

高斯消元法



主讲人：邓哲也



求解方程组

求解下列方程组：

$$x + 2y = -4 \quad (1)$$

$$5x - y = 13 \quad (2)$$

大家会怎么做呢？

$$(2) - (1) \times 5 \text{ 得到 } -11y = 33$$

$$\text{于是 } y = -3$$

$$\text{代入 (1) 得到 } x = 2$$

求解方程组

方程组可以写成矩阵的形式：

$$\begin{bmatrix} 1 & 2 \\ 5 & -1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x \\ y \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -4 \\ 13 \end{bmatrix}$$

然后通过转换得到了：

$$\begin{bmatrix} 1 & 2 \\ 0 & -11 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x \\ y \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -4 \\ 33 \end{bmatrix}$$

这个时候左边是上三角矩阵，可以轻松地从下往上推出每个未知数的解。

高斯消元法

$$\begin{bmatrix} 1 & 2 \\ 5 & -1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x \\ y \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -4 \\ 13 \end{bmatrix}$$

左边的这个矩阵就是系数矩阵。

高斯消元法就是通过一系列操作把系数矩阵转化成上三角矩阵，然后依次算出未知数的过程，非常的直观。

高斯消元例子

$$\begin{bmatrix} 25 & 5 & 1 \\ 64 & 8 & 1 \\ 144 & 12 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 106.8 \\ 177.2 \\ 279.2 \end{bmatrix}$$



$$\begin{bmatrix} 25 & 5 & 1 \\ 0 & -4.8 & -1.56 \\ 0 & 0 & 0.7 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 106.8 \\ -96.21 \\ 0.735 \end{bmatrix}$$

高斯消元

一开始有 n 个方程和 n 个未知数。

$$a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + a_{13}x_3 + \dots + a_{1n}x_n = b_1$$

$$a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + a_{23}x_3 + \dots + a_{2n}x_n = b_2$$

$$\begin{array}{c} \cdot \\ \cdot \\ \cdot \end{array} \quad \begin{array}{c} \cdot \\ \cdot \\ \cdot \end{array}$$

$$a_{n1}x_1 + a_{n2}x_2 + a_{n3}x_3 + \dots + a_{nn}x_n = b_n$$

高斯消元

对于第 1 个方程，乘上 a_{21} 除以 a_{11} 。

$$\left[\frac{a_{21}}{a_{11}} \right] (a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + a_{13}x_3 + \dots + a_{1n}x_n = b_1)$$

$$a_{21}x_1 + \frac{a_{21}}{a_{11}}a_{12}x_2 + \dots + \frac{a_{21}}{a_{11}}a_{1n}x_n = \frac{a_{21}}{a_{11}}b_1$$

高斯消元

然后用第二个方程减去上一个结果

$$a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + a_{23}x_3 + \dots + a_{2n}x_n = b_2$$

$$- \quad a_{21}x_1 + \frac{a_{21}}{a_{11}}a_{12}x_2 + \dots + \frac{a_{21}}{a_{11}}a_{1n}x_n = \frac{a_{21}}{a_{11}}b_1$$

$$\left(a_{22} - \frac{a_{21}}{a_{11}}a_{12}\right)x_2 + \dots + \left(a_{2n} - \frac{a_{21}}{a_{11}}a_{1n}\right)x_n = b_2 - \frac{a_{21}}{a_{11}}b_1$$

$$a'_{22}x_2 + \dots + a'_{2n}x_n = b'_2$$

高斯消元

重复以上两步，对第 $3 \sim n$ 行都做一遍。

$$a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + a_{13}x_3 + \dots + a_{1n}x_n = b_1$$

$$a'_{22}x_2 + a'_{23}x_3 + \dots + a'_{2n}x_n = b'_2$$

$$a'_{32}x_2 + a'_{33}x_3 + \dots + a'_{3n}x_n = b'_3$$

$$\vdots \quad \vdots \quad \vdots$$

$$a'_{n2}x_2 + a'_{n3}x_3 + \dots + a'_{nn}x_n = b'_n$$

高斯消元

重复以上两步，对第 $3 \sim n$ 行都做一遍。

$$a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + a_{13}x_3 + \dots + a_{1n}x_n = b_1$$

$$a'_{22}x_2 + a'_{23}x_3 + \dots + a'_{2n}x_n = b'_2$$

$$a'_{32}x_2 + a'_{33}x_3 + \dots + a'_{3n}x_n = b'_3$$

$$\begin{array}{c} \vdots \\ a'_{n2}x_2 + a'_{n3}x_3 + \dots + a'_{nn}x_n = b'_n \end{array}$$

高斯消元

然后用第 2 行去消第 3~n 行

$$a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + a_{13}x_3 + \dots + a_{1n}x_n = b_1$$

$$a'_{22}x_2 + a'_{23}x_3 + \dots + a'_{2n}x_n = b'_2$$

$$a''_{33}x_3 + \dots + a''_{3n}x_n = b''_3$$

$$\vdots$$

$$a''_{n3}x_3 + \dots + a''_{nn}x_n = b''_n$$

高斯消元

直到最后一行

$$a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + a_{13}x_3 + \dots + a_{1n}x_n = b_1$$

$$a'_{22}x_2 + a'_{23}x_3 + \dots + a'_{2n}x_n = b'_2$$

$$a''_{33}x_3 + \dots + a''_{3n}x_n = b''_3$$

$$\vdots \quad \vdots$$

$$a^{(n-1)}_{nn}x_n = b^{(n-1)}_n$$

高斯消元

矩阵形式:

$$\begin{bmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} & \cdots & a_{1n} \\ 0 & a'_{22} & a'_{23} & \cdots & a'_{2n} \\ 0 & 0 & a''_{33} & \cdots & a''_{3n} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \cdots & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & 0 & a^{(n-1)}_{nn} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ \vdots \\ x_n \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} b_1 \\ b'_2 \\ b''_3 \\ \vdots \\ b^{(n-1)}_n \end{bmatrix}$$

高斯消元

倒推出 x_n, x_{n-1}, \dots, x_1

$$x_n = \frac{b_n^{(n-1)}}{a_{nn}^{(n-1)}}$$

$$x_i = \frac{b_i^{(i-1)} - \sum_{j=i+1}^n a_{ij}^{(i-1)} x_j}{a_{ii}^{(i-1)}} \text{ for } i = n-1, \dots, 1$$

高斯消元例子

给出火箭升空后的速度与时间的记录表：

时间/(s)	速度/(m/s)
5	106.8
8	177.2
12	279.2

已知： $v(t) = a_1 t^2 + a_2 t + a_3$, $5 \leq t \leq 12$.

求 $t = 6$ 时的速度。

高斯消元例子

$$\begin{bmatrix} t_1^2 & t_1 & 1 \\ t_2^2 & t_2 & 1 \\ t_3^2 & t_3 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} a_1 \\ a_2 \\ a_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} v_1 \\ v_2 \\ v_3 \end{bmatrix}$$

$$\begin{bmatrix} 25 & 5 & 1 \\ 64 & 8 & 1 \\ 144 & 12 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} a_1 \\ a_2 \\ a_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 106.8 \\ 177.2 \\ 279.2 \end{bmatrix}$$

高斯消元例子

$$\begin{bmatrix} 25 & 5 & 1 \\ 64 & 8 & 1 \\ 144 & 12 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} a_1 \\ a_2 \\ a_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 106.8 \\ 177.2 \\ 279.2 \end{bmatrix} \Rightarrow \begin{bmatrix} 25 & 5 & 1 & \vdots & 106.8 \\ 64 & 8 & 1 & \vdots & 177.2 \\ 144 & 12 & 1 & \vdots & 279.2 \end{bmatrix}$$

高斯消元例子

$$\begin{bmatrix} 25 & 5 & 1 & \vdots & 106.8 \\ 64 & 8 & 1 & \vdots & 177.2 \\ 144 & 12 & 1 & \vdots & 279.2 \end{bmatrix} \quad \frac{64}{25} = 2.56$$

$$[25 \quad 5 \quad 1 \quad \vdots \quad 106.8] \times 2.56 = [64 \quad 12.8 \quad 2.56 \quad \vdots \quad 273.408]$$

$$\begin{array}{r} [64 \quad 8 \quad 1 \quad \vdots \quad 177.2] \\ - [64 \quad 12.8 \quad 2.56 \quad \vdots \quad 273.408] \\ \hline [0 \quad -4.8 \quad -1.56 \quad \vdots \quad -96.208] \end{array}$$

$$\begin{bmatrix} 25 & 5 & 1 & \vdots & 106.8 \\ 0 & -4.8 & -1.56 & \vdots & -96.208 \\ 144 & 12 & 1 & \vdots & 279.2 \end{bmatrix}$$

高斯消元例子

$$\begin{bmatrix} 25 & 5 & 1 & \vdots & 106.8 \\ 0 & -4.8 & -1.56 & \vdots & -96.208 \\ 144 & 12 & 1 & \vdots & 279.2 \end{bmatrix} \quad \frac{144}{25} = 5.76$$

$$[25 \quad 5 \quad 1 \quad \vdots \quad 106.8] \times 5.76 = [144 \quad 28.8 \quad 5.76 \quad \vdots \quad 615.168]$$

$$\begin{array}{r} [144 \quad 12 \quad 1 \quad \vdots \quad 279.2] \\ -[144 \quad 28.8 \quad 5.76 \quad \vdots \quad 615.168] \\ \hline [0 \quad -16.8 \quad -4.76 \quad \vdots \quad -335.968] \end{array}$$

$$\begin{bmatrix} 25 & 5 & 1 & \vdots & 106.8 \\ 0 & -4.8 & -1.56 & \vdots & -96.208 \\ 0 & -16.8 & -4.76 & \vdots & -335.968 \end{bmatrix}$$

高斯消元例子

$$\begin{bmatrix} 25 & 5 & 1 & \vdots & 106.8 \\ 0 & -4.8 & -1.56 & \vdots & -96.2 \\ 0 & 0 & 0.7 & \vdots & 0.7 \end{bmatrix} \Rightarrow \begin{bmatrix} 25 & 5 & 1 \\ 0 & -4.8 & -1.56 \\ 0 & 0 & 0.7 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} a_1 \\ a_2 \\ a_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 106.8 \\ -96.208 \\ 0.76 \end{bmatrix}$$

$$0.7a_3 = 0.76$$

$$a_3 = \frac{0.76}{0.7}$$

$$a_3 = 1.08571$$

高斯消元例子

$$\begin{bmatrix} 25 & 5 & 1 & \vdots & 106.8 \\ 0 & -4.8 & -1.56 & \vdots & -96.2 \\ 0 & 0 & 0.7 & \vdots & 0.7 \end{bmatrix} \Rightarrow \begin{bmatrix} 25 & 5 & 1 \\ 0 & -4.8 & -1.56 \\ 0 & 0 & 0.7 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} a_1 \\ a_2 \\ a_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 106.8 \\ -96.208 \\ 0.76 \end{bmatrix}$$

$$-4.8a_2 - 1.56a_3 = -96.208$$

$$a_2 = \frac{-96.208 + 1.56a_3}{-4.8}$$

$$a_2 = \frac{-96.208 + 1.56 \times 1.08571}{-4.8}$$

$$a_2 = 19.6905$$

高斯消元例子

$$\begin{bmatrix} 25 & 5 & 1 & \vdots & 106.8 \\ 0 & -4.8 & -1.56 & \vdots & -96.2 \\ 0 & 0 & 0.7 & \vdots & 0.7 \end{bmatrix} \Rightarrow \begin{bmatrix} 25 & 5 & 1 \\ 0 & -4.8 & -1.56 \\ 0 & 0 & 0.7 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} a_1 \\ a_2 \\ a_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 106.8 \\ -96.208 \\ 0.76 \end{bmatrix}$$

$$25a_1 + 5a_2 + a_3 = 106.8$$

$$\begin{aligned} a_1 &= \frac{106.8 - 5a_2 - a_3}{25} \\ &= \frac{106.8 - 5 \times 19.6905 - 1.08571}{25} \\ &= 0.290472 \end{aligned}$$

高斯消元例子

$$\begin{bmatrix} a_1 \\ a_2 \\ a_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0.290472 \\ 19.6905 \\ 1.08571 \end{bmatrix}$$

$$\begin{aligned} v(6) &= 0.290472(6)^2 + 19.6905(6) + 1.08571 \\ &= 129.686 \text{ m/s.} \end{aligned}$$

下节课再见