

## Итерационные методы решения систем линейных уравнений

Итерационные методы решения систем линейных уравнений отличаются самоисправляемостью и простотой реализации на ЭВМ. Итерационные методы требуют задания начальных приближений. Сходимость итерационных методов зависит от свойств матрицы системы и выбора начальных приближений.

Рассматривается следующая система:

$$Ax = f, \quad (1)$$

где  $A = [a_{ij}]$   $i, j = 1, 2, \dots, m$ ,  $x = (x_1, x_2, \dots, x_m)^T$ ,  $f = (f_1, f_2, \dots, f_m)^T$ .

### 1. Метод итераций

Перед применением метода итераций систему (1) необходимо привести к эквивалентному виду

$$x = Bx + C. \quad (2)$$

Метод итераций для системы (2) имеет вид

$$x^{n+1} = Bx^n + C.$$

**Теорема.** Если  $\|B\| < 1$ , где  $\|B\| = \max_i \sum_{k=1}^m |a_{ik}|$  то метод итераций сходится при любом начальном приближении  $x^0$  со скоростью геометрической прогрессии.

В качестве начального приближения обычно выбирается вектор свободных членов  $C$ , тогда для оценки числа итераций, необходимых для достижения заданной точности, можно использовать формулу

$$\|x^n - x\| \leq \frac{\|B\|^{n+1}}{1 - \|B\|} \|C\| \quad (3)$$

**Пример.** Методом итераций решить систему линейных уравнений

$$\begin{cases} x_1 = 0,32x_1 - 0,05x_2 + 0,11x_3 - 0,08x_4 + 2,15, \\ x_2 = 0,11x_1 + 0,16x_2 - 0,28x_3 - 0,06x_4 - 0,83, \\ x_3 = 0,08x_1 - 0,15x_2 + 0,12x_4 + 1,16, \\ x_4 = -0,21x_1 + 0,13x_2 - 0,27x_3 + 0,44, \end{cases}$$

предварительно оценив число необходимых для этого шагов,  $\varepsilon = 10^{-3}$ .

Число шагов, дающих ответ с точностью до 0,001, определим из соотношения (3). Здесь

$$B = \begin{pmatrix} 0,32 & -0,05 & 0,11 & -0,08 \\ 0,11 & 0,16 & -0,28 & -0,06 \\ 0,08 & -0,15 & 0 & 0,12 \\ -0,21 & 0,13 & -0,27 & 0 \end{pmatrix},$$

$$\|B\| = \max\{0,56; 0,61; 0,35; 0,61\} < 1; \text{ значит, итерационный процесс сходится;}$$

$$C = (2,15 \quad -0,83 \quad 1,16 \quad 0,44)^T,$$

$$\|C\| = 2,15. \text{ Имеем}$$

$$\frac{0,61^{k+1}}{0,39} \cdot 2,15 < 0,001; \quad 0,61^{k+1} < \frac{0,001 \cdot 0,39}{2,15}; \quad (k+1) \cdot \lg 0,61 < -3 + \lg 0,39 - \lg 2,15;$$

$$k+1 > \frac{3,7413}{0,2147} \approx 17,5; \quad k \geq 17.$$

В качестве нулевого приближения выбираем вектор С.

Вычисления расположим в таблице

$k$	$x_1$	$x_2$	$x_3$	$x_4$
0	2,15	-0,83	1,16	0,44
1	2,9719	-1,0775	1,5093	-0,4326
2	3,3555	-1,0721	1,5075	-0,7317
3	3,5017	-0,0106	1,5015	-0,8111
4	3,5511	-0,9277	1,4944	-0,8312
5	3,5637	-0,9563	1,4834	-0,8298
6	3,5678	-0,9566	1,4890	-0,8332
7	3,5700	-0,9575	1,4889	-0,8356
8	3,5709	-0,9573	1,4890	-0,8362
9	3,5712	-0,9571	1,4889	-0,8364
10	3,5713	-0,9570	1,4890	-0,8364

## 2. Метод Якоби

Метод Якоби для системы (1) в координатной форме имеет вид

$$x_i^{n+1} = -\frac{1}{a_{ii}} \left( \sum_{j \neq i} a_{ij} x_j^n + f_i \right), \quad i = 1, \dots, m$$

**Теорема.** Пусть  $A$  - матрица с диагональным преобладанием, то есть

$$|a_{ii}| > \sum_{i \neq j} a_{ij}.$$

Тогда метод Якоби сходится.

Если систему (1) представить в виде (2), то можно оценить количество итераций по формуле (3).

**Пример.** Методом Якоби решить систему линейных уравнений

$$\begin{cases} 2x_1 - 1,8x_2 + 0,4x_3 = 1 & (I) \\ 3x_1 + 2x_2 - 1,1x_3 = 0 & (II) \\ x_1 - x_2 + 7,3x_3 = 0 & (III) \end{cases}$$

предварительно приведя матрицу системы к матрице с диагональным преобладанием и оценить число необходимых шагов для достижения точности 0,001.

Приведем систему к виду, в котором элементы главной диагонали превосходили бы остальные элементы строк:

$$\begin{cases} 25x_1 + x_2 - 3,5x_3 = 5 & (5I + 5II) \\ -9,4x_2 + 3,4x_3 = 3 & (3I + 2II) \\ x_1 - x_2 + 7,3x_3 = 0 & (III) \end{cases}$$

Для оценки числа итераций запишем эту систему в виде (2), поделив каждое уравнение на диагональный элемент:

$$\begin{cases} x_1 = -0,04x_2 + 0,41x_3 - 0,2 \\ x_2 = 0,36x_3 - 0,32 \\ x_3 = 0,14x_2 - 0,14x_1 \end{cases}$$

Число шагов, дающих ответ с точностью до 0,001, определяется из соотношения (3). Здесь

$$B = \begin{pmatrix} 0 & -0,04 & 0,41 \\ 0 & 0 & 0,36 \\ 0 & 0,14 & 0,14 \end{pmatrix},$$

$$\|B\| = \max\{0,45; 0,36; 0,28\} = 0,45;$$

$$C = (-0,2 \quad -0,32 \quad -0,14)^T,$$

$$\|C\| = 0,32. \text{ Имеем}$$

$$\frac{0,45^{k+1}}{0,55} \cdot 0,32 < 0,001; \quad 0,45^{k+1} < \frac{0,001 \cdot 0,55}{0,32}; \quad (k+1) \cdot \lg 0,45 < -3 + \lg 0,55 - \lg 0,32;$$

$$k > 19.$$

Нулевое приближение  $x^0 = C$ ;

Вычислим первое приближение

$$x_i^1 = -\frac{1}{a_{ii}} \left( \sum_{j \neq i} a_{ij} x_j^0 + f_i \right) \quad x_i^1 = i = 1, 2$$

где  $a_{ij}$  - элементы матрицы

$$A = \begin{pmatrix} 25 & 1 & -3,5 \\ 0 & -9,4 & 3,4 \\ 1 & -1 & 7,3 \end{pmatrix},$$

а  $f_i$  - элементы вектора  $f = (5 \quad 3 \quad 0)^T$ .

$$x_1^1 = -\frac{1}{25} (1 - 3,5)x_1^0 + f_1, \quad x_1^1 = -0,22.$$

$$x_2^1 = \frac{1}{9,4} (3,4x_2^0 + f_2), \quad x_2^1 = 0,2034.$$

$$x_3^1 = -\frac{1}{7,3} ((1-1)x_1^0 + f_3), \quad x_3^1 = 0.$$

Для окончания вычислений нужно произвести 20 итераций.

### 3. Метод простой итерации

Метод простой итерации для системы (1) имеет вид

$$x^{n+1} = (E - \tau A)x^n + \tau f$$

или в канонической форме

$$\frac{x^{n+1} - x^n}{\tau} - Ax^n = f,$$

где  $\tau > 0$  - постоянный итерационный параметр.

**Теорема.** Если  $A$  - симметричная положительно определенная матрица, тогда метод простой итерации сходится при  $0 < \tau < \frac{2}{\lambda_{\max}}$ .

**Теорема.** Если  $\|B\| < 1$ , где  $B = (E - \tau A)$ , то метод простой итерации сходится.

**Пример.** Пусть матрица  $A$  имеет вид

$$A = \begin{pmatrix} 4 & -1 & 0 \\ -1 & 3 & 1 \\ 0 & 2 & 6 \end{pmatrix},$$

тогда

$$B = \begin{pmatrix} 1-4\tau & \tau & 0 \\ \tau & 1-3\tau & -\tau \\ 0 & -2\tau & 1-6\tau \end{pmatrix};$$

$\|B\|_{\infty} = \max\{1-3\tau \quad 1-\tau \quad 1-4\tau\}$ . (складываются модули элементов в каждой строке)

Выберем  $\tau$  так, чтобы выполнялось условие сходимости  $\|B\| < 1$ .

$$\tau = \frac{1}{9}.$$

Число итераций, необходимое для заданной точности, можно вычислить как в случае метода итераций.

#### 4. Метод Зейделя

Итерационный метод Зейделя для системы (1) в координатной форме имеет вид

$$x_k^{n+1} = \frac{1}{a_{kk}} \left( f_k - \sum_{j>k} a_{kj} x_j^n - \sum_{j<k} a_{kj} x_j^{n+1} \right), \quad k = 1, \dots, m$$

**Теорема.** Если  $A$  - матрица с диагональным преобладанием, тогда метод Зейделя сходится для любого начального приближения.

**Теорема.** Если  $A$  - симметричная положительно определенная матрица, тогда метод Зейделя сходится.

**Пример.** Методом Зейделя решить с точностью 0,001 систему линейных уравнений

$$\begin{cases} 4,5x_1 - 1,8x_2 + 3,6x_3 = -1,7 & (I) \\ 3,1x_1 + 2,3x_2 - 1,2x_3 = 3,6 & (II) \\ 1,8x_1 + 2,5x_2 + 4,6x_3 = 2,2 & (III) \end{cases}$$

приведя ее к виду, удобному для итераций.

Приведем систему к виду, в котором элементы главной диагонали превосходили бы остальные элементы строк

$$\begin{cases} 7,6x_1 + 0,5x_2 + 2,4x_3 = 1,9 & (I + II) \\ 2,2x_1 + 9,1x_2 + 4,4x_3 = 9,7 & (2III + II - I) \\ -1,3x_1 + 0,2x_2 + 5,8x_3 = -1,4 & (III - II) \end{cases}$$

Нулевое приближение  $x^0 = (1,9 \quad 9,7 \quad -1,4)^T$ .

Первое приближение

$$x_1^1 = \frac{1}{7,6} (1,9 - 0,5 * 2,7 + 2,4 * 1,4) = 0,5145$$

$$x_2^1 = \frac{1}{9,1} (9,7 + 4,4 * 1,4 - 2,2 * 0,5145) = 1,6185$$

$$x_3^1 = \frac{1}{5,8} (-1,4 + 1,3 * 0,5145 - 0,2 * 1,6185) = -0,1819$$

и т.д.

Окончание вычислений определяется условием

$$\max_{1 \leq i \leq m} |x_i^{n+1} - x_i^n| < \varepsilon,$$

где  $\varepsilon > 0$  - заданное число.

### 5. Метод верхней релаксации

Метод верхней релаксации является обобщением метода Зейделя. В координатной форме метод верхней релаксации имеет следующий вид

$$x_i^{n+1} + \omega \sum_{j < i} \frac{a_{ji}}{a_{ii}} x_j^{n+1} = (1 - \omega) x_i^n - \omega \sum_{j > i} \frac{a_{ji}}{a_{ii}} x_j^n + \omega \frac{d_i}{a_{ii}}, \quad i = 1, \dots, 2$$

При  $\omega = 1$  этот метод совпадает с методом Зейделя.

**Теорема.** Если  $A$  - симметричная положительно определенная матрица, тогда метод верхней релаксации сходится при  $0 < \omega < 2$ .

Окончание вычислений определяется условием

$$\max_{1 \leq i \leq m} |x_i^{n+1} - x_i^n| < \varepsilon,$$

где  $\varepsilon > 0$  - заданное число.

### 6. Метод минимальных невязок

Метод минимальных невязок определен для систем уравнений с симметричной положительно определенной матрицей  $A$ . Этот метод определяется формулой

$$x^{n+1} = x^n - \tau_{n+1} (Ax^n - f), \quad (4)$$

где параметр  $\tau_{n+1}$  выбирается из условия минимума  $\|r^{n+1}\| = \|Ax^{n+1} - f\|$  при заданной норме  $\|r^n\|$ :

$$\tau_{n+1} = \frac{(Ar^n, r^n)}{\|Ar^n\|^2}, \quad r^n = Ax^n - f$$

**Теорема.** Если  $A$  - симметричная положительно определенная матрица, тогда метод минимальных невязок сходится.

Окончание вычислений определяется условием

$$\max_{1 \leq i \leq m} |x_i^{n+1} - x_i^n| < \varepsilon,$$

где  $\varepsilon > 0$  - заданное число.

### 7. Метод скорейшего спуска

Если в формуле (4) итерационный параметр  $r^{k+1}$  выбирается из условия минимума  $\|z_{k+1}\|_A = \|x^{k+1} - x\|_A$ , где  $\|x\|_A = \sqrt{(Ax, x)}$  при заданном  $z_k$ , то этот метод называется методом скорейшего спуска. Итерационные параметры вычисляются по формуле

$$r^{k+1} = \frac{(r_k, r_k)}{(Ar_k, r_k)}, \quad r_k = Ax^k - f.$$

**Теорема.** Пусть  $A$  - симметричная положительно определенная матрица, тогда метод скорейшего спуска сходится.

Окончание вычислений определяется условием

$$\max_{1 \leq i \leq m} |x_i^{n+1} - x_i^n| < \varepsilon,$$

где  $\varepsilon > 0$  - заданное число.

### *Задачи*

Методом итераций решить системы линейных уравнений, предварительно приведя их к виду, удобному для итераций и оценив число необходимых для этого шагов,  $\varepsilon = \frac{1}{2} \cdot 10^{-3}$ .

№ 1.

$$\begin{cases} -0,32x_1 - 1,27x_2 + 0,27x_3 - 0,18x_4 = -0,36 \\ 0,45x_1 - 1,23x_2 + 0,06x_3 = 0,88 \\ 0,31x_1 + 0,08x_2 - 0,77x_3 - 1,12x_4 = 0,55 \\ 0,05x_1 - 0,26x_2 - 0,34x_3 - 1,12x_4 = 1,17 \end{cases}$$

№ 2.

$$\begin{cases} -0,79x_1 + 0,31x_2 - 0,72x_4 = -0,11 \\ 0,56x_1 - x_2 - 1,31x_3 + 0,85x_4 = -0,52 \\ 0,11x_1 - 1,08x_3 + 0,78x_4 = -0,85 \\ 0,08x_1 + 0,09x_2 + 0,33x_3 - 0,79x_4 = 1,7 \end{cases}$$

№ 3.

$$\begin{cases} -x_1 + 0,24x_2 - 0,48x_3 + 0,23x_4 = 0,39 \\ -0,05x_1 - x_2 + 0,44x_3 + 0,31x_4 = 0,72 \\ -1,1x_1 + 0,27x_2 - 1,48x_3 - 0,32x_4 = 0,95 \\ -0,88x_1 + 0,17x_2 - 0,37x_3 - 0,77x_4 = 0,86 \end{cases}$$

№ 4.

$$\begin{cases} -x_1 + 0,22x_2 - 0,11x_3 + 0,31x_4 = -2,7 \\ -0,62x_1 - 0,78x_2 - 0,23x_3 + 0,53x_4 = -1,2 \\ 0,28x_1 + 0,22x_2 - 0,69x_3 - 1,51x_4 = -1,03 \\ 0,17x_1 - 0,21x_2 + 0,31x_3 - x_4 = 0,17 \end{cases}$$

Методом Якоби решить системы линейных уравнений, предварительно приведя матрицу системы к матрице с диагональным преобладанием и оценив число необходимых шагов для достижения точности 0,001.

№ 5.

$$\begin{cases} 2,3x_1 + 1,1x_2 + 0,23x_3 = 3,3 \\ -2x_1 + 1,3x_2 + 1,77x_3 = -0,7 \\ 2,5x_1 + 3,2x_2 + 2,73x_3 = 7,7 \end{cases}$$

№ 6.

$$\begin{cases} -2,4 x_1 + x_2 + 1,2 x_3 = 5,1 \\ 0,93 x_1 - 2,5 x_2 + 5,8 x_3 = 11,1 \\ 1,2 x_1 + 1,3 x_2 + 1,4 x_3 = 1,5 \end{cases}$$

№ 7.

$$\begin{cases} 1,3 x_1 - 0,3 x_2 + 3,8 x_3 = 3,9 \\ 4,63 x_1 - 4 x_2 + 3,4 x_3 = 9,9 \\ 1,2 x_1 + 1,3 x_2 - 2,6 x_3 = 1,5 \end{cases}$$

№ 8.

$$\begin{cases} 2,15 x_1 + 2,3 x_2 - 0,3 x_3 = 4 \\ 0,25 x_1 + 2,5 x_2 - 1,3 x_3 = 2,5 \\ -0,3 x_1 + 3,9 x_2 + 1,2 x_3 = 4,5 \end{cases}$$

Методом простой итерации решить систему линейных уравнений с точностью до 0,001.

№ 9.

$$\begin{cases} 2,8x_1 - 0,2x_2 - 0,4x_3 + 1,2x_4 = 2,23 \\ 0,42x_1 + 3,7x_2 - 1,5x_3 - 0,11x_4 = 1,71 \\ 0,05x_1 - 0,13x_2 + 2,2x_3 + 1,3x_4 = -0,54 \\ -1,2x_1 - 1,1x_2 + 2x_3 + 4,7x_4 = 0,65 \end{cases}$$

№ 10.

$$\begin{cases} 3,3x_1 + 1,2x_2 - 0,07x_3 + x_4 = 0,23 \\ 0,1x_1 + 2,7x_2 + 0,3x_3 - 1,2x_4 = 7,2 \\ 0,5x_1 - 0,5x_2 + 2,2x_3 + 0,5x_4 = -0,22 \\ 0,2x_1 - 0,3x_2 - 0,4x_3 + 1,8x_4 = -0,6 \end{cases}$$

№ 11.

$$\begin{cases} 3,4x_1 + 1,1x_2 + 0,2x_3 - 1,2x_4 = 2 \\ -0,7x_1 + 3,3x_2 - 0,3x_3 + 2x_4 = 1,9 \\ 0,4x_1 + 0,3x_2 + 2,6x_3 + 0,2x_4 = -0,4 \\ -0,2x_1 + 0,6x_2 + 0,4x_3 + 1,7x_4 = -6,5 \end{cases}$$

№ 12.

$$\begin{cases} 2,5x_1 - 0,12x_2 + 2,2x_3 + 0,2x_4 = -1,2 \\ 1,2x_1 + 3x_2 + x_3 - 1,5x_4 = 0,1 \\ 0,2x_1 - 0,4x_2 + 2,5x_3 + 0,7x_4 = -0,4 \\ 0,3x_1 + 0,7x_2 - 0,8x_3 + 3,7x_4 = 0,6 \end{cases}$$

Методом Зейделя решить системы линейных уравнений, приведя их к виду, удобному для итераций,  $\varepsilon = \frac{1}{2} \cdot 10^{-3}$ .

№ 13.

$$\begin{cases} 2,7x_1 + 0,9x_2 - 1,5x_3 = 3,5 \\ 4,5x_1 - 2,8x_2 + 6,7x_3 = 2,6 \\ 5,1x_1 + 3,7x_2 - 1,4x_3 = -0,14 \end{cases}$$

№ 14.

$$\begin{cases} 3,8x_1 + 6,7x_2 - 1,2x_3 = 5,2 \\ 6,4x_1 + 1,3x_2 - 2,7x_3 = 3,8 \\ 2,4x_1 - 4,5x_2 + 3,5x_3 = -0,6 \end{cases}$$

№ 15.

$$\begin{cases} 3,2x_1 - 11,5x_2 + 3,8x_3 = 2,8 \\ 0,8x_1 + 1,3x_2 - 6,4x_3 = -6,5 \\ 2,4x_1 + 7,2x_2 - 1,2x_3 = 4,5 \end{cases}$$

№ 16.

$$\begin{cases} 5,6x_1 + 2,7x_2 - 1,7x_3 = 1,9 \\ 3,4x_1 - 3,6x_2 - 6,7x_3 = -2,4 \\ 0,8x_1 + 1,3x_2 + 3,7x_3 = 1,2 \end{cases}$$

Методом верхней релаксации решить системы линейных уравнений, приведя их к виду, удобному для итераций,  $\varepsilon = \frac{1}{2} \cdot 10^{-3}$ .

№ 17.

$$\begin{cases} 2,7x_1 + 3,3x_2 + 1,3x_3 = 2,1 \\ 3,5x_1 - 1,7x_2 + 2,8x_3 = 1,7 \\ 4,1x_1 + 5,8x_2 - 1,7x_3 = 0,8 \end{cases}$$

№ 18.

$$\begin{cases} 3,6x_1 + 1,8x_2 - 4,7x_3 = 3,8 \\ 2,7x_1 - 3,6x_2 + 1,9x_3 = 0,4 \\ 1,5x_1 + 4,5x_2 + 3,3x_3 = -1,6 \end{cases}$$

№ 19.

$$\begin{cases} 3,7x_1 - 2,3x_2 + 4,5x_3 = 2,4 \\ 2,5x_1 + 4,7x_2 - 7,8x_3 = 3,5 \\ 1,6x_1 + 5,3x_2 + 1,3x_3 = -2,4 \end{cases}$$

№ 20.

$$\begin{cases} 2,4x_1 + 3,7x_2 - 8,3x_3 = 2,3 \\ 1,8x_1 + 4,3x_2 + 1,2x_3 = -1,2 \\ 3,4x_1 - 2,3x_2 + 5,2x_3 = 3,5 \end{cases}$$

Решить системы линейных уравнений методом минимальных невязок и методом скорейшего спуска,  $\varepsilon = \frac{1}{2} \cdot 10^{-3}$ .

№ 21.



№ 22.

$$\begin{cases} 2,74x_1 - 1,18x_2 + 1,23x_3 = 0,16 \\ -1,18x_1 + 1,71x_2 - 0,52x_3 = 1,81 \\ 1,23x_1 - 0,52x_2 + 0,62x_3 = -1,25 \end{cases}$$

$$\begin{cases} 1,17x_1 - 0,65x_2 + 1,54x_3 = -1,43 \\ -0,65x_1 + 1,16x_2 - 1,33x_3 = 0,68 \\ 1,54x_1 - 1,33x_2 + 2,15x_3 = 1,87 \end{cases}$$

№ 23.

$$\begin{cases} 3,74x_1 + 0,86x_2 + 1,13x_3 = 1,13 \\ 0,86x_1 + 1,71x_2 - 0,49x_3 = 1,88 \\ 1,13x_1 - 0,49x_2 + 1,26x_3 = -0,25 \end{cases}$$

№ 24.

$$\begin{cases} 2,01x_1 - 0,53x_2 + 1,13x_3 = -2,09 \\ -0,53x_1 + 1,62x_2 - 1,03x_3 = 0,39 \\ 1,13x_1 - 1,03x_2 + 2,34x_3 = 2,13 \end{cases}$$