



Étudiants ingénieurs en aérospatial

Mémoire de 3^e année

Optimisation des méthodes itératives pour la résolution de systèmes linéaires

Auteurs :

M. AUDET Yoann

M. CHANDON Clément

M. DE CLAVERIE Chris

M. HUYNH Julien

Encadrant :

Pr. BLETZACKER Laurent

Version 0.0 du
10 avril 2019

Remerciements

Table des matières

1	Introduction	1
2	Présentation des méthodes itératives classiques	2
2.1	Présentation générale des méthodes	2
2.2	Méthodes classiques	2
2.2.1	Méthodes de Jacobi et de Gauss-Seidel	4
2.3	Une nouvelle méthode : Richardson	5
2.3.1	Présentation de la méthode	5
2.3.2	Étude de convergence sur un exemple	6
2.3.3	Un peu plus de théorie...	8
3	Optimisation du choix de la matrice d'itération	10
3.1	Méthode SOR	10
3.1.1	Présentation de la méthode SOR	10
3.1.2	Intérêt de la méthode	11
3.1.3	Implémentation numérique	13
3.2	Les espaces de Krylov	13
3.2.1	Présentation théorique	13
3.2.2	L'algorithme GMRES : Generalized Minimal RESidual method . .	15
4	Des algorithmes complexes...	21
4.1	Optimisation théorique des méthodes	21
4.1.1	Préconditionnement pour une méthode itérative	21
4.1.2	Les limites de l'optimisation mathématique	23
4.2	Étude des performances	23
5	Conclusion & ouverture	24

Chapitre 1

Introduction

La résolution d'un système d'équations linéaires $Ax = b$ est probablement le problème le plus basique de l'algèbre linéaire. Il y a 4000 ans, les Babyloniens étaient déjà capables de résoudre des systèmes d'équations linéaires de taille 2×2 . Le texte chinois Les Neufs Chapitres sur l'art mathématique rédigé au II^e siècle avant J.-C, parlait déjà de l'utilisation de tableaux de nombre pour résoudre des systèmes d'équations.

Cependant, ce n'est qu'en 1750 que Cramer établit une méthode de résolution de systèmes $n \times n$. Mais la règle de Cramer devient difficilement fastidieuse dès lors que le système dépasse trois équations. Au début du XIX^e siècle, Gauss propose sa méthode du pivot, encore largement utilisée aujourd'hui.

Enfin, en 1848, Sylvester introduit le terme "matrice". Quelques années plus tard est publié le théorème de Cayley-Hamilton. Puis les avancées mathématiques ralentissent dans ce domaine, jusqu'à la Seconde Guerre mondiale et le développement de l'informatique.

Avec l'arrivée des ordinateurs, les méthodes de résolutions de systèmes d'équations linéaires deviennent applicables à des systèmes de grande taille. L'augmentation des puissances de calculs permettent de développer de nouvelles méthodes de résolution, pensées directement pour des machines.

Deux grandes familles de méthodes sont développées en parallèle : les méthodes directes et les méthodes itératives. Ce mémoire est consacré aux méthodes itératives ainsi qu'à leur optimisation, du point de vue mathématique puis numérique.

Chapitre 2

Présentation des méthodes itératives classiques

2.1 Présentation générale des méthodes

Les méthodes itératives sont des méthodes qui permettent de résoudre un problème par la construction d'une suite convergeant vers la solution. À chaque itération, on calcule une nouvelle approximation de la solution. Le but est ici d'obtenir une approximation la plus proche possible de la solution exacte en un nombre d'itérations le plus petit possible. Ces méthodes s'opposent donc aux méthodes directes qui permettent, en un nombre fini de calcul, d'obtenir la solution exacte.

Dans notre cas, pour la résolution de systèmes linéaires, une méthode directe telle que la méthode de Gauss, Cholesky ou Householder, permet d'obtenir la solution exacte du système. C'est là le point fort de ces méthodes. Cependant, nos programmes python travaillent avec des flottants et non des réels. Cela force l'ordinateur à faire des approximations à chaque étape. Ainsi, même avec une méthode directe, on ne trouve pas toujours la solution exacte du système. Plus la taille du système est élevée, plus le nombre d'opérations est important, entraînant un impact plus fort des erreurs de calcul. Il faudrait donc tenir compte de ces erreurs mais cela est difficile et demande des algorithmes plus lourds et plus lents. Les méthodes directes sont donc peu adaptées à la résolution de grands systèmes.

2.2 Méthodes classiques

La plupart des méthodes itératives se basent sur une décomposition $A = M - N$ suivant ce principe général :

On suppose $A = M - N$ avec M une matrice choisie "simple".

On a :

$$\begin{aligned} Ax = b &\Leftrightarrow (M - N)x = b \\ &\Leftrightarrow Mx = Nx + b \end{aligned}$$

Cette écriture donne l'idée de considérer une suite récurrente de vecteurs $(x^{(p)}), \forall p \in \mathbb{N}, x^{(p)} \in \mathbb{R}$ définie par

$$Mx^{(p+1)} = Nx^{(p)} + b$$

Si $x^{(p)}$ converge vers $x^* \in \mathbb{R}$ pour $p \rightarrow \infty$, alors $Mx^* = Nx^* + b$ et donc x^* est solution de $Ax = b$.

Remarque :

Pour calculer une itération, il faut d'abord calculer $Nx^{(p)} + b$ (calcul assez rapide), puis résoudre le système $Mx^{(p+1)} = Nx^{(p)} + b$ où on cherche à calculer $x^{(p+1)}$.

En général M est choisie de sorte que cette résolution puisse être rapidement calculée.

Avant de se lancer dans le calcul des itérations, il convient d'étudier la convergence de la suite. Si l'on constate que la suite ne converge pas, cela nous évitera de perdre notre temps.

On a $A = M - N$ avec A et M inversibles, M choisie de sorte qu'elle soit inversible "aisément".

$$\begin{cases} x^{(0)} \text{ fixé} \\ Mx^{(k+1)} = Nx^{(k)} + b \end{cases}$$

Soit $x^* = A^{-1}b$.

Notons $e^{(k)} = x^{(k)} - x^* \Leftrightarrow x^{(k)} = x^* + e^{(k)}$

$$M[x^* + e^{(k+1)}] = N[x^* + e^{(k)}] + b$$

$$Mx^* + Me^{(k+1)} = Nx^* + Ne^{(k)} + b$$

$$\text{Or, } Mx^* - Nx^* = b$$

$$\text{D'où : } Me^{(k+1)} = Ne^{(k)}$$

$$\Leftrightarrow e^{(k+1)} = M^{-1}Ne^{(k)}$$

On appelle matrice d'itération la matrice :

$$\begin{aligned} J &= M^{-1}N \\ e^{(k+1)} &= Je^{(k)} \\ e^{(1)} &= Je^{(0)} \\ e^{(2)} &= JJe^{(0)} = J^2e^{(0)} \\ Je^{(3)} &= JJJe^{(0)} = J^3e^{(0)} \\ k \in \mathbb{N} \quad \vdots &= J^ke^{(0)} \end{aligned}$$

On est amené à étudier (J^k) lorsque $k \rightarrow \infty$

Soit $\rho(A) = \max_{\lambda \in sp(A)} |\lambda|$ le rayon spectral de A.

Théorème :

Si $\rho(J) < 1$, quelque soit le choix de $x^{(0)}$, la suite $x^{(k)}$ converge vers x^* .
Si $\rho(J) \geq 1$, il existe au moins un choix de $x^{(0)}$ pour lequel la suite diverge.

Preuve :

Si $\rho(j) < 1$

$$\begin{aligned} \lim_{k \rightarrow +\infty} J^k &= 0^1 \\ \text{Donc} \quad \lim_{k \rightarrow +\infty} J^k e^{(0)} &= 0e^{(0)} = 0 \\ \lim_{k \rightarrow \infty} e^{(k)} &= 0 \\ \text{Or,} \quad x^{(k)} &= x^* + e^{(k)} \xrightarrow[k \rightarrow \infty]{} x^* + 0 \end{aligned}$$

Remarque :

Plus $\rho(J)$ est proche de 0, plus la suite $x^{(k)}$ converge rapidement.

2.2.1 Méthodes de Jacobi et de Gauss-Seidel

Parmi les méthodes itératives classiques, nous pouvons citer les méthodes de Jacobi et de Gauss-Seidel, assez semblables entre elles. Dans les deux cas, on considère une matrice

1. <https://maths.ens2m.fr/Laydi/Enseignement/Matrices.pdf> page 27, théorème 4, preuve P3

$A \in \mathcal{M}_n(\mathbb{K})$ inversible et on pose :

$$A = D - E - F$$

où on choisit $\begin{cases} D \text{ une matrice diagonale} \\ E \text{ une matrice triangulaire inférieure à diagonale nulle} \\ F \text{ une matrice triangulaire supérieure à diagonale nulle} \end{cases}$

Lorsque l'on utilise la méthode de Jacobi, on pose $M = D$ et $N = E + F$. La matrice d'itération est donc $J = M^{-1}N = D^{-1}(E + F)$.

La méthode de Gauss-Seidel consiste à poser $M = D - E$ et $N = F$, ce qui implique que la matrice d'itération est $J = (D - E)^{-1}F$.

Bien que très similaires dans leur approche, dans certains cas, une méthode convergera tandis que l'autre non. Il faut donc étudier le spectre de la matrice M avant de se lancer dans le calcul des itérations successives. De plus, la vitesse de convergence de chaque méthode dépend de la matrice A donnée.

2.3 Une nouvelle méthode : Richardson

2.3.1 Présentation de la méthode

Ci-dessus, nous avons exposé les deux principales méthodes que l'on a utilisées lors des cours et TP. Cependant, il est aussi possible pour nous de trouver d'autres méthodes de résolution. Pour cela, il nous faut juste réécrire le problème sous une autre forme que celles précédemment définies. Ainsi, nous pouvons utiliser la décomposition de la forme :

$$Ax = b \quad (2.1)$$

$$Px = (P - A)x + b \quad (2.2)$$

On remarque que peu importe la valeur de la matrice P dans l'équation ci-dessus, les deux équations sont équivalentes. Ainsi, résoudre le premier système revient à résoudre le second. La méthode de Richardson se base sur cette décomposition. L'idée est de poser :

$$P = \beta I \text{ avec } I \text{ la matrice identité et } \beta \in \mathbb{R}^* \quad (2.3)$$

Notre système s'écrit alors de la manière suivante :

$$\beta Ix = (\beta I - A)x + b \quad (2.4)$$

$$x = \left(I - \frac{1}{\beta}A\right)x + \frac{1}{\beta}b \quad (2.5)$$

Pour faciliter son écriture, on redéfinit la formule précédente sous la forme :

$$x = (I - \gamma A)x + \gamma b \text{ avec } \gamma = \frac{1}{\beta} \quad (2.6)$$

Ainsi, l'idée est de construire une suite $x^{(k)}$ qui va converger vers la solution exacte du système que l'on note ici x^* . Cette suite est définie de la manière suivante :

$$x^{(k+1)} = (I - \gamma A)x^k + \gamma b \quad (2.7)$$

Par définition de la suite, la matrice d'itération, notée ici R , est :

$$R = I - \gamma A \quad (2.8)$$

Nous réécrivons la suite sous la forme :

$$x^{(k+1)} = Rx^k + K \text{ avec } K = \gamma b \quad (2.9)$$

Si cette suite converge, alors nous sommes en mesure de trouver une solution x^* approchant la vraie solution du système. L'étude porte donc sur la convergence de cette suite. Comme pour les autres méthodes itératives, la condition de convergence est la même que précédemment : le rayon spectral de la matrice d'itération doit être strictement inférieur à 1. L'avantage de cette méthode est que la matrice d'itération dépend de γ . Ainsi, en jouant sur cette valeur de γ , il est possible de faire converger la suite en prenant une valeur pour laquelle le rayon spectral est inférieur à 1. On peut même produire une étude qui fait que l'on va minimiser cette valeur du rayon spectral pour obtenir une meilleure convergence. Cette démarche sera expliquée dans la suite de l'exposé.

2.3.2 Étude de convergence sur un exemple

Pour illustrer cet exemple, nous allons prendre un système linéaire quelconque. Dans un premier temps, nous allons trouver sa solution théorique puis appliquer la méthode de Richardson. Cela nous permettra d'étudier la convergence de la suite et la condition d'arrêt de notre algorithme. Pour cela, nous allons prendre le système 2×2 suivant :

$$\begin{cases} -3x + 2y = 1 \\ x + -4y = -7 \end{cases} \quad (2.10)$$

Ce système peut être résolu assez trivialement et on obtient le couple de solution suivant :

$$(x, y) = (1, 2) \quad (2.11)$$

Notre but est maintenant de retrouver ces résultats grâce à la méthode de Richardson. Pour cela nous écrivons le système (2.10) sous sa forme matricielle :

$$\underbrace{\begin{pmatrix} -3 & 2 \\ 1 & -4 \end{pmatrix}}_A \underbrace{\begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix}}_x = \underbrace{\begin{pmatrix} 1 \\ -7 \end{pmatrix}}_b \quad (2.12)$$

On pose, d'après la définition de la méthode, la matrice P :

$$P = \gamma I = \begin{pmatrix} \gamma & 0 \\ 0 & \gamma \end{pmatrix} \quad (2.13)$$

et on rappelle que l'on a :

$$x^{(k+1)} = (I - \gamma A)x^k + \gamma b \text{ avec } R = (I - \gamma A) \quad (2.14)$$

Dans notre cas, la matrice d'itération est la suivante :

$$R = \begin{pmatrix} 1 + 3\gamma & -2\gamma \\ -\gamma & 1 + 4\gamma \end{pmatrix} \quad (2.15)$$

On cherche les valeurs propres de celle-ci grâce son polynôme caractéristique :

$$\det(R - \lambda I) = \begin{vmatrix} 1 + 3\gamma - \lambda & -2\gamma \\ -\gamma & 1 + 4\gamma - \lambda \end{vmatrix} \quad (2.16)$$

$$= ((1 + 3\gamma) - \lambda)((1 + 4\gamma) - \lambda) - 2\gamma^2 \quad (2.17)$$

$$= \lambda^2 - (2 + 7\gamma)\lambda + 1 + 7\gamma + 10\gamma^2 \quad (2.18)$$

$$= \lambda^2 - (2 + 7\gamma)\lambda + (1 + 2\gamma)(1 + 5\gamma) \quad (2.19)$$

$$= (\lambda - (1 + 2\gamma))(\lambda - (1 + 5\gamma)) \quad (2.20)$$

Ainsi, les deux valeurs propres sont :

$$\lambda_1 = 1 + 2\gamma \text{ ou } \lambda_2 = 1 + 5\gamma \quad (2.21)$$

Il nous faut donc maintenant étudier le rayon spectral :

$$\rho(R) = \max(|1 + 2\gamma|, |1 + 5\gamma|) < 1 \quad (2.22)$$

Pour trouver le maximum, on cherche quand les quantités sont égales :

$$\begin{cases} 1 + 2\gamma = 1 + 5\gamma \Leftrightarrow \gamma = 0 \\ 1 + 2\gamma = -1 - 5\gamma \Leftrightarrow \gamma = -\frac{2}{7} \end{cases} \quad (2.23)$$

Il vient de cette étude :

$$\begin{cases} \rho(R) = |1 + 2\gamma| & \text{si } \gamma \in [-\frac{2}{7}, 0] \\ \rho(R) = |1 + 5\gamma| & \text{sinon} \end{cases} \quad (2.24)$$

Nous cherchons ensuite les valeurs pour lesquelles le rayon spectral est égal à 1. Comme les deux fonctions sont croissantes, il suffit de trouver les valeurs pour lesquelles nous avons $\rho(R) = 1$ ou -1 .

$$\begin{cases} \gamma = 0 \Leftrightarrow \rho(R) = 1 \\ \gamma = -0.4 \Leftrightarrow \rho(R) = -1 \end{cases} \quad (2.25)$$

Ainsi, pour que la méthode converge sur cet exemple, il faut que :

$$\gamma \in]-0.4, 0[\quad (2.26)$$

Ensuite, il est possible d'optimiser ce résultat. Pour cela, il nous faut trouver la valeur de γ telle que le rayon spectral soit minimal. On cherche sur chacun des intervalles le minimum du rayon spectral. Cette valeur est à l'intersection des deux intervalles donc pour $\gamma = -\frac{2}{7}$. Cela se voit simplement en regardant le graphe de rho sur l'intervalle ci-dessus. Pour cette valeur de γ particulière la méthode possède la meilleure convergence. Si on revient au problème de base, nous avons alors une méthode qui converge le plus rapidement possible pour :

$$\beta = \frac{1}{\gamma} = -\frac{7}{2} \quad (2.27)$$

2.3.3 Un peu plus de théorie...

Maintenant que nous avons montré la démarche sur un exemple, nous allons essayer de la généraliser aux matrices quelconques, que l'on veut étudier grâce à cette méthode. Dans un premier temps, nous allons étudier les valeurs propres de la matrice d'itération R (cf. équation 2.8). En notant λ_i les valeurs propres de la matrice A et μ_i les valeurs propres de la matrice R, nous avons :

$$\mu_i = 1 - \gamma\lambda_i \quad (2.28)$$

En appliquant la condition de convergence de la suite, nous obtenons les égalités suivantes :

$$-1 \leq 1 - \gamma\lambda_i \leq 1 \quad (2.29)$$

$$0 \leq \gamma\lambda_i \leq 2 \quad (2.30)$$

$$0 \leq \gamma \leq \frac{2}{\lambda_i} \quad (2.31)$$

On remarque que sur notre exemple cela est vrai. En effet, les valeurs propres de la matrice

A choisie sont -5 et -2 . Or $\frac{2}{-5} = -0.4$, cela confirme l'intervalle trouvé. La deuxième remarque porte sur le fait qu'il ne faut pas prendre une matrice A avec 0 en valeur propre.

Toujours dans le même esprit, nous allons chercher le meilleur γ théorique pour avoir la convergence la plus rapide. Ce problème est équivalent à minimiser le rayon spectral de la matrice d'itération qui dépend de γ . Or d'après les valeurs propres de cette matrice R, nous avons :

$$\rho(R) = \max_{1 \leq i \leq n} (|1 - \gamma \lambda_i|) = \max_{1 \leq i \leq n} (|1 - \gamma \lambda_1|, |1 - \gamma \lambda_n|) \quad (2.32)$$

où λ_1, λ_n sont respectivement la plus grande et la plus petite valeur propre. Maintenant, il nous reste à résoudre :

$$|1 - \gamma \lambda_1| = |1 - \gamma \lambda_n| \Rightarrow \begin{cases} 1 - \gamma \lambda_1 = 1 - \gamma \lambda_n \Leftrightarrow \gamma = 0 \\ ou \\ 1 - \gamma \lambda_1 = -1 + \gamma \lambda_n \Leftrightarrow \gamma = \frac{2}{\lambda_1 + \lambda_n} \end{cases} \quad (2.33)$$

Une fois que nous avons les valeurs de l'égalité, une simple étude des deux valeurs propres extrêmes nous donne que le meilleur choix de γ est :

$$\gamma = \frac{2}{\lambda_1 + \lambda_n} \quad (2.34)$$

Chapitre 3

Optimisation du choix de la matrice d'itération

Nous avons vu dans la partie précédente qu'il existe différentes méthodes itératives de résolution d'un système linéaire. Ainsi, toujours dans cette idée d'optimisation que nous avons exposée, nous nous sommes posés la question suivante : « Quelle est la matrice d'itération la plus adaptée pour résoudre un problème ». Une méthode est ressortie dans plusieurs ouvrages : Successive Over Relaxation.

3.1 Méthode SOR

C'est dans cette optique que nous nous sommes penchés sur la méthode dite "SOR".

3.1.1 Présentation de la méthode SOR

La méthode SOR (Successive Over Relaxation) est une méthode itérative dérivée de Gauss-Seidel. En effet, le processus de décomposition de la matrice A en deux matrices M et N telles que $A = M - N$ est similaire à l'algorithme de Gauss-Seidel dans la forme des matrices M et N .

Si la méthode de Gauss-Seidel, vue précédemment, définit la matrice M par $M = D - E$ avec D une matrice diagonale, E une matrice triangulaire inférieure à diagonale nulle et $N = F$, F étant une matrice triangulaire supérieure à diagonale nulle, la méthode SOR définit ces matrices de la manière suivante, en introduisant un paramètre $\omega \in \mathbb{R}^*$ dit de relaxation.

$$M = \frac{1}{\omega}D - E \tag{3.1}$$

$$N = \left(\frac{1}{\omega} - 1\right)D + F \tag{3.2}$$

Par la suite, le procédé est identique à celui de Gauss-Seidel ou Jacobi et on introduit donc une matrice d'itération notée B .

$$B = M^{-1}N = \left[\frac{1}{\omega}D - E \right]^{-1} \left[\left(\frac{1}{\omega} - 1 \right) D + F \right] \quad (3.3)$$

On remarquera que si $\omega = 1$, on retrouve la méthode de Gauss-Seidel. De plus, si $\omega < 1$, on parle de sous-relaxation et de sur-relaxation dans le cas où $\omega > 1$.

3.1.2 Intérêt de la méthode

Cette méthode a été développée peu après la Seconde Guerre mondiale afin de proposer une manière de résoudre des systèmes d'équations linéaires, spécifique aux ordinateurs. Si à l'époque, d'autres méthodes avaient été proposées, elles étaient principalement destinées aux êtres humains qui, par des processus non applicables par des ordinateurs, pouvaient assurer la convergence des méthodes. La méthode SOR est donc une méthode qui a fait progresser ce problème en ayant une meilleure vitesse de convergence que les méthodes numériques itératives alors utilisées.

L'avantage de la méthode SOR au niveau de la convergence est mathématiquement facilité par les deux théorèmes suivants :

1. **Théorème de Kahan (1958) :**

Le rayon spectral de la matrice de relaxation, donnée par :

$$T_\omega = T(\omega) = (I - \omega L)^{-1} \omega U + (1 - \omega)I$$

vérifie que $\forall \omega \neq 0$,

$$\rho(T_\omega) \geq |\omega - 1|$$

2. **Théorème d'Ostrowski-Reich (1949-1954) :**

Si la matrice A est définie positive et que $\omega \in]0; 2[$, alors la méthode SOR converge pour tout choix de vecteur $x^{(0)}$ initial.

Afin qu'une méthode itérative converge, il est nécessaire que le rayon spectral de la matrice d'itération soit strictement inférieur à 1. Donc, pour que la méthode ne converge pas, il faut que le rayon spectral soit supérieur ou égal à 1. D'après le théorème de Kahan, on a :

$$|\omega - 1| \geq 1 \Leftrightarrow \omega \geq 2 \text{ ou } \omega \leq 0$$

Ainsi, nous pouvons déduire du premier théorème, une condition nécessaire non suffisante de la convergence de la méthode SOR qui est :

$$0 < \omega < 2 \quad (3.4)$$

Le deuxième théorème (Ostrowski-Reich), permet quant à lui de conclure par rapport à la convergence de la méthode pour ω dans l'intervalle $]0; 2[$. La combinaison de ces deux théorèmes nous montre que la condition donnée à l'équation (3.4) est nécessaire et, est suffisante dans le cas où A est définie positive.

De plus, dans le cas où la matrice A est tridiagonale (les coefficients qui ne sont ni sur la diagonale principale, ni celle au dessus, ni celle au dessous, sont nuls), le théorème suivant nous donne la forme du coefficient de relaxation optimal :

Si A est définie positive et est tridiagonale, alors $\rho(T_g) = [\rho(T_j)]^2 < 1$ et, le choix optimal pour le coefficient de relaxation ω est donné par :

$$\omega_{optimal} = \frac{2}{1 + \sqrt{1 - [\rho(T_j)]^2}}$$

Avec ce choix de coefficient de relaxation, on a : $\rho(T_\omega) = \omega - 1$

La preuve de ce théorème est dans : Ortega, J. M., Numerical Analysis ; A Second Course, Academic Press, New York, 1972, 201 pp.

Preuve du théorème de Kahan :

On a,

$$\prod_i \lambda_i(T(\omega)) = \det(T(\omega)) = \frac{\det(\omega U + (1 - \omega)I)}{\det(I - \omega L)} = (1 - \omega)^n$$

Or,

$$|\prod_i \lambda_i(T(\omega))| \leq \rho(T(\omega))^n \rightarrow |\omega - 1|^n \leq \rho(T(\omega))^n$$

Ainsi,

$$\rho(T(\omega)) \geq |\omega - 1|$$

Preuve du théorème d'Ostrowski-Reich :

En utilisant le théorème de Kahan, on sait que $0 < \omega < 2$ est un critère nécessaire et non suffisant de convergence. De plus, pour une méthode SOR, on a :

$$M_{SOR}(\omega) + M_{SOR}^*(\omega) - A = \left(\frac{2}{\omega - 1} \right) D \text{ puisque } L = U^*$$

qui est symétrique définie positive si on est dans l'intervalle donné par le théorème de Kahan. Le théorème de Householder-John¹ nous dit que pour une matrice A hermitienne² définie positive, avec $A = M - N$ avec M inversible, la méthode itérative converge pour toute donnée initiale si $M + N^*$ est définie positive. (N^* étant la matrice adjointe ou

1. <https://www.math.cuhk.edu.hk/conference/nlaa2013/slides/Jinyun%20Yuan.pdf>

2. <https://www.techno-science.net/definition/5035.html>

transconjugée à N soit $N^* = {}^t \overline{N} = \overline{{}^t N}$).

Afin d'optimiser l'algorithme, on utilise souvent la méthode SSOR (Symetric Successive Over-Relaxation) afin de préconditionner la matrice avant de la traiter, cette méthode sera traitée ultérieurement dans la partie optimisation.

3.1.3 Implémentation numérique

3.2 Les espaces de Krylov

3.2.1 Présentation théorique

De Jacobi à Krylov

On rappelle le résultat de la partie précédente sur la méthode de Jacobi qui s'écrit :

$$x^{k+1} = -D^{-1}(L + U)x^k + D^{-1}b = (I - D^{-1}A)x^k + D^{-1}b \quad (3.5)$$

avec la matrice A du système qui se décompose comme : $A = D + L + U$, L une matrice triangulaire inférieure, U une matrice triangulaire supérieure et D diagonale. La matrice A est inversible car le système est supposé avoir une unique solution. On définit ensuite le résidu du système qui est par définition :

$$r^k \triangleq b - Ax^k = -A(-A^{-1}b + x^k) = -A(-x^* + x^k) \quad (3.6)$$

Où x^* est la solution réelle du système. En normalisant le système ci-dessus de telle sorte que $D = I$. Alors, nous pouvons écrire la solution au rang $k+1$, comme celle au rang k plus le résidu :

$$x^{k+1} = x^k + r^k \quad (3.7)$$

$$\Leftrightarrow x^{k+1} - x^* = x^k - x^* + r^k \quad (3.8)$$

$$\Leftrightarrow -A(x^{k+1} - x^*) = -A(x^k - x^*) - Ar^k \quad (3.9)$$

$$\Leftrightarrow r^{k+1} = r^k - Ar^k \quad (3.10)$$

Dans cette dernière équation récursive, nous pouvons voir que r^{k+1} est une combinaison linéaire des vecteurs r^k précédents. Ainsi :

$$r^k \in Vect\{r^0, Ar^0, \dots, A^k r^0\} \quad (3.11)$$

Cela implique directement :

$$x^k - x^0 = \sum_{i=0}^{k-1} r^i \quad (3.12)$$

Donc il vient que :

$$x^k \in x^0 + Vect\{r^0, Ar^0, \dots, A^k r^0\} \quad (3.13)$$

Où $Vect\{r^0, Ar^0, \dots, A^k r^0\}$ est le k-ième espace de Krylov généré par A à partir de r^0 noté $\mathcal{K}_k(A, r^0)$

De nouvelles propriétés

Maintenant que nous avons une définition de ces espaces, nous allons montrer plusieurs propriétés pour ensuite construire l'algorithme et l'implémenter. Le premier fait remarquable des espaces de Krylov est que par construction, nous avons :

$$\mathcal{K}_{k-1}(A, r^0) \in \mathcal{K}_k(A, r^0) \quad (3.14)$$

Ensuite, il est important de montrer que la solution que l'on cherche appartient à cet espace. Nous reprenons donc notre système linéaire possédant une unique solution :

$$Ax = b \quad (3.15)$$

D'après la définition du problème, la matrice A est inversible. Nous supposons que l'on a le polynôme caractéristique de A :

$$P(\lambda) = \sum_{j=0}^n \alpha_j t^j \Rightarrow P(0) = \alpha_0 = \det(A) \neq 0 \quad (3.16)$$

Par le théorème de Cayley-Hamilton³, nous pouvons obtenir la valeur de A^{-1} :

$$P(A) = \alpha_0 I + \alpha_1 A + \dots + \alpha_n A^n = 0 \quad (3.17)$$

$$\alpha_0 A^{-1} A + \alpha_1 A + \dots + \alpha_n A^n = 0 \quad (3.18)$$

$$(\alpha_0 A^{-1} + \alpha_1 + \dots + \alpha_n A^{n-1})A = 0 \quad (3.19)$$

$$\alpha_0 A^{-1} + \alpha_1 + \dots + \alpha_n A^{n-1} = 0 \quad (3.20)$$

Ce qui donne finalement :

$$A^{-1} = -\frac{1}{\alpha_0} \times \sum_{j=0}^{n-1} \alpha_{j+1} A^j \quad (3.21)$$

Or, la solution du problème 3.15 est : $x^* = A^{-1}b$. Ce qui peut s'écrire de la façon suivante :

$$x^* = -\frac{1}{\alpha_0} \sum_{j=0}^{n-1} \alpha_{j+1} A^j b \quad (3.22)$$

3. http://www.logique.jussieu.fr/~alp/Cayley_Hamilton.pdf

Ce vecteur appartient clairement à l'espace de Krylov défini par :

$$x^* \in \mathcal{K}(A, b) \quad (3.23)$$

Ainsi, la solution de notre problème appartient à l'espace de Krylov défini par les deux données du problème que sont A et b.

3.2.2 L'algorithme GMRES : Generalized Minimal RESidual method

Un des algorithmes utilisant les espaces de Krylov est l'algorithme GMRES qui se trouve ci-dessous en pseudo-code (cf. figure 3.1) avec l'implémentation de celui-ci en python. Cette méthode repose sur les espaces de Krylov. En effet, dans cet algorithme nous choisissons $x_k \in \mathcal{K}_k(A, b)$ tel que l'on a $\|b - Ax_k\|_2$ qui est minimal. Nous nous reposons sur une méthode de projection. L'algorithme utilise aussi sur le procédé d'Arnoldi⁴ qui nous permet de créer une base orthonormée sur le sous-espace de Krylov. Dans la suite de ce chapitre, nous allons étudier ces composantes permettant d'arriver à l'écriture de notre algorithme.

Généralité

Nous avons le système linéaire suivant qui possède une unique solution x^* :

$$Ax = b \quad (3.24)$$

Le résidu initial est :

$$r_0 = b - Ax^{(0)} \quad (3.25)$$

L'algorithme GMRES repose sur une méthode de projection. On écrit donc le système sous sa forme résiduelle pour faire apparaître une projection :

$$\langle b - Ax^*, v \rangle = 0, \forall v \in \mathbb{R}^n \Leftrightarrow b - Ax^* \perp \mathbb{R}^n \quad (3.26)$$

Le but est maintenant de construire des solutions par itérations. On se place dans un sous-espace \mathbf{K} et on essaie de trouver dans ce sous-espace x tel que :

$$b - Ax \perp \mathbf{K} \Rightarrow \langle Au, v \rangle = \langle b, v \rangle, v \in \mathbf{K} \quad (3.27)$$

On généralise cette méthode grâce à deux sous-espaces : \mathbf{K} et \mathbf{L} . On cherche $x \in u_0 + \mathbf{K}$ avec :

$$b - Ax \perp \mathbf{L} \Rightarrow \langle Au, v \rangle = \langle b, v \rangle, v \in \mathbf{L} \quad (3.28)$$

C'est la condition de Petrov-Galerkin.

4. <https://docplayer.fr/215470-Calcul-matriciel-et-systemes-lineaires.html> (page 36)

Sous la forme matricielle, nous allons créer deux matrices V et W , de taille $n \times m$, définies par les vecteurs des bases de \mathbf{K} et \mathbb{L} :

$$V = (V_1 \ V_2 \ \dots \ V_m) \quad (3.29)$$

$$W = (W_1 \ W_2 \ \dots \ W_m) \quad (3.30)$$

Soit $(y, z) \in (\mathbb{R}^m)^2$. Nous pouvons définir $v \in \mathbf{K}$ et $w \in \mathbb{L}$:

$$v = Vy \quad (3.31)$$

$$w = Wz \quad (3.32)$$

Il nous faut maintenant trouver la solution de $x = x_0 + Vy \in \mathbf{K}$. Alors, grâce à 3.26 et 3.28, nous écrivons :

$$\langle Av, w \rangle = \langle r^0, w \rangle \quad \forall w \in L \quad (3.33)$$

$$\langle AVy, Wz \rangle = \langle r^0, Wz \rangle \quad \forall z \in \mathbb{R}^m \quad (3.34)$$

$$Avy = r^0 \quad (3.35)$$

$$y = (W^t AV)^{-1} W^t r^0 \quad (3.36)$$

Nous obtenons donc la solution :

$$x = x_0 + V(W^t AV)^{-1} W^t r^0 \quad (3.37)$$

Nous pouvons donc maintenant expliquer ce que notre méthode de projection va faire. Il faut savoir qu'une méthode de projection est itérative et va à chaque itération faire deux choses :

- construire les sous-espaces \mathbf{K} et \mathbb{L}
- chercher la nouvelle itération dans $u + K$ par le procédé exposé ci-dessus.

Voici donc le principe général des méthodes de projection :

1. Choisir \mathbf{K}^m et \mathbb{L}^m : deux sous-espaces de \mathbb{R}^n de même dimension m
2. Construire V_m et W_m
3. Calculer le résidu : $r = b - Ax^{(k)}$
4. Résoudre le système $y = (W_m^t AV_m)^{-1} W_m^t r$
5. Créer la nouvelle solution : $x = x + V_m y$

Pour créer le sous-espace \mathbb{L} , il y a deux méthodes :

- $L = K$ donne lieu à la méthode du gradient conjugué
- $L = AK$ donne lieu à la méthode GMRES.

La méthode du gradient conjugué ayant été vue en cours, nous avons choisi la deuxième méthode de génération de L. Dans les deux cas cela revient à résoudre le problème des moindres carrés :

$$\begin{cases} \text{On cherche } x^{(k)} \in x_0 + \mathbf{K}_m \text{ tel que :} \\ \min_{v \in \mathbf{K}_m} \frac{1}{2} \|A(x_0 + v) - b\|_2^2 \end{cases} \quad (3.38)$$

La démonstration liant les deux problèmes ne sera pas réalisée ici.⁵

Explication de l'algorithme GMRES

Cet algorithme se base dans un premier temps sur les itérations d'Arnoldi. Ici nous ne présenterons que la version qui est moins sensible aux erreurs d'arrondi car notre but est de justifier l'implémentation numérique de l'algorithme. Ce procédé d'Arnoldi a pour but de créer une base orthonormée du sous-espace de Krylov. Le procédé se résume par :

1. $v_1 = \frac{r_0}{\|r_0\|}$
2. Pour $j = 1, \dots, m$; on calcule : $w = Av_j$
3. Pour $i = 1, \dots, j$; on calcule : $w = w - (w, v_i)v_i$
4. $\bar{v}_{j+1} = \frac{w}{\|w\|}$

Nous introduisons alors un objet : $\bar{H}_m = (h_{ij})$ la matrice de Hessenberg :

$$h_{ij} = \begin{cases} \langle Av_j, v_i \rangle, & i \leq j \\ \|v_{j+1}\|, & i = j + 1 \\ 0, & \text{sinon} \end{cases} \quad (3.39)$$

Cet objet permet d'écrire de façon matricielle notre procédé car :

$$AV_m = V_{m+1}\bar{H}_m \quad (3.40)$$

et :

$$\bar{v}_{j+1} = Av_j - \sum_{i=1}^j h_{i,j}v_i \quad (3.41)$$

$$\Leftrightarrow Av_j = \bar{v}_{j+1} + \sum_{i=1}^j h_{i,j}v_i \quad (3.42)$$

$$\Leftrightarrow Av_j = h_{j+1,j}v_{j+1} + \sum_{i=1}^j h_{i,j}v_i \quad (3.43)$$

5. Elle se trouve ici : https://www2.mat.ulaval.ca/fileadmin/Cours/MAT-17992/notes_gmres.pdf

Par ce procédé, nous arrivons à construire une base orthonormée de l'espace de Krylov.

Maintenant que nous avons cette base, nous pouvons résoudre le problème des moindres carrés exprimé ci-dessus (cf. équation 3.38). Nous obtenons les propriétés suivantes (qui ne seront pas démontrées) :

- $\|r_{m+1}\| \leq \|r_m\|$
- L'algorithme converge en n itérations au maximum car $\mathcal{K}_m(A, r_0) = \mathbb{R}^n$ ⁶

Voici le code et le pseudo-code de l'algorithme :

```

1 def GMRES(A, b, epsilon):
2     max_iter = A.shape[0] #Number of maxiter
3     mat_q = np.zeros((max_iter, max_iter + 1))
4     mat_h = np.zeros((max_iter + 1, max_iter))
5     norm_b = np.linalg.norm(b)
6     be1 = np.zeros(max_iter + 1)
7     be1[0] = norm_b
8     mat_q[:, 0] = 1 / np.linalg.norm(b) * b.T # On définit ici que
9     ↪ l'on a forcément x0 = 0 (r0 = b)
10    for j in range(max_iter):
11        mat_q[:, j+1] = A @ mat_q[:, j]
12        for i in range(j+1):
13            mat_h[i, j] = mat_q[:, i] @ mat_q[:, j + 1]
14            mat_q[:, j+1] -= mat_h[i, j] * mat_q[:, i]
15        mat_h[j + 1, j] = np.linalg.norm(mat_q[:, j + 1])
16        mat_q[:, j + 1] /= mat_h[j + 1, j]
17        y = np.linalg.lstsq(mat_h, be1, rcond=None)[0]
18        residue = np.linalg.norm(y) / norm_b
19        if residue < epsilon:
20            return mat_q[:max_iter, :max_iter] @ y, residue
21    return mat_q[:max_iter, :max_iter] @ y

```

Résultat de l'algorithmes

Après implémentation de l'algorithme sur python, nous obtenons des résultats assez satisfaisants. Nous avons voulu tester la robustesse de l'algorithme que nous avons implémenté. Pour cela nous avons généré plusieurs systèmes à résoudre. Afin de compliquer la tâche de l'algorithme, nous générons des problèmes, dont la taille de la matrice dépasse les 1000 lignes, sans aucun conditionnement. Pour ce faire nous générons aléatoirement les

6. La démonstration se trouve ici : <https://www.math.kth.se/na/SF2524/matber15/gmres.pdf>

Generalized Minimum Residual Method (GMRES)

```

 $x_0$  = initial guess
 $r = b - Ax_0$ 
 $q_1 = r / \|r\|_2$ 
for  $k = 1, 2, \dots, m$ 
     $y = Aq_k$ 
    for  $j = 1, 2, \dots, k$ 
         $h_{jk} = q_j^T y$ 
         $y = y - h_{jk}q_j$ 
    end
     $h_{k+1,k} = \|y\|_2$  (If  $h_{k+1,k} = 0$ , skip next line and terminate at bottom.)
     $q_{k+1} = y / h_{k+1,k}$ 
    Minimize  $\|Hc_k - [\|r\|_2 \ 0 \ 0 \dots 0]^T\|_2$  for  $c_k$ 
     $x_k = Q_k c_k + x_0$ 
end

```

FIGURE 3.1 – Algorithme GMRES

matrices en prenant des nombres entre 100 et 1000. Ensuite nous calculons l'erreur sur ce résultat par :

$$\epsilon = |Ax^* - b| \quad x^* \text{ étant la solution donnée par l'algorithme} \quad (3.44)$$

Voici le graphique que nous obtenons :

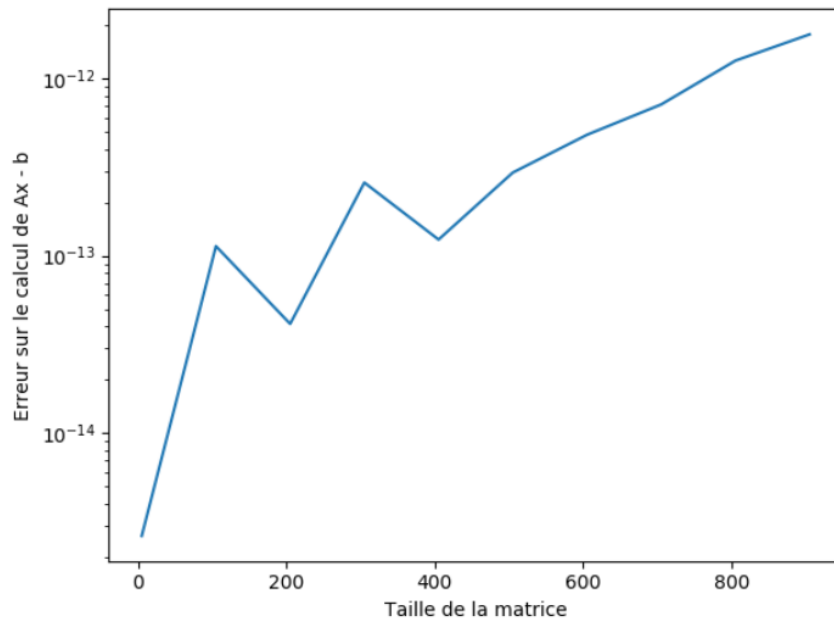


FIGURE 3.2 – Erreur sur la résolution des systèmes avec l'algorithme GMRES

Nous pouvons conclure de celui-ci que l'algorithme est robuste. En effet, l'erreur dans le calcul fait ci-dessus est négligeable quelle que soit la taille de la matrice.

Chapitre 4

Des algorithmes complexes...

4.1 Optimisation théorique des méthodes

4.1.1 Préconditionnement pour une méthode itérative

On peut illustrer les problèmes des méthodes itératives à travers la méthode du gradient conjugué. En effet, les conditionnements des matrices étudiées sont parfois très grands et il est ainsi nécessaire d'effectuer une opération dite de preconditionnement afin de minimiser les résidus des itérations.

Dans ce but, on introduit une matrice de preconditionnement que l'on note C . Cette matrice interviendra dans l'algorithme du gradient conjugué afin de l'optimiser. La matrice C diffèrera selon la méthode de preconditionnement choisie. Dans ce mémoire, nous nous focaliserons sur la méthode SSOR.

L'objectif mathématique de l'introduction de la matrice C est de mieux répartir les valeurs propres du système linéaire étudié, ce qui va permettre d'accélérer la méthode du gradient conjugué.

En effet, une meilleure répartition des valeurs propres de la matrice liée au système étudié permet de faire rapprocher les lignes de niveau de la fonction associée au système vers des cercles. Cela permettra ensuite d'avoir moins d'itérations pour la méthode de descente du gradient conjugué.

Nous aborderons dans ce mémoire, deux méthodes de preconditionnement, celle de Jacobi et celle dite SSOR. Les méthodes de preconditionnement du gradient conjugué introduisent une suite z_k , résultant du produit matriciel entre C et le résidu à l'ordre k , noté r_k . Ensuite, les calculs des coefficients nécessaires à l'application de la méthode utiliseront à la fois la suite z_k et le résidu r_k .

Préconditionnement de Jacobi

Le preconditionnement de Jacobi est le plus simple pour le gradient conjugué. Cette méthode est donc intéressante lorsqu'une grande précision n'est pas requise. Étant moins précise, elle est plus facile à implémenter numériquement mais n'améliore pas autant la résolution du problème par méthode du gradient conjugué que la SSOR par exemple.

Le preconditionnement de Jacobi consiste à prendre pour matrice de preconditionnement C :

$$C_{i,j} \begin{cases} A_{i,i} & \text{si } i = j \\ 0 & \text{sinon} \end{cases}$$

La matrice C correspond donc à la diagonale de A . Le produit entre C et le résidu se fait aisément puisque tous les termes extradiagonaux sont nuls. Cependant, si l'on souhaite avoir une méthode de preconditionnement améliorant grandement les performances de l'algorithme du gradient conjugué, le preconditionnement de Jacobi n'est pas adapté. Pour ces cas de figure, nous pouvons utiliser la méthode SSOR.

Préconditionnement SSOR

La méthode SSOR (Symetric Successive Over Relaxation) permet d'améliorer le gradient conjugué de meilleure manière que la méthode de Jacobi mais elle est plus difficile à mettre en place. En effet, la matrice A du système $Ax = b$ doit être symétrique.

Une méthode simple de décrire cette méthode est de la présenter comme étant deux applications de la méthode SOR (décrite auparavant), successives, dans des sens contraires. La première application permet de preconditionner le système et la deuxième permet de le résoudre.

Concrètement, on décompose la matrice A en :

$$A = L + D + L^T$$

D étant la matrice comportant la diagonale de A et L une matrice triangulaire inférieure. La matrice C est donc définie par :

$$C(\omega) = \frac{\omega}{2-\omega} \left(\frac{D}{\omega} + L \right) D^{-1} \left(\frac{D}{\omega} + L^T \right)$$

Étant donné que cette méthode consiste en deux SOR successives, la condition nécessaire et suffisante de convergence de la méthode est identique à celle de la SOR. Il suffit que le paramètre de relaxation ω soit dans l'intervalle $]0; 2[$.

4.1.2 Les limites de l'optimisation mathématique

Bien que les méthodes d'optimisation numérique vues précédemment permettent d'améliorer de manière significative les performances d'un algorithme (plus particulièrement celui du gradient conjugué dans le cas précédent), cela peut ne pas être suffisant lorsque nous avons affaire à des systèmes de grande taille avec des coefficients élevés dans la matrice liée au système. Il est donc nécessaire de coupler l'optimisation mathématique (par les méthodes de préconditionnement), à des études de performances numériques avec des méthodes d'optimisation lors de l'implémentation de ces algorithmes sur nos machines.

4.2 Étude des performances

Chapitre 5

Conclusion & ouverture

Énormément de problèmes peuvent aujourd’hui se caractériser où s’approximer par un système linéaire qu’il faut résoudre. C’est dans cette optique que nous avons étudié de nouveaux moyens de résoudre, à travers les méthodes itératives, ces systèmes. En partant de la base de ces méthodes, et en complexifiant à chaque étape le procédé de résolution nous sommes parvenus à améliorer nos algorithmes.

La première étape fut de partir des algorithmes de Jacobi et Gauss-Seidel. En introduisant une décomposition particulière sous la forme $M - N$, nous avons pu paramétrer la décomposition par un nombre, nous permettant de redécouvrir la méthode de Richardson. Celle-ci permet de choisir pour chaque matrice un nombre α optimal qui accroît la vitesse de convergence. Cette nouvelle méthode sera ensuite améliorée par le procédé de relaxation et l’algorithme SOR qui donne d’encore meilleurs résultats. L’amélioration de ce dernier, par la méthode SSOR a également été présentée.

Cependant, cela n’était pas suffisant car un problème n’avait pas encore de solution. En effet, il fallait nous assurer que nos algorithmes étaient robustes mais surtout que nous pouvions assurer leur convergence en un nombre fini d’itérations relativement petit et connu à l’avance si possible. Dans ce but, nous avons introduit les espaces de Krylov. Ils nous ont permis d’obtenir un cadre théorique et des méthodes surpassant tous les autres procédés itératifs par leur précision, leur rapidité, leur robustesse et leur application à n’importe quel cas. Ce cadre théorique a été ensuite implémenté par l’algorithme GMRES que nous avons codé.

La dernière partie de notre travail a porté sur l’optimisation numérique de ces méthodes afin de faire converger les algorithmes sur un ordinateur. Notre travail était principalement de faire quelques tests de benchmark sur les différents procédés.

Néanmoins, le travail effectué dans ce rapport n’est qu’un premier pas. En effet, nous

sommes capable de résoudre très convenablement tous les problèmes linéaires qui peuvent se présenter à nous. Cependant, il ne faut pas oublier qu'en général les problèmes ne sont pas linéaires. Ainsi, il faut maintenant trouver un moyen de linéariser les problèmes. De plus, nos méthodes s'appliquent lorsque le système linéaire possède une unique solution mais certains systèmes n'ont pas de solutions ou une infinité. Il faudra donc construire de nouvelles méthodes pour ces systèmes.

Liste des sigles et acronymes

Table des figures

3.1	Algorithme GMRES	19
3.2	Erreur sur la résolution des systèmes avec l'algorithme GMRES	19

Liste des tableaux