

Analyse numérique

Correction série d'exercices N^o1 : Résolution numérique des systèmes d'équations linéaires

Niveau : 3 A & B Année universitaire : 2022-2023

Exercice 1

Partie I

1. a) On a

$$\det(A) = \begin{vmatrix} 2 & 0 & 1 \\ 2 & 4 & -1 \\ -1 & 1 & 3 \end{vmatrix} = 4 \begin{vmatrix} 2 & 1 \\ -1 & 3 \end{vmatrix} - \begin{vmatrix} 2 & 1 \\ 2 & -1 \end{vmatrix} = 32 \neq 0.$$

Alors le système (S) admet dans \mathbb{R}^3 une unique solution.

b)

$$(A|b) = \begin{pmatrix} \boxed{2} & 0 & 1 & 1\\ 2 & 4 & -1 & 3\\ -1 & 1 & 3 & -4 \end{pmatrix}$$

Étape 1 :

$$L_1 \leftarrow L_1$$

$$L_2 \leftarrow L_2 - L_1$$

$$L_3 \leftarrow L_3 + \frac{1}{2}L_1$$

. Alors

$$(A|b)^{(1)} = \begin{pmatrix} 2 & 0 & 1 & 1 \\ 0 & \boxed{4} & -2 & 2 \\ 0 & 1 & \frac{7}{2} & -\frac{7}{2} \end{pmatrix}$$

Étape 2:

$$L_1 \leftarrow L_1,$$
 $L_2 \leftarrow L_2$

$$L_3 \leftarrow L_3 - \frac{1}{4}L_2,$$

. Alors,

$$(A|b)^{(2)} = \begin{pmatrix} 2 & 0 & 1 & 1\\ 0 & 4 & -2 & 2\\ 0 & 0 & 4 & -4 \end{pmatrix}$$

Alors, $S \Leftrightarrow \left\{ \begin{array}{rcl} 2x_1 + x_3 & = & 1 \\ 4x_2 - 2x_3 & = & 2 \\ 4x_3 & = & -4 \end{array} \right.$. En utilisant la méthode de remontée on obtient :

$$X = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ -1 \end{pmatrix}.$$

2) a)

Rappel: Soit A une matrice à diagonale strictement dominante alors les méthodes de Jacobi et de Gauss-Seidel appliquées au système (S): AX = b sont convergentes pour tous $X^{(0)}$.

On dit que A est à diagonale strictement dominante lorsque le module de chaque terme diagonal est supérieur strictement à la somme des modules des autres termes de sa ligne, c-à-d,

$$|a_{i,i}| > \sum_{\substack{j=1\\j\neq i}}^{n} |a_{i,j}|, \quad \forall i \in [1, n].$$

 $\overline{On \ a}$

$$\begin{cases} |2| > |0| + |1| \\ |4| > |2| + |-1| \\ |3| > |-1| + |1| \end{cases}$$

Ainsi A est à diagonale strictement dominante et par suite les méthodes de Jacobi et de Gauss-Seidel sont convergentes pour la résolution du système (S).

2) b) Schéma itératif de la méthode de Jacobi : $\forall k \in \mathbb{N}$,

$$\begin{cases} 2x_1^{(k+1)} + x_3^{(k)} &= 1\\ 2x_1^{(k)} + 4x_2^{(k+1)} - x_3^{(k)} &= 3\\ -x_1^{(k)} + x_2^{(k)} + 3x_3^{(k+1)} &= -4 \end{cases} \Rightarrow \begin{cases} x_1^{(k+1)} &= \frac{1 - x_3^{(k)}}{2}\\ x_2^{(k+1)} &= \frac{3 - 2x_1^{(k)} + x_3^{(k)}}{4}\\ x_3^{(k+1)} &= \frac{-4 + x_1^{(k)} - x_2^{(k)}}{3} \end{cases}$$

Schéma itératif de la méthode de Gauss-Seidel : $\forall k \in \mathbb{N}$,

$$\begin{cases} 2x_1^{(k+1)} + x_3^{(k)} &= 1\\ 2x_1^{(k+1)} + 4x_2^{(k+1)} - x_3^{(k)} &= 3\\ -x_1^{(k+1)} + x_2^{(k+1)} + 3x_3^{(k+1)} &= -4 \end{cases} \Rightarrow \begin{cases} x_1^{(k+1)} &= \frac{1 - x_3^{(k)}}{2}\\ x_2^{(k+1)} &= \frac{3 - 2x_1^{(k+1)} + x_3^{(k)}}{2}\\ x_2^{(k+1)} &= \frac{4}{3} \\ x_3^{(k+1)} &= \frac{-4 + x_1^{(k+1)} - x_2^{(k+1)}}{3} \end{cases}$$

- **2)** c) Pour un vecteur initial $X^{(0)} = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}$,
- (i) la méthode de Jacobi:

$$X_J^{(1)} = \begin{pmatrix} \frac{1}{2} \\ \frac{1}{4} \\ -1 \end{pmatrix}, \quad X_J^{(2)} = \begin{pmatrix} 1 \\ \frac{1}{4} \\ -\frac{5}{4} \end{pmatrix}$$

(ii) la méthode de Gauss-Seidel :

$$X_{G-S}^{(1)} = \begin{pmatrix} \frac{1}{2} \\ \frac{1}{2} \\ -\frac{4}{3} \end{pmatrix}, \quad X_{G-S}^{(2)} = \begin{pmatrix} \frac{7}{6} \\ -\frac{1}{6} \\ -\frac{8}{9} \end{pmatrix}$$

Partie II

3) $1^{\grave{e}re\ it\acute{e}ration}$:

$$E_J^{(1)} = ||X_J^{(1)} - X||_2 = \left\| \begin{pmatrix} -\frac{1}{2} \\ \frac{1}{4} \\ 0 \end{pmatrix} \right\|_2 = \frac{\sqrt{5}}{4} = 0,5590.$$

$$E_{G-S}^{(1)} = ||X_{G-S}^{(1)} - X||_2 = \left\| \begin{pmatrix} -\frac{1}{2} \\ \frac{1}{2} \\ -\frac{1}{3} \end{pmatrix} \right\|_2 = \sqrt{\frac{11}{18}} = 0,7817.$$

 $2^{\grave{e}me}$ itération :

$$E_J^{(2)} = ||X_J^{(2)} - X||_2 = \left\| \begin{pmatrix} 0\\\frac{1}{4}\\-\frac{1}{4} \end{pmatrix} \right\|_2 = \frac{1}{\sqrt{8}} = 0,3535.$$

$$E_{G-S}^{(2)} = ||X_{G-S}^{(2)} - X||_2 = \left\| \begin{pmatrix} \frac{1}{6} \\ -\frac{1}{6} \\ \frac{1}{9} \end{pmatrix} \right\|_2 = \sqrt{\frac{11}{162}} = 0,2605.$$

4) Suite à la première itération, la méthode de Jacobi approche mieux la solution et suite à la deuxième itération, la méthode de Gauss-Seidel approche mieux la solution.

Exercice 2

1.

$$\det(A) = \begin{vmatrix} \alpha & 1 & 0 \\ 1 & \alpha & 1 \\ 0 & 1 & \alpha \end{vmatrix} = \alpha \begin{vmatrix} \alpha & 1 \\ 1 & \alpha \end{vmatrix} - \begin{vmatrix} 1 & 1 \\ 0 & \alpha \end{vmatrix} = \alpha(\alpha^2 - 2).$$

Pour que A soit inversible il faut et il suffit que $det(A) \neq 0$, or $det(A) = \alpha(\alpha^2 - 2)$, donc A est inversible si et seulement si $\alpha \in \mathbb{R} \setminus \{0, \sqrt{2}, -\sqrt{2}\}$.

2. Pour que la méthode de Jacobi soit convergente il suffit que A soit à diagonale strictement dominante c-â-d:

$$\begin{cases} |\alpha| > 1\\ |\alpha| > 2\\ |\alpha| > 1 \end{cases}$$

 $Donc \ si \ \alpha \in]-\infty, -2[\cup]2, +\infty[, \ alors \ la \ m\'ethode \ de \ Jacobi \ est \ convergente.$

3. Pour $\alpha = 3$, alors $A = \begin{pmatrix} 3 & 1 & 0 \\ 1 & 3 & 1 \\ 0 & 1 & 3 \end{pmatrix}$

(a)

$$(A|b) = \left(\begin{array}{ccc|c} 3 & 1 & 0 & 5 \\ 1 & 3 & 1 & 10 \\ 0 & 1 & 3 & 11 \end{array}\right)$$

Étape 1:

$$L_1 \leftarrow L_1$$

$$L_2 \leftarrow L_2 - \frac{1}{3}L_1$$

$$L_3 \leftarrow L_3$$

. Alors :

$$(A|b)^{(1)} = \begin{pmatrix} 3 & 1 & 0 & 5 \\ 0 & \frac{8}{3} & 1 & \frac{25}{3} \\ 0 & 1 & 3 & 11 \end{pmatrix}$$

Étape 2:

$$L_1 \leftarrow L_1,$$

$$L_2 \leftarrow L_2$$

$$L_3 \leftarrow L_3 - \frac{3}{8}L_2,$$

.Alors:

$$(A|b)^{(2)} = \begin{pmatrix} 3 & 1 & 0 & 5\\ 0 & \frac{8}{3} & 1\\ 0 & 0 & \frac{21}{8} & \frac{25}{3} \\ \end{pmatrix}$$

En utilisant la méthode de remontée on obtient :

$$X = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 3 \end{pmatrix}$$

(b) —
• Décomposition de Jacobi :

$$\begin{cases} x_1^{(k+1)} = \frac{b_1 - a_{1,2} x_2^{(k)} - a_{1,3} x_3^{(k)}}{a_{1,1}} = \frac{1}{3} (5 - x_2^{(k)}) \\ x_2^{(k+1)} = \frac{b_2 - a_{2,1} x_1^{(k)} - a_{2,3} x_3^{(k)}}{a_{2,2}} = \frac{1}{3} (10 - x_1^{(k)} - x_3^{(k)}) \\ x_3^{(k+1)} = \frac{b_3 - a_{3,1} x_1^{(k)} - a_{3,2} x_2^{(k)}}{a_{3,3}} = \frac{1}{3} (11 - x_2^{(k)}) \end{cases}$$

• Itération de Jacobi : Pour le vecteur initial
$$X^{(0)} = \begin{pmatrix} 1\\1\\1 \end{pmatrix}$$
,

— Itération $1: X^{(1)} = \begin{pmatrix} \frac{1}{3}(5-1)\\\frac{1}{3}(10-1-1)\\\frac{1}{3}(11-1) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \frac{4}{3}\\\frac{8}{3}\\\frac{10}{3} \end{pmatrix}$

— Itération $2: X^{(2)} = \begin{pmatrix} \frac{1}{3}(5-\frac{8}{3})\\\frac{1}{3}(10-\frac{4}{3}-\frac{10}{3})\\\frac{1}{3}(11-\frac{8}{3}) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \frac{16}{9}\\\frac{25}{9} \end{pmatrix}$

Exercice 3

Partie $I: \theta = 1$

1. La matrice associé à (S^1_{α}) est $A = \begin{pmatrix} 3 & 4 & -2 \\ 1 & 2 & 1 \\ 0 & 2 & \alpha \end{pmatrix}$. (S^1_{α}) admet une unique solution ssi $\det(A) \neq$

$$\det(A) = \begin{vmatrix} 3 & 4 & -2 \\ 1 & 2 & 1 \\ 0 & 2 & \alpha \end{vmatrix}$$

$$L_2 \leftarrow L_2 - \frac{1}{3}L_1$$

$$= \begin{vmatrix} 3 & 4 & -2 \\ 0 & 2/3 & 5/3 \\ 0 & 2 & \alpha \end{vmatrix}$$

$$= 3 \begin{vmatrix} 2/3 & 5/3 \\ 2 & \alpha \end{vmatrix} = 3(\frac{2}{3}\alpha - \frac{10}{3}) = 2\alpha - 10.$$

 $\det(A) \neq 0 \iff \alpha \neq 5.$

Conclusion: pour tout $\alpha \in \mathbb{R} \setminus \{5\}$, le système (S^1_{α}) admet une unique solution.

2. On pose
$$\alpha = 6$$
, Dans ce cas $A = \begin{pmatrix} 3 & 4 & -2 \\ 1 & 2 & 1 \\ 0 & 2 & 6 \end{pmatrix}$

D'abord on peut vérifier facilement que A admet une unique décomposition LU, en effet : $A^{(1)} = (3)$; $\det(A^{(1)}) = |3| \neq 0$,

$$A^{(2)} = \begin{pmatrix} 3 & 4 \\ 1 & 2 \end{pmatrix}; \det(A^{(2)}) = \begin{vmatrix} 3 & 4 \\ 1 & 2 \end{vmatrix} = 6 - 4 = 2 \neq 0,$$

$$A^{(3)} = A$$
; $\det(A^{(3)}) = \det(A) = 2 \times 6 - 10 = 2 \neq 0$,

Ainsi toutes les mineurs principaux de A sont inversibles et par suite A admet une unique $d\acute{e}composition LU$.

Première méthode : Par les opérations élémentaires

On effectue la réduction de la matrice A jusqu'à obtenir une forme échelonnée. On calcule au fur et à mesure la matrice triangulaire inférieure L (pour la première colonne de L, on $a l_{i1} = \frac{a_{i1}}{a_{11}}$, pour la deuxième colonne de L on a $l_{i2} = \frac{a_{i2}}{a_{22}}$ et ainsi de suite pour les colonnes suivantes).

$$A = \begin{pmatrix} \boxed{3} & 4 & -2 \\ 1 & 2 & 1 \\ 0 & 2 & 6 \end{pmatrix} \xrightarrow{L_2 \leftarrow L_2 - \frac{1}{3}L_1} \begin{pmatrix} 3 & 4 & -2 \\ 0 & \boxed{2/3} & 5/3 \\ 0 & 2 & 6 \end{pmatrix} \xrightarrow{L_3 \leftarrow L_3 - 3L_2} \begin{pmatrix} 3 & 4 & -2 \\ 0 & 2/3 & 5/3 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} = U$$

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 1/3 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \xrightarrow{} \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 1/3 & 1 & 0 \\ 0 & 3 & 1 \end{pmatrix} \xrightarrow{} \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 1/3 & 1 & 0 \\ 0 & 3 & 1 \end{pmatrix} = L$$

Deuxième méthode : Par identification

A = LU avec L matrice triangulaire inférieure de diagonale unité et U matrice triangulaire supérieure :

$$L = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ l_{2,1} & 1 & 0 \\ l_{3,1} & l_{3,2} & 1 \end{pmatrix}, \quad U = \begin{pmatrix} u_{1,1} & u_{1,2} & u_{1,3} \\ 0 & u_{2,2} & u_{2,3} \\ 0 & 0 & u_{3,3} \end{pmatrix}$$

Alors par identification:

- $1 \times u_{1,1} = 3 \Rightarrow u_{1,1} = 3$
- $1 \times u_{1,2} = 1 \Rightarrow u_{1,2} = 4$
- $1 \times u_{1,3} = -2 \Rightarrow u_{1,3} = -2$

- $l_{2,1} \times 3 = 1 \Rightarrow l_{2,1} = \frac{1}{3}$ $\frac{1}{3} \times 4 + 1 \times u_{2,2} = 2 \Rightarrow u_{2,2} = \frac{2}{3}$ $\frac{1}{3} \times -2 + 1 \times u_{2,3} = 1 \Rightarrow u_{2,3} = \frac{5}{3}$
- $3 \times l_{3,1} = 0 \Rightarrow l_{3,1} = 0$
- $l_{3,2} \times \frac{2}{3} = 2 \Rightarrow l_{3,2} = 3$ $3 \times \frac{5}{3} + 1 \times u_{3,3} = 6 \Rightarrow u_{3,3} = 1$

On obtient:

$$L = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 1/3 & 1 & 0 \\ 0 & 3 & 1 \end{pmatrix}, \quad U = \begin{pmatrix} 3 & 4 & -2 \\ 0 & 2/3 & 5/3 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

RÉSOLUTION

$$AX = b \iff LUX = b$$

Cherchons $Y = \begin{pmatrix} y_1 \\ y_2 \\ y_3 \end{pmatrix}$ la solution du système linéaire LY = b.

$$L\begin{pmatrix} y_1 \\ y_2 \\ y_3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 2 \end{pmatrix} \Rightarrow \begin{pmatrix} y_1 \\ y_2 \\ y_3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 \\ \frac{2}{3} \\ 0 \end{pmatrix}$$

Après avoir calculer le vecteur Y il reste à trouver la solution du système linéaire

$$UX = Y$$

Alors,

$$\begin{pmatrix} 3 & 4 & -2 \\ 0 & 2/3 & 5/3 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 \\ \frac{2}{3} \\ 0 \end{pmatrix}$$

En utilisant la méthode de remontée on obtient : $X = \begin{pmatrix} -1 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix}$ est l'unique solution de (S_1^6) .

3.
$$A^2X = b \iff A(AX) = b \iff \begin{cases} AY = b \\ AX = Y \end{cases}$$

Exemple : Pour $\theta = 1$ et $\alpha = 6$ résoudre $A^2X = b$

$$AY = b \iff Y = \begin{pmatrix} -1 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix} \ (d'après \ Q2 \ partie \ I)$$

$$AX = Y \leftrightarrow LUX = Y \leftrightarrow \begin{cases} LZ = Y \\ UX = Z \end{cases}$$

Cherchons $Z = \begin{pmatrix} z_1 \\ z_2 \\ z_3 \end{pmatrix}$ la solution du système linéaire LZ = Y.

$$LZ = Y \leftrightarrow \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 1/3 & 1 & 0 \\ 0 & 3 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} z_1 \\ z_2 \\ z_3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -1 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix} \Rightarrow Z = \begin{pmatrix} -1 \\ 4/3 \\ -2 \end{pmatrix}$$

Après avoir calculer le vecteur Z il reste à trouver la solution du système linéaire UX = ZAlors,

$$\begin{pmatrix} 3 & 4 & -2 \\ 0 & 2/3 & 5/3 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -1 \\ 4/3 \\ -4 \end{pmatrix}$$

En utilisant la méthode de remontée on obtient : $X = \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -57/3 \\ 12 \\ -4 \end{pmatrix}$

Partie II: $\theta \in \mathbb{R}$

1. Pour que la méthode de Jacobi et de Gauss-Seidel soient convergentes il suffit que A soit à diagonale strictement dominante c-â-d :

$$\begin{cases} |3\theta| > 6\\ |2\theta| > 2\\ |\alpha| > 2 \end{cases}$$

Donc si $\alpha \in]-\infty, -2[\cup]2, +\infty[$ et $\theta \in]-\infty, -2[\cup]2, +\infty[$ alors la méthode de Jacobi et de Gauss-Seidel sont convergentes.

2. Pour
$$\alpha = 6$$
 et $\theta = 3$, $A = \begin{pmatrix} 9 & 4 & -2 \\ 1 & 6 & 1 \\ 0 & 2 & 6 \end{pmatrix}$

A est une matrice à diagonale strictement dominante, ainsi, la méthode de Jacobi et la méthode de Gauss Seidel sont convergentes.

Méthode de Jacobi

• Décomposition de Jacobi : On pose A = D - E - F

$$\begin{pmatrix} 9 & 0 & 0 \\ 0 & 6 & 0 \\ 0 & 0 & 6 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1^{k+1} \\ x_2^{k+1} \\ x_3^{k+1} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & -4 & 2 \\ -1 & 0 & -1 \\ 0 & -2 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1^{(k)} \\ x_2^{(k)} \\ x_3^{(k)} \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 2 \end{pmatrix}$$

$$\begin{cases} x_1^{(k+1)} = \frac{b_1 - a_{1,2} x_2^{(k)} - a_{1,3} x_3^{(k)}}{a_{1,1}} = \frac{1 - 4 x_2^{(k)} + 2 x_3^{(k)}}{9} \\ x_2^{(k+1)} = \frac{b_2 - a_{2,1} x_1^{(k)} - a_{2,3} x_3^{(k)}}{a_{2,2}} = \frac{1 - x_1^{(k)} - x_3^{(k)}}{6} \\ x_3^{(k+1)} = \frac{b_3 - a_{3,1} x_1^{(k)} - a_{3,2} x_2^{(k)}}{a_{3,3}} = \frac{2 - 2 x_2^{(k)}}{6} \end{cases}$$

• Itération de Jacobi : Pour le vecteur initial $X^{(0)} = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}$,

- Itération
$$1: X^{(1)} = \begin{pmatrix} -1/9 \\ -1/6 \\ 0 \end{pmatrix}$$
- Itération $2: X^{(2)} = \begin{pmatrix} 0.1851 \\ 0.1851 \\ 0.3888 \end{pmatrix}$

Méthode de Gauss Seidel

• Décomposition de Gauss-Seidel : On pose A = D - E - F

$$\begin{pmatrix} 9 & 0 & 0 \\ 1 & 6 & 0 \\ 0 & 2 & 6 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1^{k+1} \\ x_2^{k+1} \\ x_3^{k+1} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & -4 & 2 \\ 0 & 0 & -1 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1^{(k)} \\ x_2^{(k)} \\ x_3^{(k)} \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 2 \end{pmatrix}$$

8

$$\begin{cases} x_1^{(k+1)} = \frac{b_1 - a_{1,2} x_2^{(k)} - a_{1,3} x_3^{(k)}}{a_{1,1}} = \frac{1 - 4 x_2^{(k)} + 2 x_3^{(k)}}{9} \\ x_2^{(k+1)} = \frac{b_2 - a_{2,1} x_1^{(k+1)} - a_{2,3} x_3^{(k)}}{a_{2,2}} = \frac{1 - x_1^{(k+1)} - x_3^{(k)}}{6} \\ x_3^{(k+1)} = \frac{b_3 - a_{3,1} x_1^{(k+1)} - a_{3,2} x_2^{(k+1)}}{a_{3,3}} = \frac{2 - 2 x_2^{(k+1)}}{6} \end{cases}$$

- Itération de Gauss Seidel : Pour le vecteur initial $X^{(0)} = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}$,

 - Itération 1 : $X^{(1)} = \begin{pmatrix} -1/9 \\ 1/52 \\ 52/162 \end{pmatrix}$ Itération 2 : $X^{(2)} = \begin{pmatrix} 0.1742 \\ -0,0290 \\ 0,3430 \end{pmatrix}$