

AA 2019-2020 - Metodi del Calcolo Scientifico - Progetto 3

Algebra lineare numerica Mini libreria per sistemi lineari

Descrizione generica

Si utilizzi un linguaggio di programmazione a vostra scelta: c++, fortran, java, python, etc. Lo scopo del progetto è quello di implementare una mini libreria che esegua i seguenti solutori iterativi, limitatamente al caso di matrici simmetriche e definite positive:

- (1) metodo di Jacobi;
- (2) metodo di Gauß-Seidel;
- (3) metodo del Gradiente;
- (4) metodo del Gradiente coniugato.

Per la gestione della struttura dati e le operazioni elementari fra matrici è richiesto di partire da una libreria *open-source*, come Eigen, Armadillo, blas/lapack. Oppure, qualora il linguaggio di programmazione lo permetta, utilizzare vettori e matrici già implementate al suo interno.

Richieste sulla libreria

Sarà valutato positivamente che la libreria abbia un'architettura e sia ben strutturata, invece che sia una sequenza di funzioni indipendenti le une dalle altre. Inoltre, deve soddisfare i seguenti requisiti:

- (a) operare con ognuno dei metodo iterativi (1)-(4) sopra menzionati. A tal proposito la libreria scelta come base deve fornire *solamente* la struttura dati di matrici e vettori NON possono essere utilizzati i metodi relativi alla risoluzione dei sistemi lineari già implementati al suo interno. Per esempio la libreria Eigen contiene già al suo interno l'implementazione del metodo di Jacobi, tale metodo NON è valido ai fini della consegna.
- (b) i metodi iterativi devono partire dal vettore iniziale nullo (vettore con tutte le entrate pari a zero) e arrestarsi qualora la k-esima iterata $\mathbf{x}^{(k)}$ soddisfa

$$\frac{\|A\mathbf{x}^{(k)} - \mathbf{b}\|}{\|\mathbf{b}\|} < \text{tol} ,$$

con `tol` tolleranza assegnata dal utente. Oltre a questo controllo sulla soluzione $\mathbf{x}^{(k)}$, i metodi iterativi dovranno avere un controllo sul numero

massimo di iterazioni. Più precisamente tutte le routine dovranno arrestarsi (e segnalare di non essere giunte a convergenza) se

$$k > \text{maxIter},$$

dove **maxIter** è un numero *molto elevato* a vostra scelta (non inferiore a 20000).

(c) il codice deve avere il formato di un eseguibile che, presi come input:

- una matrice A simmetrica e definita positiva,
- un membro destro \mathbf{b} ,
- un vettore soluzione esatta \mathbf{x} ,
- una tolleranza **tol**,

applichi tutti quattro i metodi implementati e riporti su schermo le informazioni sui risultati ottenuti: errore relativo tra la \mathbf{x} esatta e la soluzione computata dal metodo, numero di iterazioni richieste e tempo di calcolo.

La routine di cui sopra va poi applicata alle matrici sparse salvate nei file in allegato: **spa1.mtx**, **spa2.mtx**, **vem1.mtx** e **vem2.mtx**. In particolare si dovrà seguire la procedura standard spiegata a lezione per la validazione dei metodi iterativi e la valutazione dell'errore, Sezione 2.4 delle note.

step 1) creare un vettore che rappresenterà la soluzione esatta che ha 1 in ogni entrata, i.e.,

$$\mathbf{x} = [1, 1, 1, \dots 1],$$

step 2) creare il vettore \mathbf{b} soluzione del sistema

$$\mathbf{b} = A \mathbf{x},$$

step 3) calcolare la soluzione approssimata (associata alla matrice A e il dato \mathbf{b}) con i *quattro* metodi iterativi,

step 4) calcolare l'errore relativo (tra la soluzione esatta \mathbf{x} e la soluzione approssimata ottenuta col codice), il numero di iterazioni e il tempo di calcolo.

La procedura precedente dovrà essere fatta per diverse scelte dell'input **tol** e utilizzando sempre lo stesso calcolatore. In particolare si dovranno considerare i seguenti valori

$$\text{tol} = [10^{-4}, 10^{-6}, 10^{-8}, 10^{-10}].$$

Nota per il formato .mtx. Il formato “.mtx” è uno standard per lo scambio delle matrici in ambito numerico. È un file ASCII la cui descrizione è riportata nel seguente link

<https://math.nist.gov/MatrixMarket/formats.html>

Inoltre la numerazione delle entrate delle matrici parte da 1.

Esame finale

All’esame finale dovrà essere portato un computer portatile con tutti i codici. Preparare una **breve relazione** che descriva la struttura della libreria, i risultati ottenuti organizzati in tabelle o grafici, e i commenti che pensate ne conseguano (che dovrà essere inviata 3 giorni prima del esame). Potrà essere richiesto di lanciare “on-the-fly” alcuni test su nuove terne $(A, \mathbf{b}, \mathbf{x})$.

Se avete dei dubbi mandate pure una email.