

第五讲 对称矩阵的特征值问题

- 1 Jacobi 迭代
- 2 Raylaogh 商迭代
- 3 对称 QR 迭代
- 4 分而治之法
- 5 对分法和逆迭代
- 6 奇异值分解
- 7 扰动分析

关于对称特征值问题的常用算法有（直接法）：● **Jacobi 迭代**：最古老，收敛速度较慢，但精度较高，且很适合并行计算。● **Rayleigh 商迭代**：一般具有三次收敛性，但需要解方程组。● **对称 QR 迭代**：对称矩阵的 QR 方法，对于对称三对角矩阵，若只计算特征值，则速度最快（运算量为 $\mathcal{O}(n^2)$ ）。如果还需要计算特征向量，则运算量约为 $6n^3$ 。● **分而治之法**：同时计算特征值和特征向量的一种快速算法。基本思想时将大矩阵分解形成小矩阵，然后利用递归思想求特征值。在最坏的情形下，运算量为 $\mathcal{O}(n^3)$ 。在实际应用中，平均为 $\mathcal{O}(n^{2.3})$ 。如果使用快速多极子算法 (FMM) 后，理论上的运算量可降低到 $\mathcal{O}(n \log^p n)$ ，其中 p 是一个较小的整数，这使得分而治之算法成为目前计算对称三对角矩阵的 **特征值和特征向量** 的首选方法。

● **对分法和反迭代**：对分法主要用于求解对称三交矩阵在某个区间中的特征值，运算量约为 $\mathcal{O}(kn)$ 。其中 k 为所需计算的特征值的个数。反迭代用于计算特征向量，在最佳情况下，即特征值“适当分离”时，运算量约为 $\mathcal{O}(kn)$ ，但在最差情况下，即特征值成串的紧靠在一起时，运算量约为 $\mathcal{O}(k^2n)$ ，而且不能保证特征向量的精度（虽然实际上它几乎是精确的）。

除了 Jacobi 迭代和 Rayleigh 商迭代外，其余算法都需要先将对称矩阵三对角化，这个过程大约需花费 $\frac{4}{3}n^3$ 的工作量，如果需要计算特征向量的话，则运算量约为 $\frac{8}{3}n^3$ 。

1 Jacobi 迭代

基本思想 通过一系列的 **Jacobi 旋转** 将 A 正交相似于一个对角矩阵：

$$A^{(0)} = A, A^{(k+1)} = J_k^T A^{(k)} J_k, k = 0, 1, \dots,$$

且 $A^{(0)}$ 收敛到一个对角矩阵，其中 J^k 为 Jacobi 旋转，即 Givens 变换：

$$J_k = G(i_k, j_k, \theta_k) = \begin{bmatrix} I & & & \\ & \cos \theta_k & \cdots & -\sin \theta_k \\ & \vdots & \ddots & \vdots \\ & \sin \theta_k & \cdots & \cos \theta_k \\ & & & I \end{bmatrix} \begin{matrix} i_k \\ \\ j_k \end{matrix}$$

引理 设 $A \in \mathbb{R}^{2 \times 2}$ 是对角矩阵。则存在 Givens 变换 $G \in \mathbb{R}^{2 \times 2}$ 使得 $G^T A G$ 为对角阵。

为了使 $A^{(K)}$ 收敛到一个对角矩阵, 其非对角素必须趋向于 0。
记 $\text{off}(A)$ 为所有非对角元素的平方和, 即

$$\text{off}(A) = \sum_{i \neq j} a_{ij}^2 = \|A^2\|_F^2 - \sum_{i=1}^n a_{ii}^2$$

我们的目标就是使得 $\text{off}(A)$ 尽快趋向于 0。

引理 设 $A = [a_{ij}]_{n \times n} \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 是对称矩阵。

$\hat{A} = [\hat{a}_{ij}]_{n \times n} = J^T A J, J = G(i, j, \theta)$, 其中 θ 的选取使得 $\hat{a}_{ij} = \hat{a}_{ji} = 0$, 则

$$\text{off}(\hat{A}) = \text{off}(A) - 2a_{ij}^2$$

算法 1.1 Jacobi 迭代算法

- 1: Given a symmetric matrix $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$
- 2: if eigenvectors are desired then
- 3: set $J = I$ and $\text{shift} = 1$
- 4: end if
- 5: while not converge do
- 6: choose an index pair (i, j) such that $a_{ij} \neq 0$
- 7: $\tau = (a_{ii} - a_{jj}) / (2a_{ii} - a_{jj})$
- 8: $t = \text{sign}(\tau / (|\tau| + \sqrt{1 + \tau^2}))$
- 9: $c = 1 / \sqrt{1 + t^2}$, $s = c \cdot t$
- 10: $A = G(i, j, \theta)^T A G(i, j, \theta)$
- 11: if $\text{shift} = 1$ then
- 12: $J = J \cdot G(i, j, \theta)$
- 13: end if
- 14: end while

a_{ij} 的选取问题

一种直观的选取方法就是使得 a_{ij} 为所有非对角元素中绝对值最大的一个，这就是经典 Jacobi 算法。

算法 1.2 经典 Jacobi 迭代算法

- 1: Given a symmetric matrix $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$
- 2: if eigenvectors are desired then
- 3: set $J = I$ and $\text{shift} = 1$
- 4: end if
- 5: while $\text{off}(A) > \text{tol}$ do
- 6: choose (i, j) such that $a_{ij} = \max_{k \neq l} |a_{kl}|$
- 7: $\tau = (a_{ii} - a_{jj}) / (2a - jj)$
- 8: $t = \text{sign}(\tau / (|\tau| + \sqrt{1 + \tau^2}))$
- 9: $c = 1 / \sqrt{1 + t^2}$, $s = c \cdot t$
- 10: $A = G(i, j, \theta)^T A G(i, j, \theta)$
- 11: if $\text{shift} = 1$ then
- 12: $J = J \cdot G(i, j, \theta)$
- 13: end if
- 14: end while

可以证明, 经典 Jacobi 算法至少是线性收敛的。

定理 经典 Jacobi 算法1.2, 有

$$\text{off}(A^{(k+1)}) \leq \left(1 - \frac{1}{N}\right) \mathcal{O}(\text{off}(A^{(k)})), N = \frac{n(n-1)}{2}$$

故 k 步迭代后, 有

$$\text{off}(A^{(k+1)}) \leq \left(1 - \frac{1}{N}\right)^k \mathcal{O}(\text{off}(A^{(0)})) = \left(1 - \frac{1}{N}\right)^k \mathcal{O}(\text{off}(A))$$

事实上, 经典 Jacobi 算法最终是二次局部收敛的。**定理** 经典 Jacobi 算法 1.2 是 N 步局部二次收敛的, 即对足够大的 k , 有

$$\text{off}(A^{(k+N)}) = \mathcal{O}(\text{off}^2(A^{(k)}))$$

循环 Jacobi 经典 Jacobi 算法的每一步都要寻找绝对值最大的非对角元, 费时不实用。改进: 逐行扫描。

算法 1.3 经典 Jacobi 迭代算法 (逐行扫描)

- 1: Given a symmetric matrix $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$
- 2: if eigenvectors are desired then
- 3: set $J = I$ and $\text{shift} = 1$
- 4: end if
- 5: while $\text{off}(A) > \text{tol}$ do
- 6: for $i = 1$ to $n - 1$ do
- 7: for $j = i + 1$ to n do
- 8: if $a_{ij} \neq 0$ then
- 9: $\tau = (a_{ii} - a_{jj}) / (2a_{ii} - a_{jj})$
- 10: $t = \text{sign}(\tau / (|\tau| + \sqrt{1 + \tau^2}))$
- 11: $c = 1 / \sqrt{1 + t^2}, s = c \cdot t$
- 12: $A = G(i, j, \theta)^T A G(i, j, \theta)$
- 13: if $\text{shift} = 1$ then
- 14: $J = J \cdot G(i, j, \theta)$
- 15: end if
- 16: end if
- 17: end for
- 18: end for

第五讲 对称矩阵的特征值问题

- 1 Jacobi 迭代
- 2 Raylaogh 商迭代
- 3 对称 QR 迭代
- 4 分而治之法
- 5 对分法和逆迭代
- 6 奇异值分解
- 7 扰动分析

2 Raylaogh 商迭代

反迭代方法中，以 Rayleigh 商作为位移。

关于 Rayleigh 商迭代的收敛性，我们有下面的结论。

定理 设 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 对称，且特征值都是单重的。则当误差足够小时，Rayleigh 商迭代中每步迭代所得的正确数字的位数曾至三倍，即 Rayleigh 商迭代是局部三次收敛。

第五讲 对称矩阵的特征值问题

- 1 Jacobi 迭代
- 2 Raylaogh 商迭代
- 3 对称 QR 迭代**
- 4 分而治之法
- 5 对分法和逆迭代
- 6 奇异值分解
- 7 扰动分析

3 对称 QR 迭代

将带位移的隐式 QR 方法运用到对称矩阵，就得到对称 QR 迭代方法。基础步骤：

1. 对称三对角化：利用 Householder 变换，将 A 化为对称三对角矩阵，即计算正交矩阵 Q 使得 $T = QAQ^T$ 为对称三对角矩阵；
2. 使用带（单）位移的隐式 QR 迭代算法计算 T 的特征值与特征向量；
3. 计算 A 的特征向量。

对称三对角化

任何一个对称矩阵 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 都可以通过正交变换转化成一个对称三对角矩阵 T 。这个过程可以通过 Householder 变换来实现，也可以通过 Givens 变换来实现。

对称 QR 迭代算法的运算量

- 三对角化 $4n^3/3 + \mathcal{O}(n^2)$, 若需计算特征向量, 则为 $8n^3/3 + \mathcal{O}(n^2)$;
- 对 T 做带位移的隐式 QR 迭代, 每次迭代的运算量为 $6n$;
- 计算特征值, 假定每个平均迭代 2 步, 则总运算量为 $12n^2$;
- 若要计算 T 的所有特征值和特征向量, 则运算量为 $6n^3 + \mathcal{O}(n^2)$;
- 若只要计算 A 的所有特征值, 运算量为 $4n^3/3 + \mathcal{O}(n^2)$;
- 若计算 A 的所有特征值和特征向量, 则运算量为 $26n^3/3 + \mathcal{O}(n^2)$;

位移的选取——Wilkinson 位移

位移的好坏直接影响到算法的收敛速度。我们可以通过下面的方式来选取位移。设

$$A^{(k)} = \begin{bmatrix} a_1^{(k)} & b_1^{(k)} & & & \\ b_1^{(k)} & \ddots & \ddots & & \\ & \ddots & \ddots & b_{n-1}^k & \\ & & b_{n-1}^{(k)} & a_n^{(k)} & \end{bmatrix}$$

一种简单的位移选取策略就是令 $\sigma_k = a_n(K)$ 。事实上, $a_n^{(k)}$ 就是收敛到特征向量的迭代向量的 Rayleigh 商。这种位移选取方法几乎对所有的矩阵都有三次渐进收敛速度。但也存在不收敛的例子, 故我们需要对其做改进。

Wilkinson 位移：取 $\begin{bmatrix} a_{n-1}^{(k)} & b_{n-1}^{(k)} \\ b_{n-1}^{(k)} & a_n^{(k)} \end{bmatrix}$ 的最接近 $a_n^{(k)}$ 的特征值作为位移。通过计算可得 Wilkinson 位移为

$$\sigma = a_n^{(k)} + \delta - \text{sign}(\delta) \sqrt{\delta^2 + (b_{n-1}^{(k)})^2}$$

, 其中 $\delta = \frac{1}{2}(a_{n-1}^{(k)} - a_n^{(k)})$ 出于稳定性方面的考虑, 我们通常用下面的计算公式

$$\sigma = a_n^{(k)} - \frac{(b_{n-1}^{(k)})^2}{\delta + \text{sign}(\delta) \sqrt{\delta^2 + (b_{n-1}^{(k)})^2}} \quad (1)$$

定理 采用 Wilkinson 位移的 QR 迭代时整体收敛的, 且至少是线性收敛。事实上, 几乎所有的矩阵都是渐进三次收敛的。

例 帶 Wilkinson 位移的隱式 QR 迭代算法收斂性演示。
MATLAB 代碼：EigTriQR.m

第五讲 对称矩阵的特征值问题

- 1 Jacobi 迭代
- 2 Raylaogh 商迭代
- 3 对称 QR 迭代
- 4 分而治之法**
- 5 对分法和逆迭代
- 6 奇异值分解
- 7 扰动分析

4 分而治之法

分而治之法由 Cuppen 于 1981 年首次提出, 但直到 1995 年才出现稳定的实现方式, 是目前计算**所有特征值和特征向量**的最快算法。

考虑不可约对称三对角矩阵

$$T = \left[\begin{array}{ccc|ccc} a_1 & b_1 & & & & \\ & b_1 & \ddots & & & \\ & & \ddots & a_{m-1} & b_{m-1} & \\ & & & b_{m-1} & a_m & \\ & & & & b_m & \\ \hline & & & & b_m & a_{m+1} & b_{m+1} \\ & & & & & b_{m+1} & \ddots & \\ & & & & & & \ddots & b_{n-1} \\ & & & & & & & b_{n-1} & a_n \end{array} \right]$$

$$\begin{aligned}
&= \left[\begin{array}{ccc|ccc} a_1 & b_1 & & & & \\ b_1 & \ddots & \ddots & & & \\ & \ddots & a_{m-1} & b_{m-1} & & \\ & & b_{m-1} & a_m - b_m & & \\ \hline & & & a_{m+1} - b_m & b_{m+1} & \\ & & & b_{m+1} & \ddots & \ddots \\ & & & & \ddots & \ddots & b_{n-1} \\ & & & & & b_{n-1} & a_n \end{array} \right] + \left[\begin{array}{c|c} & \\ \hline b_m & b_m \\ \hline b_m & b_m \end{array} \right] \\
&= \left[\begin{array}{c|c} T_1 & 0 \\ \hline 0 & T_2 \end{array} \right] + b_m v v^T,
\end{aligned}$$

其中 $v = [0, \dots, 0, 1, 1, 0, \dots, 0]^T$ 。

假定 T_1 和 T_2 的特征值已经计算出来

即 $T_1 = Q_1 \Lambda_1 Q_1^T$, $T_2 = Q_2 \Lambda_2 Q_2^T$, 下面考虑 T 的特征值分解。

$$\begin{aligned} T = \begin{bmatrix} T_1 & 0 \\ 0 & T_2 \end{bmatrix} + b_m v v^T &= \begin{bmatrix} Q_1 \Lambda_1 Q_1^T & 0 \\ 0 & Q_2 \Lambda_2 Q_2^T \end{bmatrix} + b_m v v^T \\ &= \begin{bmatrix} Q_1 & 0 \\ 0 & Q_2 \end{bmatrix} \left(\begin{bmatrix} \Lambda_1 & 0 \\ 0 & \Lambda_2 \end{bmatrix} + b_m u u^T \right) \begin{bmatrix} Q_1 & 0 \\ 0 & Q_2 \end{bmatrix} \end{aligned}$$

其中

$$u = \begin{bmatrix} Q_1 & 0 \\ 0 & Q_2 \end{bmatrix}^T, v = \begin{bmatrix} Q_1^T \text{的最后一列} \\ Q_2^T \text{的第一列} \end{bmatrix}$$

令 $a = b_m$, $D = \text{diag}(\Lambda_1, \Lambda_2) = \text{diag}(d_1, d_2, \dots, d_n)$, 并假定 $d_1 \geq d_2 \geq \dots \geq d_n$, 则 T 的特征值于 $D + \alpha u u^T$ 的特征值相同。

考虑 $D + \alpha uu^T$ 的特征值

设 λ 是 $D + \alpha uu^T$ 的一个特征值, 若 $D - \lambda I$ 非奇异, 则

$$\det(D + \alpha uu^T - \lambda I) = \det(D - \lambda I) \cdot \det(I + \alpha(D - \lambda I)^{-1} uu^T)$$

故 $\det(D + \alpha uu^T - \lambda I) = 0$ 。

引理 设 $x, y \in \mathbb{R}^n$, 则 $\det(I + xy^T) = 1 + y^T x$ 。

于是

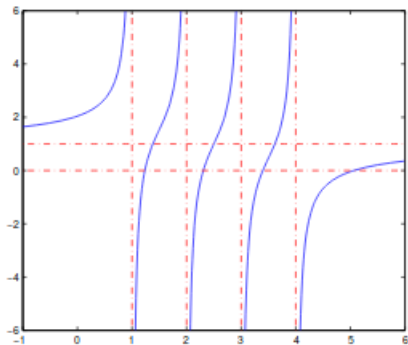
$$\det(I + \alpha(D - \lambda I)^{-1} uu^T) = 1 + \alpha u^T (D - \lambda I)^{-1} u = 1 + \alpha \sum_{i=1}^n \frac{u_i^2}{d_i - \lambda} \triangleq f(\lambda)$$

故求 A 的特征值等价于求特征方程 $f(\lambda) = 0$ 的根。

由于

$$f'(\lambda) = \alpha \sum_{i=1}^n \frac{u_i^2}{(d_i - \lambda)}$$

当所有的 d_i 都互不相同，且所有的 u_i 都不为零时， $f(\lambda)$ 在 $\lambda \neq d_i$ 处都是严格单调的。



所以 $f(\lambda)$ 在每隔区间 (d_{i+1}, d_i) 内都有一个根, 共 $n-1$ 个, 另一个根在 (d_1, ∞) (若 $\alpha > 0$) 或 $(-\infty, d_n)$ (若 $\alpha < 0$) 中。

由于 $f(\lambda)$ 在每个区间 (d_{i+1}, d_i) 内光滑且严格单调递增 ($\alpha > 0$) 或递减 ($\alpha < 0$), 所以在实际计算中, 可以使用对分法, 牛顿法及其变形, 或有理逼近等算法求解。通常都很快收敛, 一般只需迭代几步即可。

因此, 计算一个特征值的运算量约为 $\mathcal{O}(n)$, 计算 $D + \alpha uu^T$ 的所有特征向量。

引理 设 $D \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 为对角矩阵, $u \in \mathbb{R}^n, \alpha \in \mathbb{R}$, 若 λ 是 $D + \alpha uu^T$ 的特征值, 且 $\lambda \neq d_i, i = 1, 2, \dots, n$, 则 $(D - \lambda I)^{-1}u$ 是其对应的特征向量。

算法 4.1 计算对称三对角矩阵的特征值和特征向量的分而治之法

- 1: function $[Q, \Lambda] = \text{dc_eig}(T)$ % $T = Q\Lambda Q^T$
- 2: if T is of 1×1 then
- 3: $Q = 1, \Lambda = T$
- 4: return
- 5: end if
- 6: form $T = \begin{bmatrix} T_1 & 0 \\ 0 & T_2 \end{bmatrix} + b_m v v^T$
- 7: $[Q_1, \Lambda_1] = \text{dc_eig}(T_1)$
- 8: $[Q_2, \Lambda_2] = \text{dc_eig}(T_2)$
- 9: form $D + \alpha u u^T$ from $\Lambda_1, \Lambda_2, Q_1, Q_2$
- 10: compute the eigenvalues Λ and eigenvectors \hat{Q} of $D + \alpha u u^T$
- 11: compute the eigenvalues of T with $Q = \begin{bmatrix} Q_1 & 0 \\ 0 & Q_2 \end{bmatrix} \cdot \hat{Q}$
- 12: end

在分而治之法中, 计算特征值和计算特征向量是同时进行的。

下面我们详细讨论分而治之算法的几个细节问题：

- ① 如何减少运算量；
- ② 如何求解特征方程 $f(\lambda) = 0$ ；
- ③ 如何稳定的计算特征向量。

(1) 如何减小运算量——收缩技巧 (deflation)

分而治之算法的计算复杂性分析如下：用 $t(n)$ 表示对 n 阶矩阵调用函数 `dc_eig` 的运算量，则

$$\begin{aligned} t(n) &= 2t(n/2) && \text{递归调用dc_eig两次} \\ &+ \mathcal{O}(n^2) && \text{计算 } D + \alpha uu^T \text{ 的特征值和特征向量} \\ &+ c \cdot n^3 && \text{计算 } Q \end{aligned}$$

如果计算 Q 时使用的是稠密矩阵乘法，则 $c = 2$ ；若不计 $\mathcal{O}(n^2)$ 项，则由递归公式 $t(n) = 2t(n/2) + c \cdot n^3$ 可得 $t(n) \approx c \cdot 4n^3/3$ 。
但事实上，由于收缩现象的存在，常熟 c 通常比 1 小得多。

在前面的算法描述过程中，我们假定 d_i 互不相等且 u_i 不能等于零。事实上，当 $d_i = d_{i+1}$ 或 $u_i = 0$ 时， d_i 即为 $D + \alpha uu^T$ 的特征值，这种现象我们成为收缩。

在实际计算时，当 $d_i - d_{i+1}$ 或 $|u_i|$ 小于一个给定的阈值时，我们就认为 d_i 为 $D + \alpha uu^T$ 的特征值，即出现收缩现象。

在实际计算中，收缩现象会经常发生，而且会非常频繁，所以我们可以而且应该利用这种有点加快分而治之算法的速度。

由于主要的计算量集中在计算 Q ，即算法的最后一步的矩阵的乘积。如果 $u_i = 0$ ，则 d_i 为特征值，其对应的特征向量 e_i ，即 \hat{Q} 的第 i 列为 e_i ，故计算 Q 的第 i 列时不需要做任何的计算。

当 $d_i = d_{i+1}$ 时，也存在一个类似的简化。

(2) 特征方程求解

通常我们可以使用牛顿法来计算特征方程 $f(\lambda) = 0$ 的解。当 $d_i \neq d_{i+1}$ 且 $u_i \neq 0$ 时，用牛顿法计算 $f(\lambda)$ 在 (d_{i+1}, d_i) 中的零点 λ_i 。如果 $|u_i|$ 小于给定的阈值时，我们可直接将 d_i 作为特征值 λ_i 的一个近似。但当 u_i 很小（却大于给定的阈值）时，此时 $f(\lambda)$ 在区间 $[d_{i+1}, d_i]$ 中的大部分处的斜率几乎为 0（见下图）。这是，如果任取 $[d_{i+1}, d_i]$ 中的一个点作为迭代初始点，经过一次牛顿迭代后，迭代解可能会跑到区间 $[d_{i+1}, d_i]$ 的外面，造成不收敛。

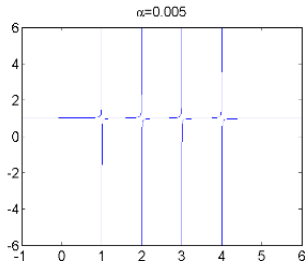


Figure: $f(\lambda) = 1 + 0.005\left(\frac{1}{4-\lambda} + \frac{1}{3-\lambda} + \frac{1}{2-\lambda} + \frac{1}{1-\lambda}\right)$ 的图像

这时需要采用修正的牛顿法。假设我们已经计算出 λ_i 的一个近似 $\tilde{\lambda}$ ，下面我们需要从 $\tilde{\lambda}$ 出发，利用牛顿迭代计算下一个近似，直至收敛。我们知道牛顿法的基本原理是使用 $f(\lambda)$ 在点 $\tilde{\lambda}$ 的切线来近似 $f(\lambda)$ ，并将切线的零点作为下一个近似，即用直线来近似曲线 $f(\lambda)$ 。

当 u_i 很小时，这种近似方法会出现问题，此时不能使用直线来近似 $f(\lambda)$ 。这时我们可以寻找其他简单函数 $h(\lambda)$ 来近似 $f(\lambda)$ ，然后用 $h(\lambda)$ 的零点作为 $f(\lambda)$ 零点的近似，并不断迭代下去，直至收敛。

当然， $h(\lambda)$ 需要满足一定的要求：

- ① 必须容易构造；
- ② 其零点容易计算；
- ③ 尽可能与 $f(\lambda)$ 相近。

下面给出构造 $h(\lambda)$ 的一种方法。

因为 d_i 和 d_{i+1} 是 $f(\lambda)$ 的奇点, 所以我们令

$$h(\lambda) = \frac{c_1}{d_i - \lambda} + \frac{c_2}{d_{i+1} - \lambda} + c_3$$

其中 c_1, c_2, c_3 为参数。显然, $h(\lambda)$ 的零点很容易计算 (与 Newton 法相差无几)。在选取这些参数时, 要使得 $h(\lambda)$ 在 $\tilde{\lambda}$ 附近尽可能地接近 $f(\lambda)$ 。记

$$\begin{aligned} f(\lambda) &= 1 + \alpha \sum_{k=1}^n \frac{u_k^2}{d_k - \lambda} = 1 + \alpha \left(\sum_{k=1}^i \frac{u_k^2}{d_k - \lambda} + 1 + \alpha \sum_{k=i+1}^n \frac{u_k^2}{d_k - \lambda} \right) \\ &\triangleq 1 + \alpha (\Psi_1(\lambda) + \Psi_2(\lambda)) \end{aligned}$$

当 $\lambda \in (d_{i+1}, d_i)$ 时, $\Psi_1(\lambda)$ 为正项和, $\Psi_2(\lambda)$ 为负项的和, 因此它们都可以较精确地计算。但如果把它们加在一起时可能会引起对消, 从而失去相对精度。因此我们也将 $h(\lambda)$ 写成

$$h(\lambda) = 1 + \alpha(h_1(\lambda) + h_2(\lambda))$$

其中

$$h_1(\lambda) = \frac{c_1}{d_i - \lambda} + \hat{c}_1, \quad h_2(\lambda) = \frac{c_2}{d_{i+1} - \lambda} + \hat{c}_2$$

满足

$$h_1(\tilde{\lambda}) = \Psi_1(\tilde{\lambda}), \quad h'_1(\tilde{\lambda}) = \Psi'_1(\tilde{\lambda})$$

$$h_2(\tilde{\lambda}) = \Psi_2(\tilde{\lambda}), \quad h'_2(\tilde{\lambda}) = \Psi'_2(\tilde{\lambda})$$

即 $h_1(\lambda)$ 和 $h_2(\lambda)$ 分别在点 $\tilde{\lambda}$ 与 $\Psi_1(\lambda)$ 和 $\Psi_2(\lambda)$ 相切。这在数值插值中是常见的条件。容易计算可得

$$\begin{cases} c_1 = \Psi'_1(\tilde{\lambda}) (d_i - \tilde{\lambda})^2, & \hat{c}_1 = \Psi_1(\tilde{\lambda}) - \Psi'_1(\tilde{\lambda}) (d_i - \tilde{\lambda}) \\ c_2 = \Psi'_2(\tilde{\lambda}) (d_{i+1} - \tilde{\lambda})^2, & \hat{c}_2 = \Psi_2(\tilde{\lambda}) - \Psi'_2(\tilde{\lambda}) (d_{i+1} - \tilde{\lambda}) \end{cases} \quad (2)$$

所以, 最后取

$$h(\lambda) = 1 + \alpha (\hat{c}_1 + \hat{c}_2) + \alpha \left(\frac{c_1}{d_i - \lambda} + \frac{c_2}{d_{i+1} - \lambda} \right) \quad (3)$$

这就是迭代函数。

算法 4.2 修正的 Newton 算法

- 1: set $k = 0$
- 2: choose an initial guess $\lambda_0 \in [d_{i+1}, d_i]$
- 3: while not convergence do
- 4: let $\tilde{\lambda} = \lambda_k$ and compute $c_1, c_2, \hat{c}_1, \hat{c}_2$ from 2
- 5: set $k = k + 1$
- 6: compute the solution λ_k of $h(\lambda)$ defined by 3
- 7: end while

(3) 计算特征向量的稳定算法

设 λ_i 是 $D + \alpha uu^T$ 的特征值, 则根据引理 4.2, 可利用公式 $(D - \lambda_i I)^{-1} u$ 来计算其对应的特征向量。但遗憾的是, 当相邻的两个特征值非常接近时, 这个公式可能不稳定。即当 λ_i 与 λ_{i+1} 非常接近时, 他们都靠近 d_{i+1} (这里假定 $\lambda_i \in (d_{i+1}, d_i)$), 在计算 $d_{i+1} - \lambda_i$ 和 $d_{i+1} - \lambda_{i+1}$ 时会存在对消, 这就可能损失有效数字, 产生较大的相对误差, 从而导致 $(D - \lambda_i I)^{-1} u$ 与 $(D - \lambda_{i+1} I)^{-1} u$ 的计算时不准确的, 正交性也会失去。下面的定理可以解决这个问题。

定理 (Löwner) 设对角阵 $D = \text{diag}(d_1, d_2, \dots, d_n)$ 满足 $d_1 > d_2 > \dots > d_n$, 若矩阵 $\hat{D} = D + \hat{u}\hat{u}^\top$ 的特征值 $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n$ 满足交错性质

$$\lambda_1 > d_1 > \lambda_2 > d_2 > \dots > \lambda_n > d_n \quad (4)$$

则向量 \hat{u} 的分量满足

$$|\hat{u}_i| = \left(\frac{\prod_{k=1}^n (\lambda_k - d_i)}{\prod_{k=1, k \neq i}^n (d_k - d_i)} \right)^{1/2} \quad (5)$$

因此, 我们可以采用公式5来计算特征向量。这样就尽可能的避免了出现分母很小的情形。

箭型分而治之法

分而治之算法于 1981 年被首次提出,但直到 1995 年才由 Gu 和 Eisenstat 给出了一种快速稳定的实现方式,称为箭型分而治之法 (Arrowhead Divide-and-Conquer, ADC). 他们做了大量的数值试验,在试验中,当矩阵规模不超过 6 时,就采用对称 QR 迭代来计算特征值和特征向量。在对特征方程求解时,他们采用的是修正的有理逼近法。数值结果表明,ADC 算法的计算精度可以与其他算法媲美,而计算速度通常比对称 QR 迭代快 5 至 10 倍,比 Cuppen 的分而治之法快 2 倍。详细介绍参见相关文献。

第五讲 对称矩阵的特征值问题

- 1 Jacobi 迭代
- 2 Raylaogh 商迭代
- 3 对称 QR 迭代
- 4 分而治之法
- 5 对分法和逆迭代
- 6 奇异值分解
- 7 扰动分析

5 对分法和迭代

对分法的基本思想是利用惯性定理来计算所需的部分特征值。

定义 设 A 为对称矩阵，则其惯性定义为

$$(A) = (\nu, \zeta, \pi)$$

其中 ν, ζ, π 分别表示 A 的负特征值，零特征值和正特征值的个数。

定理 (Sylvester 惯性定理) 设 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 是对称矩阵， $X \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 非奇异，则 $X^T A X$ 与 A 有相同的惯性。

利用 LU 分解可得 $A - zI = LDL^T$, 其中 L 为奇异下三角矩阵, D 为对角阵, 则

$$(A - zI) = \text{Inertia}(D)$$

由于 D 为对角矩阵, 所以 $\text{Inertia}(D)$ 很容易计算。

设 $\alpha \in \mathbb{R}^n$, 记 $\text{Negcount}(A, \alpha)$ 为小于 α 的 A 的特征值的个数, 即

$$\text{Negcount}(A, \alpha) = \#(\lambda(A) < \alpha)$$

设 $\alpha_1 < \alpha_2$, 则 A 在区间 $[\alpha_1, \alpha_2)$ 中的特征值个数为

$$(A, \alpha_2) - \text{Negcount}(A, \alpha_1)$$

。

如果 $\alpha_2 - \alpha_1 < \text{tol}$ (其中 $\text{tol} \ll 1$ 为事先给定的阈值), 且 A 在 $[\alpha_1, \alpha_2)$ 中有特征值, 则我们可将 $[\alpha_1, \alpha_2)$ 中的任意一个值作为 A 在该区间中的特征值的近似。

由此我们可以给出下面的对分法。

算法 5.1 计算 A 在 $[a, b)$ 中的所有特征值

- 1: Let tol be a given threshold
- 2: compute $n_a = \text{Negcount}(A, a)$
- 3: compute $n_b = \text{Negcount}(A, b)$
- 4: if $n_a = n_b$ then
- 5: return % 此时 $[a, b)$ 中没有 A 的特征值
- 6: end if
- 7: put (a, n_a, b, n_b) onto worklist
- 8: % worklist 中的元素时 “四元素对，即由四个数组成的数对
- 9: while worklist not empty do
- 10: remove $(low, n_{low}, up, n_{up})$ from the worklist
- 11: % $(low, n_{low}, up, n_{up})$ 是 worklist 中的任意一个元素
- 12: if $(up - low) < tol$ then
- 13: print " There are $n_{up} - n_{low}$ eigenvalues in $[low, up)$ "
- 14: else
- 15: compute $mid = (low + up)/2$

16: $\text{computen}_{\text{mid}} = \text{Negcount}(A, \text{mid})$

17: if ($n_{\text{mid}} > n_{\text{low}}$) then

18: put ($\text{low}, n_{\text{low}}, \text{mid}, n_{\text{mid}}$) onto worklist

19: end if

20: if ($n_{\text{up}} > n_{\text{mid}}$) then

21: ($\text{mid}, n_{\text{mid}}, \text{up}, n_{\text{up}}$) onto worklist

22: end if

23: end if

24: end while

对分法的主要运算量集中在计算 $\text{Negcount}(A, z)$ 。通常是事先将 A 转化成对称三对角矩阵，这样计算 $A - zI$ 的 LDL^T 分解就非常简单：

$$\begin{aligned}
 A - zI &= \begin{bmatrix} a_1 - z & b_1 & & \\ & b_1 & \ddots & \\ & & \ddots & \ddots & b_{n-1} \\ & & & b_{n-1} & a_n - z \end{bmatrix} \\
 &= \begin{bmatrix} 1 & & & \\ l_1 & \ddots & & \\ & \ddots & \ddots & \\ & & l_{n-1} & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} d_1 & & & \\ & \ddots & & \\ & & \ddots & \\ & & & d_n \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & l_1 & & \\ & \ddots & \ddots & \\ & & \ddots & l_{n-1} \\ & & & 1 \end{bmatrix} \triangleq
 \end{aligned}$$

利用待定系数法，可以得到下面的递推公式

$$d_1 = a_1 - z, \quad d_i = (a_i - z) - \frac{b_{i-1}^2}{d_{i-1}}, \quad i = 2, 3, \dots, n \quad (6)$$

用上面的公式计算 d_i 的运算量约为 $4n$ 。

注意这里没有选主元，但针对对称三对角矩阵，该算法是非常稳定的，即使当 d_i 有可能很小时，算法依然很稳定。

定理 [Demmel ' 97] 利用公式6计算所得的 d_i 与精确计算 \hat{A} 的 \hat{d}_i 有相同的符号，故有相同的惯性。这里 \hat{A} 与 A 非常接近，即

$$\hat{A}(i, i) = a_i, \quad \hat{A}(i, i+1) = b_i (1 + \varepsilon_i)$$

其中， $|\varepsilon_i| \leq 2.5\varepsilon + O(\varepsilon^2)$ ，这里 ε 为机器精度。

- 由于单独调用一次 Negcount 的运算量为 $4n$, 故计算 k 个特征值的总运算量约为 $O(kn)$;
- 当特征值计算出来后, 我们可以使用带位移的逆迭代来计算对应的特征向量。通常只需迭代 1 至 2 次即可, 由于 A 是三对角矩阵, 故计算每个特征向量的运算量为 $O(n)$;
- 当特征值紧靠在一起时, 计算出来的特征向量可能会失去正交性, 此时需要进行再正交化, 可通过 MGS 的 QR 分解来实现。

第五讲 对称矩阵的特征值问题

- 1 Jacobi 迭代
- 2 Raylaogh 商迭代
- 3 对称 QR 迭代
- 4 分而治之法
- 5 对分法和逆迭代
- 6 奇异值分解**
- 7 扰动分析

奇异值分解 (SVD) 具有十分广泛的应用背景, 因此, 如何更好更快地计算一个给定矩阵的 SVD 是科学与工程计算领域中的一个热门研究课题, 吸引了众多专家进行这方面的研究, 也涌现出了许多奇妙的方法. 本章主要介绍计算 SVD 的常用算法。

对任意矩阵 $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$, 其奇异值与对称矩阵 $A^T A$, AA^T 和 $\begin{bmatrix} 0 & A^T \\ A & 0 \end{bmatrix}$ 的特征值是密切相关的, 故理论上计算对称特征值的算法都可以用于计算奇异值。但在实际计算中, 我们通常可以利用 SVD 的特殊结构使得算法更加有效和准确。

与计算对称矩阵的特征值累死, 计算一个矩阵 A 的奇异值分解的算法通常分为以下几个步骤 (Jacobi 算法除外):

1. 将 A 二对角化: $B = U_1^T A V_1$, 其中 B 为上二对角矩阵, U_1, V_1 为正交阵;
2. 计算 B 的 SVD: $B = U_2 \Sigma V_2^T$, 其中 Σ 为对角阵, U_2, V_2 为正交阵;
3. 合并得到 A 的 SVD: $A = U_1 B V_1^T = (U_1 U_2) B (V_1 V_2)^T$ 。

6.1 二对角化

我们知道。对称矩阵可以通过一系列 Householder 变换转化为对称三对角矩阵。对于一般矩阵 $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$, 我们也可以通过 Householder 变换, 将其转化为反对角矩阵, 即计算正交矩阵 U_1 和 V_1 使得

$$U_1^T A V_1 = B \quad (7)$$

其中 B 是一个实 (上) 二对角矩阵。这个过程就称为**二对角化**。
需要注意的是, 与对称矩阵的对称三对角化不同, A 与 B 是不相似的。

设 $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$, 二对角化过程大致如下:

- 首先确定一个 Household 矩阵 $H_1 \in \mathbb{R}^{m \times n}$, 使得 $H_1 A$ 的第一节除第一个元素外, 其他分量都为零, 即

$$H_1 A = \begin{bmatrix} * & * & * & * & * \\ 0 & * & * & \cdots & * \\ 0 & * & * & \cdots & * \\ 0 & * & * & \cdots & * \\ \vdots & \vdots & \vdots & & \vdots \\ 0 & * & * & \cdots & * \end{bmatrix}$$

- 再确定一个 Househould 矩阵 $\tilde{H}_1 \in \mathbb{R}^{(n-1) \times (n-1)}$, 把 $H_1 A$ 的第一行的第 3 至第 n 个元素化为零, 即

$$H_1 A \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & \tilde{H}_1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} * & * & 0 & \cdots & 0 \\ 0 & * & \cdots & * & \\ 0 & * & \cdots & * & \\ 0 & * & \cdots & * & \\ \vdots & \vdots & & \vdots & \\ 0 & * & \cdots & * & \end{bmatrix}$$

- 重复上面的过程, 直到把 A 最终化为而对角矩阵。

有了分解7以后，我们可得

$$A^T A = (U_1 B V_1^T)^T U_1 B V_1^T = V_1 B^T B V_1^T$$

即 $V_1^T A^T A V_1 = B^T B$ 。由于 $B^T B$ 是对称三对角的，所以这就相当于将 $A^T A$ 三对角化。

整个二对角化过程的运算量约为 $4mn^2 + 4m^2n - 4n^3/3$ 。若不需要计算 U_1 和 V_1 ，则运算量约为 $4mn^2 - 4n^3/3$ 。

二对角矩阵的奇异值分解

设 $B \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 是一个二对角矩阵 $B = \begin{bmatrix} a_1 & b_1 & & \\ & \ddots & \ddots & \\ & & \ddots & \\ & & & b_{n-1} & a_n \end{bmatrix}$, 则下面三

种方法均可将计算 B 的 SVD 转化成计算对称三对角矩阵的特征分解：● 令

$A = \begin{bmatrix} 0 & B^T \\ B & 0 \end{bmatrix}$, 置换阵 $P = [e_1, e_{n+1}, e_2, e_{n+2}, \dots, e_n, e_{2n}]$, 则

$T_{ps} = P^T A P$ 是对称三对角矩阵, 且 T_{ps} 的主对角线元素全为 0, 次对角线元素为 $a_1, b_1, a_2, b_2, \dots, a_{n-1}, b_{n-1}, a_n$ 。若 (λ_i, x_i) 是 T_{ps} 的一个特征对, 则

$$\lambda_i = \pm \sigma_i, \quad P x_i = \frac{1}{\sqrt{2}} \begin{bmatrix} v_i \\ \pm u_i \end{bmatrix}$$

, 其中 σ_i 为 B 一个奇异值, u_i 和 v_i 分别为对应的左和右奇异向量。

- 令 $T_{BB^T} = BB'$, 则

$$T_{BB^T} = \begin{bmatrix} a_1^2 + b_1^2 a_2 b_1 & & & \\ a_2 b_1 & \ddots & & \\ & \ddots & a_{n-1}^2 + b_{n-1}^2 a_n b_{n-1} & \\ & & a_n b_{n-1} & a_n^2 \end{bmatrix}$$

T_{BB^T} 的特征值为 B 的奇异值的平方, 且 T_{BB^T} 的特征向量为 B 的左奇异向量。

- 令 $T_{BB^T} = BB'$, 则

$$T_{B^TB} = \begin{bmatrix} a_1^2 & a_1b_1 & & \\ a_1b_1 & a_2^2 + b_1^2 & \ddots & \\ & \ddots & \ddots & a_{n-1}b_{n-1} \\ & & a_{n-1}b_{n-1} & a_n^2 + b_{n-1}^2 \end{bmatrix}$$

T_{B^TB} 的特征值为 B 的奇异值的平方, 且 T_{B^TB} 的特征向量为 B 的右奇异向量。

理论上，我们可以直接使用 QR 迭代、分而治之法或带反迭代的对分法，计算三对角矩阵的 T_{ps} , T_{BB^T} 和 T_{B^TB} 的特征值和特征向量。但一般来说，这种做法并不是最佳的，原因如下：

- ① 对 T_{ps} 做 QR 迭代并不划算，因为 QR 迭代计算所有的特征值和特征向量，而事实上只要计算正的特征值即可；
- ② 直接构成 T_{BB^T} 或 T_{B^TB} 是数值不稳定的。事实上，这样做可能会使得 B 的小奇异值的精度丢失一半。

下面是一些奇异值分解的比较实用的算法。

1. **Golub-Kahan SVD 算法**: 由 Golub 和 Kahan 于 1965 年提出, 是一种十分稳定且高效的计算 SVD 的算法。主要思想是将带位移的对称 QR 迭代算法隐式地用到 $B^T B$ 上, 在该算法中, 并不需要显示地把 $B^T B$ 计算出来。该算法也通常就称为 SVD 算法, 是一个基本且实用的算法, 目前仍然是计算小规模矩阵奇异值分解的常用算法。
2. **dqds 算法**: 由 Fernando 和 Parlett 于 1994 年提出, 是计算二对角矩阵所有奇异值的最快算法, 而且能达到很高的相对精度, 包括奇异值很小的情形。该算法主要基于对 $B^T B$ 的 Cholesky 迭代, 可以看作是 LR 迭代算法的改进。由于 LR 迭代算法在一定条件下与对称 QR 算法是等价的, 因此该算法也可以看作是 QR 迭代的变形。
3. **分而治之法**: 该算法是计算维数 $n \geq 25$ 的矩阵的所有奇异值和奇异向量的最快算法, 但不能保证小奇异值的相对精度, 即 σ_i 的相对精度为 $O(\varepsilon)\sigma_1$, 而不是 $O(\varepsilon)\sigma_i$ 。
4. **对分法和反迭代**: 主要用于计算某个区间内的奇异值及对应的奇异向量, 能保证较高的相对精度。
5. **Jacobi 迭代**: 可隐式地对 AA^T 或 $A^T A$ 实施对称 Jacobi 迭代, 能保证较高的相对精度。最近, Z.Drmac 和 K.Veselić 改进了最初的 Jacobi 算法, 使其变成一个速度快、精度高的实用算法。

在这里，我们简要介绍 Golub-Kahan SVD 算法, dqds 算法和 Jacobi 迭代。

6.2 Golub-Kahan SVD 算法

该算法主要思想是将带位移的对称 QR 迭代算法隐式地用到 $B^T B$ 上，而无需将 $B^T B$ 显示的计算出来。

算法基本框架

Golub-Kahan SVD 算法有时也简称 SVD 算法，其基本框架是：

- 将矩阵 A 二对角化，得到上二对角矩阵 B ；
- 用隐式 QR 迭代计算 $B^T B$ 的特征值分解，即

$$B^T B = Q \Lambda Q^T, \quad \Lambda = \text{diag}(\sigma_1^2, \sigma_2^2, \dots, \sigma_n^2) \quad (8)$$

- 计算 BQ 的列主元 QR 分解，即

$$(BQ)P = UR \quad (9)$$

其中 P 是置换矩阵， U 是正交矩阵， R 是上三角矩阵。

由8可知

$$(BQ)^T BQ = \Lambda$$

因此 BQ 是列正交矩阵 (但不是单位列正交)。再由9可知 $R = U^T(BQ)P$ 也是列正交矩阵。又 R 是上三角矩阵, 所以 R 必定是对角矩阵。令 $V = QP$, 则由9可知

$$U^T B V = R$$

这就是二对角矩阵 B 的奇异值分解。

算法的具体实现参见[相关文献](#)

我们首先介绍针对实对称正定矩阵的 LR 算法, 该算法思想与 QR 迭代算法类似, 但提出时间更早。

算法 6.1 带位移的 LR 算法

- 1: Let T_0 be a given real symmetric positive definite matrix
- 2: set $i = 0$
- 3: while not converge do
- 4: choose a shift τ_i^2 satisfying $\tau_i^2 < \min \{\lambda(T_i)\}$
- 5: compute B_i such that $T_i - \tau_i^2 I = B_i^\top B_i$ %Cholesky factorization
- 6: $T_{i+1} = B_i B_i^\top + \tau_i^2 I$
- 7: $i = i + 1$
- 8: end while

LR 迭代算法在形式上与 QR 迭代算法非常类似。事实上，对于不带位移的 LR 迭代算法，我可以证明，两步 LR 迭代等价于一步 QR 迭代。

引理 设 \tilde{T} 是不带位移的 LR 算法迭代两步后生成的矩阵， \hat{T} 是不带唯一的 QR 算法迭代一步后生成的矩阵，则 $\tilde{T} = \hat{T}$ 。

- ① LR 算法中要求 T_0 对称正定，但并不一定是三对角矩阵；
- ② 由该引理可知，QR 算法与 LR 算法有相同的收敛性。

该算法是针对三对角的对称正定矩阵 B^TB , 其中 B 是反对角矩阵。在数学上, dqds 算法与 LR 算法是等价的, 但在该算法中, 我们是直接通过 B_i 来计算 B_{i+1} , 从而避免计算中间矩阵 T_{i+1} , 这样也就尽可能的避免了由于计算 $B_i B_i^T$ 而可能带来的数值不稳定性。

下面推导如何从 B_i 直接计算 B_{i+1} 。设

$$B_i = \begin{bmatrix} a_1 & b_1 & & & \\ & a_2 & \ddots & & \\ & & \ddots & b_{n-1} & \\ & & & a_n & \\ & & & & \end{bmatrix}, \quad B_{i+1} = \begin{bmatrix} \tilde{a}_1 \tilde{b}_1 & & & & \\ \tilde{a}_2 & \ddots & & & \\ & \ddots & \tilde{b}_{n-1} & & \\ \tilde{a}_n & & & & \end{bmatrix}$$

为了书写方便, 我们记 $b_0 = b_n = \tilde{b}_0 = \tilde{b}_n = 0$ 。由 LR 算法 6.1 可知

$$B_{i+1}^T B_{i+1} + \tau_{i+1}^2 I = B_i B_i^T + \tau_i^2 I$$

比较等式两边矩阵的对角线和上对角线元素，可得

$$\tilde{a}_k^2 + \tilde{b}_{k-1}^2 + \tau_{i+1}^2 = a_k^2 + b_k^2 + \tau_i^2, \quad k = 1, 2, \dots, n$$

$$\tilde{a}_k \tilde{b}_k = a_{k+1} b_k \quad \text{或} \quad \tilde{a}_k^2 \tilde{b}_k^2 = a_{k+1}^2 b_k^2, \quad k = 1, 2, \dots, n-1$$

记 $\delta = \tau_{i+1}^2 - \tau_i^2$, $p_k = a_k^2$, $q_k = b_k^2$, $\tilde{p}_k = \tilde{a}_k^2$, $\tilde{q}_k = \tilde{b}_k^2$, 则可得 qds 算法：

算法 6.2 qds 算法的单步 ($B_i \rightarrow B_{i+1}$)

- ①: $\delta = \tau_{i+1}^2 - \tau_i^2$
- ②: for $k = 1$ to $n - 1$ do
- ③: $\tilde{p}_k = p_k + q_k - \tilde{q}_{k-1} - \delta$
- ④: $\tilde{q}_k = q_k \cdot (p_{k+1} / \tilde{p}_k)$
- ⑤: end for
- ⑥: $\tilde{p}_n = p_n - \tilde{q}_{n-1} - \delta$

qds 算法中的每个循环仅需 5 个浮点运算, 所以运算量较少。

为了体验算法的精确性, 我们引入一个辅助变量 $d_k \triangleq p_k - \tilde{q}_{k-1} - \delta$, 则

$$\begin{aligned}d_k &= p_k - \tilde{q}_{k-1} - \delta \\&= p_k - \frac{q_{k-1} p_k}{\tilde{p}_{k-1}} - \delta \\&= p_k \cdot \frac{\tilde{p}_{k-1} - q_{k-1}}{\tilde{p}_{k-1}} - \delta \\&= p_k \cdot \frac{p_{k-1} - \tilde{q}_{k-2} - \delta}{\tilde{p}_{k-1}} - \delta \\&= \frac{p_k}{\tilde{p}_{k-1}} \cdot d_{k-1} - \delta\end{aligned}$$

于是就可得到 dqds 算法。

算法 6.3 dqds 算法的单步 ($B_i \rightarrow B_{i+1}$)

- ①: $\delta = \tau_{i+1}^2 - \tau_i^2$
- ②: $d_1 = p_1 - \delta$
- ③: for $k = 1$ to $n - 1$ do
- ④: $\tilde{p}_k = d_k + q_k$
- ⑤: $t = p_{k+1} / \tilde{p}_k$
- ⑥: $\tilde{q}_j = q_k \cdot t$
- ⑦: $d_{k+1} = d_k \cdot t - \delta$
- ⑧: end for
- ⑨: $\tilde{p}_n = d_n$

dqds 算法的运算量与 dqs 差不多，但更精确。

下面的定理显示了 dqds 算法的高精度性质。

定理 以浮点运算对 B 做单步 dqds 迭代，得到矩阵 \tilde{B} ，该过程等价于

1. 对 B 的每个元素座椅而小德相对扰动（不超过 1.5ε ），得到 \tilde{B} ；
2. 对 \tilde{B} 应用精确的 dqds 算法的单步，得到 \bar{B} ；
3. 对 \bar{B} 的每个元素做一个小的相对扰动（不超过 ε ），得到 \tilde{B} 。

因此， B 和 \tilde{B} 的奇异值满足高的相对精度。

关于 dqds 算法中位移的选取，以及如何判断收敛性，可以参见相关文献。

6.4 Jacobi 算法

本节讨论对矩阵 $M = A^T A$ 实施隐式的 Jacobi 算法来计算 A 的奇异值。我们知道, Jacobi 算法的每一步就是对矩阵作 Jacobi 旋转, 即 $A^T A \rightarrow J^T A^T A J$, 其中 J 的选取将两个非对角元化为 0。在实际计算中, 我们只需计算 AJ , 故该算法称为**单边 Jacobi 旋转**。

算法 6.4 单边 Jacobi 旋转的单步

% 对 $M = A^T A$ 作 Jacobi 旋转, 将 $M(i,j), M(j,i)$ 化为 0

- 1: Compute $m_{ii} = (A^T A)_{ii}$, $m_{ij} = (A^T A)_{ij}$, $m_{jj} = (A^T A)_{jj}$
- 2: if m_{ij} is not small enough then
- 3: $\tau = (m_{ii} - m_{jj}) / (2 \cdot m_{ij})$
- 4: $t = \text{sign}(\tau) / (|\tau| + \sqrt{1 + \tau^2})$
- 5: $c = 1 / \sqrt{1 + t^2}$
- 6: $s = c \cdot t$
- 7: $A = AG(i, j, \theta)$ % $G(i, j, \theta)$ 为 Givens 变换
- 8: if eigenvectors are desired then
- 9: $J = J \cdot G(i, j, \theta)$
- 10: end if
- 11: end if

在上面算法的基础上，我们可以给出完整的单边 Jacobi 算法。blue算法

6.5 单边 Jacobi 算法：计算 $A = U \Sigma V^T$

- 1: while $A^T A$ is not diagonal enough do
- 2: for $i = 1$ to $n - 1$ do
- 3: for $j = i + 1$ to n do
- 4: 调用单边 Jacobi 旋转
- 5: end for
- 6: end for
- 7: end while
- 8: compute $\sigma_i = \|A(:, i)\|_2, i = 1, 2, \dots, n$
- 9: $U = [u_1, \dots, u_n]$ with $u_i = A(:, i) / \sigma_i$
- 10: $V = J$

Jacobi 算法的特点

- 不需要双对角化，这样可以避免双对角化引入的误差；
- 可以达到相对较高的计算精度；
- 速度较慢。（目前已有快速的改进算法）

定理 设 $A = DX \in \mathbb{R}^{n \times n}$ ，其中 D 为非奇异对角阵， X 非奇异。设 \hat{A} 是按浮点运算单边 Jacobi 旋转 m 次后所得到的矩阵。若 A 和 \hat{A} 的奇异值分别为 $\sigma_1 \geq \sigma_2 \geq \dots \geq \sigma_n$ 和 $\hat{\sigma}_1 \geq \hat{\sigma}_2 \geq \dots \geq \hat{\sigma}_n$ ，则

$$\frac{|\hat{\sigma}_i - \sigma_i|}{\sigma_i} \leq O(m\varepsilon)\kappa(X)$$

故 X 的条件数越小，计算矩阵 A 的奇异值时相对误差越小。

第五讲 对称矩阵的特征值问题

- 1 Jacobi 迭代
- 2 Raylaogh 商迭代
- 3 对称 QR 迭代
- 4 分而治之法
- 5 对分法和逆迭代
- 6 奇异值分解
- 7 扰动分析

设 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 是对称矩阵, 则存在一个正交矩阵 Q 使得

$$A = Q\Lambda Q^T$$

其中 $\Lambda = \text{diag}(\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n)$ 是一个实对角矩阵。

这里的 λ_i 就是 A 的特征值, 我们假设 $\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \dots \geq \lambda_n$ 。令

$Q = [q_1, q_2, \dots, q_n]$, 则 q_i 就是 λ_i 对应的单位正交特征向量。

关于对称矩阵特征值问题的扰动理论, 这里只做一些简单介绍, 若要深入了解这方面的信息, 可以参考相关文献。

7.1 特征值与 Rayleigh 商

定义 设 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 是对称矩阵, 向量 $x \in \mathbb{R}^n$ 非零, 则 x 关于 A 的 Rayleigh 商定义为:

$$\rho(x, A) = \frac{x^T A x}{x^T x}$$

有时简记为 $\rho(x)$ 。

下面是关于 Rayleigh 商的一些基本性质:

- ① $\rho(\alpha x) = \rho(x), \forall \alpha \in \mathbb{R}, \alpha \neq 0$;
- ② $\rho(q_i) = \lambda_i, i = 1, 2, \dots, n$;
- ③ 设 $x = \alpha_1 q_1 + \alpha_2 q_2 + \dots + \alpha_n q_n$, 则

$$\rho(x) = \frac{\alpha_1^2 \lambda_1 + \alpha_2^2 \lambda_2 + \dots + \alpha_n^2 \lambda_n}{\alpha_1^2 + \alpha_2^2 + \dots + \alpha_n^2}$$

;

- ④ $\lambda_n \leq \rho(x) \leq \lambda_1, |\rho(x)| \leq \|A\|_2$ 。

Courant-Fischer 极小极大定理

实对称矩阵的特征值与 Rayleigh 商之间的一个基本性质是 Courant-Fischer 极小极大定理。

定理 (Courant-Fischer) 设 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 是对称矩阵, 其特征值为 $\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \cdots \geq \lambda_n$, 则有

$$\lambda_k = \max_{U \in \mathbb{S}_k^n} \min_{x \in U, x \neq 0} \frac{x^T A x}{x^T x} = \min_{V \in \mathbb{S}_{n-k+1}^n} \max_{x \in V, x \neq 0} \frac{x^T A x}{x^T x}$$

其中 \mathbb{S}_i^n 表示 \mathbb{R}^n 中所欲 i 维子空间构成的集合, 当

$$U = \text{span}\{q_1, \dots, q_k\}, \quad V = \text{span}\{q_k, \dots, q_n\}, \quad x = q_k$$

时, 上式中的等号成立。

Rayleigh-Ritz 定理

当 $k = 1$ 和 $k = n$ 时, 就可以得到下面的定理.

定理 (Rayleigh-Ritz) 设 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 是对称矩阵, 其特征值为 $\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \cdots \geq \lambda_n$, 则有

$$\lambda_1 = \max_{x \in \mathbb{R}^n, x \neq 0} \frac{x^T A x}{x^T x}, \quad \lambda_n = \min_{x \in \mathbb{R}^n, x \neq 0} \frac{x^T A x}{x^T x}$$

特征值分割定理

由极大极小定理，我们可以得到下面的特征值分隔定理。

定理（分割定理） 设 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 是对称矩阵， $B = Q^T A Q$ ，其中 $Q \in \mathbb{R}^{n \times (n-1)}$ 满足 $Q^T Q = I_{n-1}$ 。再设 A 和 B 的特征值分别为

$$\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \cdots \geq \lambda_n \quad \text{和} \quad \tilde{\lambda}_1 \geq \tilde{\lambda}_2 \geq \cdots \geq \tilde{\lambda}_{n-1}$$

则有

$$\lambda_1 \geq \tilde{\lambda}_1 \geq \lambda_2 \geq \tilde{\lambda}_2 \cdots \geq \tilde{\lambda}_{n-1} \geq \lambda_n$$

特别地, 在上述定理中, 取 $Q = [e_1, \dots, e_{i-1}, e_{i+1}, \dots, e_n]$, 则可以得到下面的结论。

推论 设 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 是对称矩阵, \tilde{A} 是 A 的一个 $n-1$ 阶主子矩阵, A 和 \tilde{A} 的特征值分别为

$$\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \dots \geq \lambda_n \quad \text{和} \quad \tilde{\lambda}_1 \geq \tilde{\lambda}_2 \geq \dots \geq \tilde{\lambda}_{n-1}$$

则有

$$\lambda_1 \geq \tilde{\lambda}_1 \geq \lambda_2 \geq \tilde{\lambda}_2 \geq \dots \geq \tilde{\lambda}_{n-1} \geq \lambda_n$$

反复应用上面的推论，即可得到下面的结论。

推论 设 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 是对称矩阵， \tilde{A} 是 A 的一个 k 阶主子矩阵 ($1 \leq k \leq n-1$)， A 和 \tilde{A} 的特征值分别为

$$\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \cdots \geq \lambda_n \quad \text{和} \quad \tilde{\lambda}_1 \geq \tilde{\lambda}_2 \geq \cdots \geq \tilde{\lambda}_{n-1}$$

则有

$$\lambda_i \geq \tilde{\lambda}_i \geq \lambda_{n-k+i}, \quad i = 1, 2, \dots, k$$

对称矩阵特征值的扰动分析

设 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 是对称矩阵，扰动矩阵 $E \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 都是对火车呢就在，下面讨论 $A + E$ 的特征值与 A 的特征值之间的关系。

由极小极大定理，我们可以证明下面的性质。

定理 设 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 和 $B = A + E \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 都是对称矩阵，其特征值分别为

$$\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \cdots \geq \lambda_n \quad \text{和} \quad \tilde{\lambda}_1 \geq \tilde{\lambda}_2 \geq \cdots \geq \tilde{\lambda}_{n-1}$$

假定 E 的最大特征值和最小特征值分别为 μ_1 和 μ_n ，则有

$$\lambda_i + \mu_1 \geq \tilde{\lambda}_i \geq \lambda_i + \mu_n, \quad i = 1, 2, \dots, n$$

Weyl 定理

根据这个定理，我们可以得到下面的 Weyl 定理。

定理 (Weyl) 设 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 和 $B = A + E \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 都是对称矩阵，其特征值分别为 $\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \cdots \geq \lambda_n$ 和 $\tilde{\lambda}_1 \geq \tilde{\lambda}_2 \geq \cdots \geq \tilde{\lambda}_{n-1}$ ，则

$$|\tilde{\lambda}_j - \lambda_j| \leq \|E\|_2, \quad j = 1, 2, \dots, n$$

。

该定理的结论可以推广到奇异值情形。

我们首先给出下面的引理。

引理 设 $A \in \mathbb{R}^{m \times n} (m \geq n)$ 的奇异值分解为 $A = U \Sigma V$, 其中 $U = [u_1, \dots, u_n] \in \mathbb{R}^{m \times n}$ 为列正交矩阵, $V = [v_1, \dots, v_n] \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 为正交矩阵, $\Sigma = \text{diag}(\sigma_1, \dots, \sigma_n)$ 。将 U 扩展成 $n \times n$ 的正交矩阵 $[U, \tilde{U}] = [u_1, \dots, u_n, \tilde{u}_1, \dots, \tilde{u}_{m-n}]$, 令

$$H = \begin{bmatrix} 0 & A^T \\ A & 0 \end{bmatrix} \in \mathbb{R}^{(m+n) \times (m+n)}$$

则 H 对称, 且特征值为 $\pm\sigma_i$ 和 0 (其中 0 至少为 $m - n$ 重特征值), 对应的特征向量分别为 $\frac{\sqrt{2}}{2} \begin{bmatrix} v_i \\ \pm u_i \end{bmatrix}$, $i = 1, 2, \dots, n$, $\begin{bmatrix} 0 \\ \tilde{u}_j \end{bmatrix}$, $j = 1, 2, \dots, m - n$ 。

由上面的引理和 Weyl 定理立即可得

定理 设 $AB \in \mathbb{R}^{m \times n}$ ($m \geq n$), 他们的奇异值分解为 $\sigma_1 \geq \sigma_2 \geq \cdots \geq \sigma_n$ 和 $\tilde{\sigma}_1 \geq \tilde{\sigma}_2 \geq \cdots \geq \tilde{\sigma}_n$, 则

$$|\tilde{\sigma}_j - \sigma_j| \leq \|B - A\|_2, \quad j = 1, 2, \dots, n$$

7.3 对称矩阵特征向量的扰动

定义 设 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 的特征值为 $\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \cdots \geq \lambda_n$, 则 λ_i 与其余特征值之间的**间隙 (gap)** 定义为

$$\text{gap}(\lambda_i, A) = \min_{j \neq i} |\lambda_j - \lambda_i|$$

有时简记为 $\text{gap}(\lambda_i)$ 。

特征向量的没干系那个依赖于其对应的特征值得 gap , 一般来说, gap 越小, 特征向量越敏感。

例 设

$$A = \begin{bmatrix} 1+g & \\ & 1 \end{bmatrix}, \quad E = \begin{bmatrix} 0 & \\ \varepsilon & \\ & \varepsilon \end{bmatrix}, \quad (0 < \varepsilon < g)$$

则 A 的特征值为 $\lambda_1 = 1 + g, \lambda_2 = 1$, 对应的单位特征向量为 $q_1 = e_1, q_2 = e_2$ 。 $A + E$ 的特征值为 $\hat{\lambda}_{1,2} = 1 + (g \pm \sqrt{g^2 + 4\varepsilon^2})/2$, 对应的单位特征向量为

$$\begin{aligned} \hat{q}_1 &= \beta_1 \begin{bmatrix} 1 \\ \frac{\sqrt{1+4\varepsilon^2/g^2}-1}{2\varepsilon/g} \end{bmatrix} = \beta_1 \begin{bmatrix} 1 \\ \frac{\sqrt{(1+2\varepsilon^2/g^2)^2-4(\varepsilon/g)^4}-1}{2\varepsilon/g} \end{bmatrix} \\ &\approx \beta_1 \begin{bmatrix} 1 \\ \frac{(1+2\varepsilon^2/g^2)-1}{2\varepsilon/g} \end{bmatrix} \\ &= \frac{1}{\sqrt{1+\varepsilon^2/g^2}} \begin{bmatrix} 1 \\ \varepsilon/g \end{bmatrix} \end{aligned}$$

$$\hat{q}_2 = \beta_2 \cdot \begin{bmatrix} 1 \\ \frac{1}{2\varepsilon/g} \end{bmatrix} \approx \frac{1}{\sqrt{1 + \varepsilon^2/g^2}} \begin{bmatrix} -\varepsilon/g \\ 1 \end{bmatrix}$$

其中 β_1, β_2 为规范化因子。故特征向量的扰动约为 ε/g ，与特征值的间隙 $\text{gap}(\lambda_i, A) = g$ 成反比。

定理 设 $A = Q\Lambda Q^T$ 和 $A + E = \tilde{Q}\tilde{\Lambda}\tilde{Q}^T$ 分别为对称矩阵 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 和 $A + E \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 的特征值分解, 其中 $Q = [q_1, q_2, \dots, q_n]$ 和 $\tilde{Q} = [\tilde{q}_1, \tilde{q}_2, \dots, \tilde{q}_n]$ 均为正交矩阵, 且 \tilde{q}_i 为 q_i 对应的扰动特征向量。用 θ_i 表示 q_i 和 \tilde{q}_i 之间的锐角, 则当 $\text{gap}(\lambda_i, A) > 0$ 时

$$\frac{1}{2} \sin 2\theta_i \leq \frac{\|E\|_2}{\text{gap}(\lambda_i, A)}$$

类似的, 当 $\text{gap}(\tilde{\lambda}_i, A + E) > 0$ 时

$$\frac{1}{2} \sin 2\theta_i \leq \frac{\|E\|_2}{\text{gap}(\tilde{\lambda}_i, A + E)}$$

- 当 $\theta_i \ll 1$ 时, $\frac{1}{2} \sin 2\theta_i \approx \theta_i \approx \sin \theta_i$;
- 当 $\|E\|_2 \geq \frac{1}{2} \text{gap}(\lambda_i, A)$ 时, 定理中给出的上界就失去了实际意义 ;
- 在该定理中, 没有对特征值进行排序 ;
- 在实际计算中, 我们通常所知道的是 $\text{gap}(\tilde{\lambda}_i, A + E)$ 。

7.4 Rayleigh 商逼近

定理 设对称矩阵 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 的特征值为 $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n$.

① 若 $x \in \mathbb{R}^n$ 是单位向量, $\beta \in \mathbb{R}$, 则

$$\min_{1 \leq i \leq n} |\lambda_i - \beta| \leq \|Ax - \beta x\|_2 \quad (10)$$

② 给定非零向量 $x \in \mathbb{R}^n$, 当 $\beta = \rho(x)$ 时, $\|Ax - \beta x\|_2$ 达到最小, 即

$$\min_{\beta \in \mathbb{R}} \|Ax - \beta x\|_2 = \|Ax - \rho(x)x\|_2 \quad (11)$$

③ 令 $r = Ax - \rho(x)x$, 设 λ_i 是离 $\rho(x)$ 最近的特征值, $\text{gap}' = \min_{j \neq i} |\lambda_j - \rho(x)|$, θ 是 x 和 q_i 之间的锐角, 其中 q_i 是 λ_i 对应的单位特征向量, 则

$$\sin \theta \leq \frac{\|r\|_2}{\text{gap}'} \quad \text{H} \quad |\lambda_i - \rho(x)| \leq \frac{\|r\|_2^2}{\text{gap}'} \quad (12)$$

由10可知, 在幂迭代和反迭代中可以使用残量 $\|Ax - \tilde{\lambda}x\|_2 < \text{tol}$ 作为停机准则, 这里 $\tilde{\lambda}$ 是迭代过程中计算得到的近似特征值。等式11则解释了为什么用 Rayleigh 商来近似特征值。

不等式12表明 $|\lambda_i - \rho(x)|$ 的值与残量范数 $\|r\|_2$ 的平方成正比, 这个结论是 Rayleigh 商迭代局部三次收敛的基础。

7.5 相对扰动分析

这里主要讨论 A 和 X^TAX 的特征值和特征向量之间的扰动关系, 其中 X 非奇异且满足 $\|X^TX - I\|_2 = \varepsilon$ 。这是因为在计算特征向量时, 由于舍入误差的原因, 最后得到的正交矩阵 Q 会带有误差, 从而失去正交性。

定理 (相对 Weyl 定理) 设对称矩阵 A 和 X^TAX 的特征值分别为 $\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \cdots \geq \lambda_n$ 和 $\tilde{\lambda}_1 \geq \tilde{\lambda}_2 \geq \cdots \geq \tilde{\lambda}_n$, 令 $\varepsilon = \|X^TX - I\|_2$, 则

$$|\tilde{\lambda}_i - \lambda_i| \leq \varepsilon |\lambda_i| \text{ 或 } \frac{|\tilde{\lambda}_i - \lambda_i|}{|\lambda_i|} \leq \varepsilon \quad (\text{if } \lambda_i \neq 0)$$

当 X 正交时, $\varepsilon = 0$, 故 X^TAX 与 A 有相同的特征值。当 X 几乎正交时, ε 很小, 此时 X^TAX 与 A 的特征值几乎相同。

推论 设 G 和 $Y^T GX$ 的奇异值分别为 $\sigma_1 \geq \sigma_2 \geq \cdots \geq \sigma_n$ 和 $\tilde{\sigma}_1 \geq \tilde{\sigma}_2 \geq \cdots \geq \tilde{\sigma}_n$, 令 $\varepsilon = \max \{ \|X^T X - I\|_2, \|Y^T Y - I\|_2 \}$, 则

$$|\tilde{\sigma}_i - \sigma_i| \leq \varepsilon |\sigma_i| \text{ 或 } \frac{|\tilde{\sigma}_i - \sigma_i|}{|\sigma_i|} \leq \varepsilon \quad (\text{if } \sigma_i \neq 0)$$

下面给出特征向量的相对扰动性质。

定义 设 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 的特征值为 $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n$, 若 $\lambda_i \neq 0$, 则 λ_i 与其余特征值之间的**相对间隙 (relative gap)** 定义为

$$\text{relgap}(\lambda_i, A) = \min_{j \neq i} \frac{|\lambda_j - \lambda_i|}{|\lambda_i|}$$

定理 设 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 和 $X^T A X \in \mathbb{R}^{n \times n}$ 的特征值分解分别为 $A = Q \Lambda Q^T$ 和 $X^T A X = \tilde{Q} \tilde{\Lambda} \tilde{Q}^T$, 其中 $Q = [q_1, q_2, \dots, q_n]$ 和 $\tilde{Q} = [\tilde{q}_1, \tilde{q}_2, \dots, \tilde{q}_n]$ 均为正交矩阵, $\Lambda = \text{diag}(\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_n)$, $\tilde{\Lambda} = \text{diag}(\tilde{\lambda}_1, \tilde{\lambda}_2, \dots, \tilde{\lambda}_n)$ 且 $\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \dots \geq \lambda_n$, $\tilde{\lambda}_1 \geq \tilde{\lambda}_2 \geq \dots \geq \tilde{\lambda}_n$. 设 θ_i 表示 q_i 和 \tilde{q}_i 之间的锐角, 令 $\varepsilon_1 = \|I - X^{-T} X^{-1}\|_2$, $\varepsilon_2 = \|X - I\|_2$, 若 $\varepsilon_1 < 1$ 且 $\text{relgap}(\tilde{\lambda}_i, X^T A X) > 0$, 则

$$\frac{1}{2} \sin 2\theta_i \leq \frac{\varepsilon_1}{1 - \varepsilon_1} \cdot \frac{1}{\text{relgap}(\tilde{\lambda}_i, X^T A X)} + \varepsilon_2$$