Tarea 9 Métodos Numéricos

Carlos Giovanny Encinia González

3 de octubre 2021

Resumen

En esta tarea se muestran los métodos iterativos para encontrar los eigenvalores y eigenvectores dominante y menores de una matriz. También se muestra la manera de encontrar un numero de eigenvalores sabiendo uno de los eigenvalores dominantes de la matriz.

Desarrollo

Método de la potencia

Primero definiremos el problema de valores y vectores propios.

$$Ax = \lambda x \tag{1}$$

Donde x es llamado vector propio y λ es el valor propio.

Para calcular los valores propios, podemos utilizar el determinante de la siguiente manera.

Primero de la ecuación (1) pasamos el termino con el valor propio hacia la izquierda.

$$Ax - \lambda x = 0 \tag{2}$$

Factorizando nos queda

$$x(A - \lambda I) = 0 (3)$$

Si queremos que la solución no sea trivial debemos hacer que

$$|A - \lambda I| = 0 \tag{4}$$

Ahora si quisiéramos encontrar e valor propio dominante o valor propio con mayor valor absoluto y su correspondiente vector propio podemos utilizar el método de la potencia que es como se describe a continuación.

Primero como hemos dicho antes se tiene que:

$$|\lambda_n| > |\lambda_{n-1}| > \dots > |\lambda_1| \tag{5}$$

Ahora Denotaremos como x_i al vector propio asociado a λ_i Proponemos que

$$v_1 = Av_0 \tag{6}$$

Pero v_0 puede ser escrito como una combinación lineal de los vectores propios de la matriz, entonces tenemos que:

$$v_1 = A \sum_{i=1}^n a_i x_i \tag{7}$$

Ingresando A a la sumatoria y aplicando la definición de valor propio nos queda que:

$$v_1 = \sum_{i=1}^n a_i \lambda_i x_i \tag{8}$$

Ahora, si multiplicamos y dividimos por el vector dominante λ_n , tenemos que

$$v_1 = \lambda_n \sum_{i=1}^n a_i \frac{\lambda_i}{\lambda_n} x_i \tag{9}$$

Ahora si quitamos de la sumatoria el elemento n y reescribimos, tenemos que

$$v_1 = \lambda_n \sum_{i=1}^{n-1} a_i \frac{\lambda_i}{\lambda_n} x_i + a_n x_n \tag{10}$$

Para un vector v_2 tenemos que:

$$v_2 = Av_1 \tag{11}$$

Sustituyendo lo obtenido para v_1 tenemos que:

$$v_2 = A(\lambda_n \sum_{i=1}^{n-1} a_i \frac{\lambda_i}{\lambda_n} x_i + a_n x_n)$$
(12)

multiplicando A en cada termino y aplicando la definición de vector propio nos queda que:

$$v_2 = \lambda_n \sum_{i=1}^{n-1} a_i \frac{\lambda_i}{\lambda_n} \lambda_i x_i + \frac{a_n \lambda_n x_n}{a_n \lambda_n x_n}$$
 (13)

Multiplicando por λ_n/λ_n el primer termino y sacando como factor común λ_n nos queda:

$$v_2 = \lambda_n^2 \left(\sum_{i=1}^{n-1} a_i \left(\frac{\lambda_i}{\lambda_n}\right)^2 x_i + a_n x_n\right)$$
(14)

De aquí podemos generalizar y decir que:

$$v_r = \lambda_n^r \left(\sum_{i=1}^{n-1} a_i \left(\frac{\lambda_i}{\lambda_n}\right)^r x_i + a_n x_n\right)$$
(15)

Si tenemos valores grandes de r y sabiendo que λ_n es mayor a los demás valores propios podemos hacer:

$$v_r \approx \lambda_n^r a_n x_n \tag{16}$$

у

$$v_{r+1} \approx \lambda_n^{r+1} a_n x_n \tag{17}$$

Para calcular λ_n podemos realizar la siguiente operación:

$$\frac{v_{r+1}^T \cdot v_r}{v_r^T \cdot v_r} \tag{18}$$

Sustituyendo lo obtenido tenemos que:

$$\frac{\lambda_n^{r+1} a_n x_n \lambda_n^r a_n x_n}{\lambda_n^r a_n x_n \lambda_n^r a_n x_n} \tag{19}$$

Eliminando factores comunes nos queda que:

$$\lambda_n = \frac{v_{r+1}^T \cdot v_r}{v_r^T \cdot v_r} \tag{20}$$

Además para evitar que con cada iteración el nuevo vector tenga valores demasiado grandes tendremos que normalizar cada nuevo vector que encontremos.

Entonces con los resultados obtenidos podemos escribir el siguiente pseudocódigo.

Algorithm 1: Método de Potencia

```
1 eigen_valor_vector_dominante (matrix, rows, x0);
   Input : matrix: matriz que contiene coeficientes ecuación, x0: es el
                vector que se propone para solucionar, rows: numero de filas
   Output: x1, \lambda
   ERROR = 1E^{-9};
 \mathbf{3} \ matrix \leftarrow readMatrix();
 4 x0 \leftarrow creaVectorZeros(rows);
 5 m \leftarrow rows;
 6 x0_0 \leftarrow 1/sqrt(n);
 7 iteration \leftarrow 0;
   condition \leftarrow True \ \lambda_{old} \leftarrow 0;
   while condition and iteration < LIMIT do
        x1 = productoPunto(matrix, x0);
10
         \lambda = productoPunto(x1^T, x0)/productoPunto(x0^T, x0);
        if abs(\lambda_{old} - \lambda) < ERROR then
11
           return x1, \lambda;
12
        end
13
        \lambda_{old} \leftarrow \lambda;
14
        x0 \leftarrow x1;
15
        x0 \leftarrow normalizar\_vector(x0);
16
        iteration \leftarrow iteration + 1;
17
18 end
```

Método de Potencia Inversa

Primero proponemos la siguiente ecuación matricial

$$Av_1 = v_0 \tag{21}$$

Aplicando la inversa de la matriz a cada lado de la ecuación nos queda que:

$$v_1 = A^{-1}v_0 (22)$$

Ahora si sabemos que

$$Ax_i = \lambda_i x_i \tag{23}$$

podemos aplicar de nuevo la inversa y obtener que

$$x_i = \lambda_i A^{-1} x_i \tag{24}$$

pasando x_i a la izquierda y cambiando de sentido la ecuación, tenemos que:

$$A^{-1}x_i = \frac{x_i}{\lambda_i} \tag{25}$$

Volviendo de nuevo a la ecuación propuesta, sabemos que v_0 se puede escribir como una combinación lineal de los eigenvectores de la matriz y entonces tenemos que:

$$v_1 = A^{-1} \sum_{i=1}^{n} a_i x_i \tag{26}$$

Observamos que podemos utilizar la expresión () para simplificar y obtenemos que

$$v_1 = \sum_{i=1}^{n} \frac{a_i x_i}{\lambda_i} \tag{27}$$

Si multiplicamos y dividimos por λ_1 , tenemos que

$$v_1 = \frac{1}{\lambda_1} \sum_{i=1}^{n} a_i x_i \frac{\lambda_1}{\lambda_i} \tag{28}$$

Ahora si queremos un vector v_2 , entonces tendremos que:

$$v_2 = A^{-1}v_1 (29)$$

Sustituyendo los resultados obtenidos anteriormente tenemos que:

$$v_2 = A^{-1} \left(\frac{1}{\lambda_1} \sum_{i=1}^n a_i \frac{\lambda_1}{\lambda_i} x_i \right) \tag{30}$$

Multiplicando por A^{-1} y usando la ecuación (), tenemos que:

$$v_2 = \frac{1}{\lambda_1} \sum_{i=1}^n a_i \frac{\lambda_1}{\lambda_i} \frac{x_i}{\lambda_i} \tag{31}$$

De nuevo multiplicando denominador y numerados por λ_1 y agrupando factores comunes tenemos que:

$$v_2 = \frac{1}{\lambda_1^2} \sum_{i=1}^n a_i \left(\frac{\lambda_1}{\lambda_i}\right)^2 x_i \tag{32}$$

si ahora generalizamos para v_r , tenemos que

$$v_r = \frac{1}{\lambda_1^r} \sum_{i=1}^n a_i \left(\frac{\lambda_1}{\lambda_i}\right)^r x_i \tag{33}$$

si expandimos la sumatoria obtenemos

$$v_r = \frac{1}{\lambda_1^r} (a_1 x_1 + a_2 \left(\frac{\lambda_1}{\lambda_2}\right)^r x_2 + \dots + a_n \left(\frac{\lambda_1}{\lambda_n}\right)^r x_n)$$
 (34)

Los términos mayores a i=1, tienden a cero cuando r es muy grande, ya que el numerador es el lambda mínimo, entonces podemos escribir que:

$$v_r = \frac{1}{\lambda_1^r} a_1 x_1 \tag{35}$$

y para un vector siguiente a r tenemos que:

$$v_{r+1} = \frac{1}{\lambda_1^{r+1}} a_1 x_1 \tag{36}$$

Para encontrar el eigenvalor mínimo podemos hacer:

$$\frac{v_r^T \cdot v_r}{v_{r+1}^T \cdot v_r} \tag{37}$$

sustituyendo lo obtenido tenemos que:

$$\frac{\frac{1}{\lambda_1^r} a_1 x_1 \frac{1}{\lambda_1^r} a_1 x_1}{\frac{1}{\lambda_1^r + 1} a_1 x_1 \frac{1}{\lambda_1^r} a_1 x_1} \tag{38}$$

Eliminando los factores iguales tenemos que:

$$\lambda_1 = \frac{v_r^T \cdot v_r}{v_{r+1}^T \cdot v_r} \tag{39}$$

Con todo lo anterior podemos escribir el siguiente pseudocódigo:

Algorithm 2: Método de Potencia Inversa

```
1 eigen_valor_vector_dominante (matrix, rows, x0);
   Input: matrix: matriz que contiene coeficientes ecuación, x0: es el
                vector que se propone para solucionar, rows: numero de filas
    Output: x1, \lambda
 2 ERROR = 1E^{-9};
 \mathbf{3} \ matrix \leftarrow readMatrix();
 4 x0 \leftarrow creaVectorZeros(rows);
 5 m \leftarrow rows;
 6 x0_0 \leftarrow 1/sqrt(n);
 7 iteration \leftarrow 0;
 s condition \leftarrow True;
 9 \lambda_{old} \leftarrow 1E40;
10 while condition \ and \ iteration < LIMIT \ do
        x1 = SolveLU(matrix, x0);
        \lambda = productoPunto(x1^T, x0)/productoPunto(x0^T, x0);
        if abs(\lambda_{old} - \lambda) < ERROR then
13
            return x1, \lambda;
14
15
        end
        \lambda_{old} \leftarrow \lambda;
16
        x0 \leftarrow x1;
17
        x0 \leftarrow normalizar\_vector(x0);
18
        iteration \leftarrow iteration + 1;
19
20 end
```

Método potencia para m λ mayores

Para poder aplicar este método primero debemos asegurarnos que la matriz con la que vamos a trabajar debe ser simétrica.

Ahora partimos del supuesto de que conocemos el eigenvalor dominante λ_n y entonces podemos escribir que un vector cualquiera puede ser escrito como una combinación de los eigenvectores:

$$v = \sum_{i=1}^{n-1} a_i x_i + a_n x_n \tag{40}$$

Multiplicando por l'traspuesta del eigenvector dominante tenemos que:

$$x_n^T v = x_n^T \sum_{i=1}^{n-1} a_i x_i + a_n x_n^T x_n$$
 (41)

Como la matriz es simétrica los eigenvectores son ortogonales y la sumatoria al tener elementos distintos a x_n estos se vuelven 0 y nos queda que:

$$x_n^T v = a_n \tag{42}$$

Para calcular el eigenvalor n-1, simplemente debemos de quitar el componente asociado al eigenvalor dominante y tenemos que

$$\hat{v} = v - a_n x_n \tag{43}$$

Y sustituyendo el valor encontrado de a_n tenemos que:

$$\hat{v_0} = v - x_n^T v x_n \tag{44}$$

Donde \hat{v} es el vector el cual utilizaremos en el algoritmo de la potencia para calcular el n-1 eigenvector dominante.

Siguiendo esta lógica podemos encontrar los m valores dominantes, siempre restando el eigenvalor dominante anterior.

en general tendríamos que:

$$\hat{v_0} = v_0 - \sum_{i=n}^{m} x_i^T v_o x_i \tag{45}$$

Con i=n disminuyendo hasta m

29 end

En seguida se muestra el pseudocódigo.

Algorithm 3: Método de Potencia deflación

```
1 eigen_valor_vector_dominante (matrix, rows, x0);
   Input : matrix: matriz que contiene coeficientes ecuación, x0: es el
                vector que se propone para solucionar, rows: numero de filas
   Output: x1, \lambda
   i \leftarrow 1 for i:m do
 2
        ERROR = 1E^{-9};
 3
 4
        matrix \leftarrow readMatrix();
        x0 \leftarrow creaVectorZeros(rows);
 5
        m \leftarrow rows;
 6
        x0_0 \leftarrow 1/sqrt(n);
 7
        iteration \leftarrow 0;
 8
        condition \leftarrow True \ \lambda_{old} \leftarrow 0;
 9
        while condition and iteration < LIMIT do
10
            x1 = productoPunto(matrix, x0);
11
             \lambda = productoPunto(x1^T, x0)/productoPunto(x0^T, x0);
            if abs(\lambda_{old} - \lambda) < ERROR then
12
                xn_i, vector\_lambda_i \leftarrow x1, \lambda;
13
                continue;
14
15
            end
            \lambda_{old} \leftarrow \lambda;
16
            x0 \leftarrow x1;
17
            x0 \leftarrow normalizar\_vector(x0);
18
            if i \neq 0 then
19
                for k \leftarrow 0, k < i, k + + do
20
                     an = dot_-vector(x0, xn_k, m);
21
                     for j \leftarrow 0, j < m, j + + do
\mathbf{22}
                      x0_j \leftarrow x0_j - an * xn_{k,j};
23
                     end
24
                end
25
            end
26
            iteration \leftarrow iteration + 1;
27
        end
28
```

M eigenvalores menores con el método de la inversa

Para poder aplicar este método primero debemos asegurarnos que la matriz con la que vamos a trabajar debe ser simétrica.

Ahora partimos del supuesto de que conocemos el eigenvalor menor λ_1 y entonces podemos escribir que un vector cualquiera puede ser escrito como una combinación de los eigenvectores:

$$v = \sum_{i=2}^{n} a_i x_i + a_1 x_1 \tag{46}$$

Multiplicando por l traspuesta del eigenvector dominante tenemos que:

$$x_1^T v = x_1^T \sum_{i=2}^n a_i x_i + a_1 x_1^T x_1$$
(47)

Como la matriz es simétrica los eigenvectores son ortogonales y la sumatoria al tener elementos distintos a x_1 estos se vuelven 0 y nos queda que:

$$x_1^T v = a_1 \tag{48}$$

Para calcular el eigenvalor 2, simplemente debemos de quitar el componente asociado al eigenvalor dominante y tenemos que

$$\hat{v} = v - a_1 x_1 \tag{49}$$

Y sustituyendo el valor encontrado de a_1 tenemos que:

$$\hat{v_0} = v - x_1^T v x_1 \tag{50}$$

Donde \hat{v} es el vector el cual utilizaremos en el algoritmo de la potencia para calcular el i eigenvector dominante.

Siguiendo esta lógica podemos encontrar los n valores dominantes, siempre restando el eigenvalor dominante anterior.

en general tendríamos que:

$$\hat{v_0} = v_0 - \sum_{i=1}^n x_i^T v_0 x_i \tag{51}$$

Con i=1 aumentando hasta hasta n En seguida se muestra el pseudocódigo.

Algorithm 4: M eigenvalores menores

```
1 eigen_valor_vector_dominante (matrix, rows, x0);
   Input: matrix: matriz que contiene coeficientes ecuación, x0: es el
                vector que se propone para solucionar, rows: numero de filas
    Output: x1, \lambda
 2 i \leftarrow 1 for i:m do
        ERROR = 1E^{-9};
 3
        matrix \leftarrow readMatrix();
 4
        x0 \leftarrow creaVectorZeros(rows);
 5
 6
        m \leftarrow rows;
        x0_0 \leftarrow 1/sqrt(n);
        iteration \leftarrow 0;
 8
        condition \leftarrow True \ \lambda_{old} \leftarrow 0;
 9
        while condition and iteration < LIMIT do
10
            x1 = SolveLU(matrix, x0);
11
            \lambda = productoPunto(x1^T, x0)/productoPunto(x0^T, x0);
12
            if abs(\lambda_{old} - \lambda) < ERROR then
13
                xn_i, vector\_lambda_i \leftarrow x1, \lambda;
14
                continue;
15
            end
16
            \lambda_{old} \leftarrow \lambda;
17
            x0 \leftarrow x1;
18
            x0 \leftarrow normalizar\_vector(x0);
19
            if i \neq 0 then
20
                for k \leftarrow 0, k < i, k + + do
\mathbf{21}
                     an = dot_-vector(x0, xn_k, m);
22
23
                     for j \leftarrow 0, j < m, j + + do
                      x0_j \leftarrow x0_j - an * xn_{k,j};
24
                     end
25
                end
26
27
            end
            iteration \leftarrow iteration + 1;
28
        \mathbf{end}
29
30 end
```

Resultados

Metodo de la potencia e Inversa

Figure 1: Matriz de 3x3

Figure 2: Matriz de 50x50

Figure 3: Matriz de 125x125

M mayores

Figure 4: Matriz de 125x125

Eigenvalor: 10.034796 Eigenvector:

Eigenvalor: 10.034796 Eigenvector:

Conclusión

En general aunque el método de la potencia es mas rápido, pude observar que necesita de mas iteraciones para llegar a una solución, en el programa pido que se tenga un error de 1E-12, el método de la inversa se realizan menos iteraciones. Puedo decir que ambos métodos en general son rápidos.

Para el algoritmo de los m mayores no logre que funcionara mi algoritmo, lo realicé de diversas maneras, pero al parecer el error que seguía teniendo era con la manera en que llamaba a los apuntadores en C, al final lo dejé al tercer intento, el cuál muestra los valores repetidos, es decir pareciera que no quita las contribuciones de los eigenvalores anteriormente encontrados. La primera forma en que escribí el código mostraba, los valores correctos pero estaban desfasados. Por ejemplo, si quería encontrar el penúltimo eigenvalor dominante debía correr

el programa unas 3 o más veces según el tamaño de la matriz y de nuevo, pienso que el problema se relacionaba con cosas técnicas del lenguaje de programación usado.