Delta A\|} \stackrel{(*)}{\leq} \frac{1+r}{1-r} \|x\|$$

Cf. i),  $\|A^{-1} \Delta A\| \leq r \Rightarrow 1-r \leq 1 - \|A^{-1} \Delta A\|$

$$\Rightarrow \boxed{\frac{1}{1 - \|A^{-1} \Delta A\|} \leq \frac{1}{1-r}} \quad (*)$$

Picu urmare, am obtinut

$$\|y\| \leq \frac{1+r}{1-r} \|x\| \Rightarrow$$

$$\boxed{\frac{\|y\|}{\|x\|} \leq \frac{1+r}{1-r}} \quad (*)$$

□

## TEOREMA #1:

În ipotezele Lemei #1, are loc estimarea

$$\boxed{\frac{\|y - \bar{x}\|}{\|\bar{x}\|} \leq \frac{2r}{1-r}} \quad (10)$$

unde  $r := \varepsilon \kappa(A) < 1$

Dem: Se căsează sistemul neperturbat din cel perturbat și obținem

$$A(y - \bar{x}) + (\Delta A)y = \Delta b$$

$$A(y - \bar{x}) = \Delta b - (\Delta A)y$$

$$y - \bar{x} = A^{-1}[\Delta b - (\Delta A)y]$$

$$\boxed{y - \bar{x} = A^{-1}(\Delta b) - (A^{-1}\Delta A)y}$$

Astăzi, rezultă

$$\begin{aligned} \|y - \bar{x}\| &= \|A^{-1}(\Delta b) - (A^{-1}\Delta A)y\| \\ &\leq \|A^{-1}(\Delta b)\| + \|(A^{-1}\Delta A)y\| \\ &\leq \underbrace{\|A^{-1}\|}_{\leq \varepsilon} \underbrace{\|\Delta b\|}_{\leq \varepsilon \|b\|} + \underbrace{\|A^{-1}\|}_{\leq \varepsilon} \underbrace{\|\Delta A\|}_{\leq \varepsilon \|\Delta\|} \|y\| \\ &\leq \varepsilon \|b\| \end{aligned}$$

$$\leq \|A^{-1}\| \|\Sigma\| \|b\| + \|A^{-1}\| \|\Sigma\| \|Ax\| \|y\|$$

$$= \underbrace{\left( \|A^{-1}\| \|Ax\| \right)}_{= K(A)} \left( \frac{\|b\|}{\|Ax\|} + \|y\| \right)$$

$$= \sum K(A) \left( \frac{\|Ax\|}{\|Ax\|} + \|y\| \right)$$

$$\leq \sum K(A) \left( \frac{\|Ax\| \|x\|}{\|Ax\|} + \|y\| \right)$$

$$= \sum K(A) \|x\| \left( 1 + \frac{\|y\|}{\|x\|} \right)$$

$$\stackrel{\uparrow}{\leq} \sum K(A) \|x\| \left( 1 + \frac{1+r}{1-r} \right)$$

Lemmat#1

$$= \frac{2\varepsilon}{1-r} \sum K(A) \|x\| = \frac{2r}{1-r} \|x\| \Rightarrow$$

$$\sum K(A) =: r$$

$$\Rightarrow \boxed{\frac{\|y - x\|}{\|x\|} \leq \frac{2r}{1-r}} \quad (10)$$

□

### OBS:

- 1) Dacă  $A \in \mathbb{M}_n(\mathbb{R})$  este bine condiționată, i.e.  $\kappa(A)$  mic, atunci uici perturbări ale datelor sistemului neperturbat ( $A \in \mathbb{M}_n(\mathbb{R})$ ,  $b \in \mathbb{R}^n$ ) determină o soluție a sistemului perturbat,  $y \in \mathbb{R}^n$ , care aproximarea bine soluția sistemului neperturbat,  $x := A^{-1}b \in \mathbb{R}^n$ .
- 2) Dacă  $A \in \mathbb{M}_n(\mathbb{R})$  este nău condiționată, i.e.  $\kappa(A)$  mare, atunci uici perturbări ale datelor sistemului neperturbat pot genera o soluție a sistemului perturbat,  $y \in \mathbb{R}^n$ , care aproximarea incărcătă soluția sistemului neperturbat  $x := A^{-1}b \in \mathbb{R}^n$ .
- 3) În ipotezele Teoremei #1, pentru  $b \in \mathbb{R}^n$ 

$$\Delta b \leftarrow \underline{0}_n \text{ și } \underline{x} \leftarrow X := A^{-1}\underline{f}_{\mathbb{M}_n(\mathbb{R})}$$
obținem
$$\begin{cases} Ax = I_n \\ (A + \Delta A)Y = I_n \end{cases}$$

$$A^{-1}(A + \Delta A) Y = A^{-1} I_n$$

$$(I_n + A^{-1} \Delta A) Y = A^{-1} (AX)$$

$$(I_n + A^{-1} \Delta A) Y = A^{-1} (AX)$$

$$Y = (I_n - A^{-1} \Delta A)^{-1} A^{-1} (AX) \Rightarrow$$

$$\|Y\| \leq \|(I_n - A^{-1} \Delta A)^{-1}\| \|A^{-1}\| \|A\| \|X\|$$

$$\leq \frac{1}{1-\gamma} \kappa(A) \|X\| \Rightarrow$$

$$\|Y\| \leq \frac{\kappa(A)}{1-\gamma} \|X\|,$$

$$\begin{cases} X := A^{-1} \\ Y := A^{-1} + \Delta(A^{-1}) \end{cases}$$

(11)