

Eigenwertberechnung mithilfe des Lanczos-Verfahrens (Handout)

Göth Christian

Moik Matthias

Sallinger Christian

15. Januar 2021

1 Definitionen, Lemmata und Sätze

Definition 1.1. Sei $v_0 \in \mathbb{K}^N$ und $A \in \mathbb{K}^{N \times N}$. Dann bezeichnet

$$\mathcal{K}_m(A, v_0) := \text{span}\{v_0, Av_0, \dots, A^{m-1}v_0\}, \quad m \in \mathbb{N}$$

den Krylov-Raum von A und v_0 . Es bezeichne $\mathcal{P}_m : \mathbb{K}^N \rightarrow \mathcal{K}_m$ die orthogonale Projektion auf \mathcal{K}_m .

Lemma 1.2. Sei Π_m der Raum der Polynome in einer Veränderlichen mit maximalem Grad m . Dann ist $v \in \mathcal{K}_m(A, v_0) \subset \mathbb{K}^N$ genau dann, wenn ein Polynom $p \in \Pi_{m-1}$ existiert mit $v = p(A)v_0$.

Ist A diagonalisierbar mit Eigenwerten $\lambda_1, \dots, \lambda_N$ und zugehörigen Eigenvektoren u_1, \dots, u_N , dann existiert eine eindeutige Darstellung $v_0 = \sum_{j=1}^N \alpha_j u_j$ und es gilt

$$v \in \mathcal{K}_m \Leftrightarrow \exists p \in \Pi_{m-1} : v = \sum_{j=1}^N p(\lambda_j) \alpha_j u_j.$$

Lemma 1.3. Sei $A \in \mathbb{C}^{N \times N}$ hermitesch bezüglich des Skalarproduktes (\cdot, \cdot) , $\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \dots \geq \lambda_N$ die Eigenwerte von A (gemäß Vielfachheit gezählt) und u_1, \dots, u_N die zugehörigen normierten Eigenvektoren. Dann gilt

$$\lambda_1 = \max_{v \in \mathbb{C}^N \setminus \{0\}} \frac{(Av, v)}{(v, v)}, \quad \lambda_k = \max_{\substack{v \in \mathbb{C}^N \setminus \{0\} \\ (u_j, v) = 0, j=1, \dots, k-1}} \frac{(Av, v)}{(v, v)}, \quad k = 2, \dots, N \quad (1)$$

und

$$\lambda_k = \max_{\substack{S \subset \mathbb{C}^N \\ \dim S = k}} \min_{v \in S \setminus \{0\}} \frac{(Av, v)}{(v, v)}. \quad (2)$$

Definition 1.4. Für $m \in \mathbb{N}$ sind die Chebyshev-Polynome $T_m \in \Pi_m$ definiert durch

$$T_m(x) := \frac{1}{2}((x + \sqrt{x^2 - 1})^m + (x - \sqrt{x^2 - 1})^m), \quad x \in \mathbb{R}. \quad (3)$$

Alternative Definitionen der Chebyshev-Polynome:

$$T(x) := \cos(m \arccos x), \quad x \in [-1, 1]. \quad (4)$$

Lemma 1.5. Sei $[a, b]$ ein nicht-leeres Intervall in \mathbb{R} und sei $c \geq b$. Dann gilt mit $\gamma := 1 + 2\frac{c-b}{b-a} > 0$

$$\min_{\substack{p \in \Pi_m \\ p(c)=1}} \max_{x \in [a, b]} |p(x)| \leq \frac{1}{|T_m(\gamma)|} \leq 2(\gamma + \sqrt{\gamma^2 - 1})^{-m}. \quad (5)$$

Satz 1.6 (Konvergenz der Eigenwerte hermitescher Matrizen). Sei $A \in \mathbb{K}^{n \times n}$ eine hermitesche Matrix mit paarweise verschiedenen Eigenwerten $\lambda_1 > \lambda_2 > \dots > \lambda_n$ und der zugehörigen Orthonormalbasis aus Eigenvektoren u_1, \dots, u_n . Für $1 \leq m < n$ werden die Eigenwerte der linearen Abbildung $\mathcal{A}_m : \mathcal{K}_m(A, v_0) \rightarrow \mathcal{K}_m(A, v_0)$, die durch $v \mapsto \mathcal{P}_m A v$ gegeben ist, mit $\lambda_1^{(m)} \geq \lambda_2^{(m)} \geq \dots \geq \lambda_m^{(m)}$ bezeichnet. Dabei ist v_0 ein beliebiger Startvektor, der nicht orthogonal zu den ersten $m-1$ Eigenvektoren von A ist. Dann gilt

$$0 \leq \lambda_i - \lambda_i^{(m)} \leq (\lambda_i - \lambda_n)(\tan \theta_i)^2 \kappa_i^{(m)} \left(\frac{1}{T_{m-i}(\gamma_i)} \right)^2, \quad i = 1, \dots, m-1 \quad (6)$$

wobei

$$\tan \theta_i := \frac{\|(\text{id} - \mathcal{P}_{u_i})v_0\|}{\|\mathcal{P}_{u_i} v_0\|}, \quad \gamma_i := 1 + 2 \frac{\lambda_i - \lambda_{i+1}}{\lambda_{i+1} - \lambda_n}$$

und

$$\kappa_1^{(m)} := 1, \quad \kappa_i^{(m)} := \left(\prod_{j=1}^{i-1} \frac{\lambda_j^{(m)} - \lambda_n}{\lambda_j^{(m)} - \lambda_i} \right)^2, \quad i = 2, \dots, m.$$