Eliminação Gaussiana

Prof. Americo Cunha

Universidade do Estado do Rio de Janeiro - UERJ

americo.cunha@uerj.br

www.americocunha.org





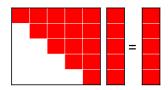




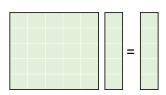




Num sistema linear triangular, existe um desacoplamento entre as equações, que facilita a solução!

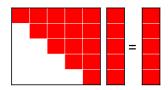


Num sistema linear "cheio", não existe tal desacoplamento!





Num sistema linear triangular, existe um desacoplamento entre as equações, que facilita a solução!



Num sistema linear "cheio", não existe tal desacoplamento!

Como proceder nesse caso?



Sistema $n \times n$ "cheio"

$$\begin{bmatrix} a_{11} & a_{12} & \cdots & a_{1n} \\ a_{21} & a_{22} & \cdots & a_{2n} \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{n1} & a_{n2} & \cdots & a_{nn} \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ \vdots \\ x_n \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} b_1 \\ b_2 \\ \vdots \\ b_n \end{bmatrix}$$

- A matriz $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ é "cheia", i.e., não tem uma estrutura especial com muitos zeros;
- Em geral, esse sistema linear tem as equações são acopladas, cada equação depende de todas as demais equações;
- O *método direto* padrão para resolver esse tipo de sistema linear é chamado *eliminação gaussiana*.

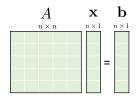


Eliminação Gaussiana

Ideia do método:

- Transformar o sistema "cheio" num sistema triangular, que seja equivalente ao sistema original (tenha a mesma solução);
- Resolver o sistema triangular por substituição.

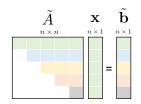
Sistema Original





Eliminação Gaussiana

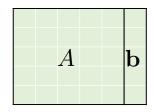
Sistema Equivalente (mesma solução)





Através de uma sequência de operações elementares:

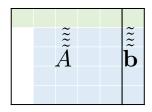
- trocar duas linhas/colunas de posição;
- multiplicar uma linha/coluna por uma constante não nula;
- somar um múltiplo de uma linha/coluna a outra linha/coluna.





Através de uma sequência de operações elementares:

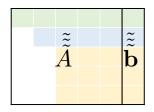
- trocar duas linhas/colunas de posição;
- multiplicar uma linha/coluna por uma constante não nula;
- somar um múltiplo de uma linha/coluna a outra linha/coluna.





Através de uma sequência de operações elementares:

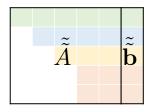
- trocar duas linhas/colunas de posição;
- multiplicar uma linha/coluna por uma constante não nula;
- somar um múltiplo de uma linha/coluna a outra linha/coluna.





Através de uma sequência de operações elementares:

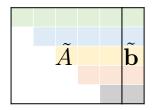
- trocar duas linhas/colunas de posição;
- multiplicar uma linha/coluna por uma constante n\u00e3o nula;
- somar um múltiplo de uma linha/coluna a outra linha/coluna.





Através de uma sequência de operações elementares:

- trocar duas linhas/colunas de posição;
- multiplicar uma linha/coluna por uma constante n\u00e3o nula;
- somar um múltiplo de uma linha/coluna a outra linha/coluna.





$$\left[\begin{array}{c|cccc} A^{(1)} & b^{(1)} \end{array} \right] = \left[\begin{array}{cccccc} a_{11}^{(1)} & a_{12}^{(1)} & a_{13}^{(1)} & \cdots & a_{1n}^{(1)} & b_{1}^{(1)} \\ a_{21}^{(1)} & a_{22}^{(1)} & a_{23}^{(1)} & \cdots & a_{2n}^{(1)} & b_{2}^{(1)} \\ a_{31}^{(1)} & a_{32}^{(1)} & a_{33}^{(1)} & \cdots & a_{3n}^{(1)} & b_{3}^{(1)} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ a_{n1}^{(1)} & a_{n2}^{(1)} & a_{n3}^{(1)} & \cdots & a_{nn}^{(1)} & b_{n}^{(1)} \end{array} \right]$$



Passo 1: anular todos os elementos abaixo do pivô $a_{11}^{(1)}$:

$$\left[\begin{array}{c|cccc} A^{(1)} & b^{(1)} \end{array} \right] = \left[\begin{array}{cccccc} a_{11}^{(1)} & a_{12}^{(1)} & a_{13}^{(1)} & \cdots & a_{1n}^{(1)} & b_{1}^{(1)} \\ a_{21}^{(1)} & a_{22}^{(1)} & a_{23}^{(1)} & \cdots & a_{2n}^{(1)} & b_{2}^{(1)} \\ a_{31}^{(1)} & a_{32}^{(1)} & a_{33}^{(1)} & \cdots & a_{3n}^{(1)} & b_{3}^{(1)} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ a_{n1}^{(1)} & a_{n2}^{(1)} & a_{n3}^{(1)} & \cdots & a_{nn}^{(n)} & b_{n}^{(1)} \end{array} \right]$$

Para i = 2, ..., n, atualize as linhas segundo:

$$L_i^{(2)} \leftarrow L_i^{(1)} - \frac{a_{i\,1}^{(1)}}{a_{11}^{(1)}} L_1^{(1)}$$



$$\left[\begin{array}{c|ccc} A^{(2)} & \mathbf{b}^{(2)} \end{array} \right] = \left[\begin{array}{ccccc} a_{11}^{(1)} & a_{12}^{(1)} & a_{13}^{(1)} & \cdots & a_{1n}^{(1)} & b_{1}^{(1)} \\ 0 & a_{22}^{(2)} & a_{23}^{(2)} & \cdots & a_{2n}^{(2)} & b_{2}^{(2)} \\ 0 & a_{32}^{(2)} & a_{33}^{(2)} & \cdots & a_{3n}^{(2)} & b_{3}^{(2)} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ 0 & a_{n2}^{(2)} & a_{n3}^{(2)} & \cdots & a_{nn}^{(n)} & b_{n}^{(2)} \end{array} \right]$$



Passo 2: anular todos os elementos abaixo do pivô $a_{22}^{(2)}$:

$$\begin{bmatrix} A^{(2)} \mid \mathbf{b}^{(2)} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} a_{11}^{(1)} & a_{12}^{(1)} & a_{13}^{(1)} & \cdots & a_{1n}^{(1)} & b_{1}^{(1)} \\ 0 & a_{22}^{(2)} & a_{23}^{(2)} & \cdots & a_{2n}^{(2)} & b_{2}^{(2)} \\ 0 & a_{32}^{(2)} & a_{33}^{(2)} & \cdots & a_{3n}^{(2)} & b_{3}^{(2)} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ 0 & a_{n2}^{(2)} & a_{n3}^{(2)} & \cdots & a_{nn}^{(n)} & b_{n}^{(2)} \end{bmatrix}$$

Para i = 3, ..., n, atualize as linhas segundo:

$$L_i^{(3)} \leftarrow L_i^{(2)} - \frac{a_{i2}^{(2)}}{a_{22}^{(2)}} L_2^{(2)}$$



$$\left[\begin{array}{c|ccc} A^{(3)} & \mathbf{b}^{(3)} \end{array} \right] = \left[\begin{array}{ccccc} a_{11}^{(1)} & a_{12}^{(1)} & a_{13}^{(1)} & \cdots & a_{1n}^{(1)} & b_{1}^{(1)} \\ 0 & a_{22}^{(2)} & a_{23}^{(2)} & \cdots & a_{2n}^{(2)} & b_{2}^{(2)} \\ 0 & 0 & a_{33}^{(3)} & \cdots & a_{3n}^{(3)} & b_{3}^{(3)} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & a_{n3}^{(3)} & \cdots & a_{nn}^{(3)} & b_{n}^{(3)} \end{array} \right]$$



Passo 3: anular todos os elementos abaixo do pivô $a_{33}^{(3)}$:

$$\begin{bmatrix} A^{(3)} \mid \mathbf{b}^{(3)} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} a_{11}^{(1)} & a_{12}^{(1)} & a_{13}^{(1)} & \cdots & a_{1n}^{(1)} \mid b_1^{(1)} \\ 0 & a_{22}^{(2)} & a_{23}^{(2)} & \cdots & a_{2n}^{(2)} \mid b_2^{(2)} \\ 0 & 0 & a_{33}^{(3)} & \cdots & a_{3n}^{(3)} \mid b_3^{(3)} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & a_{n3}^{(3)} & \cdots & a_{nn}^{(3)} \mid b_n^{(3)} \end{bmatrix}$$

Para i = 4, ..., n, atualize as linhas segundo:

$$L_i^{(4)} \leftarrow L_i^{(3)} - \frac{a_{i3}^{(3)}}{a_{33}^{(3)}} L_3^{(3)}$$



 \dots continua até a coluna (n-1) \dots



$$\begin{bmatrix} A^{(n)} \mid \mathbf{b}^{(n)} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} a_{11}^{(1)} & a_{12}^{(1)} & a_{13}^{(1)} & \cdots & a_{1n}^{(1)} & b_{1}^{(1)} \\ 0 & a_{22}^{(2)} & a_{23}^{(2)} & \cdots & a_{2n}^{(2)} & b_{2}^{(2)} \\ 0 & 0 & a_{33}^{(3)} & \cdots & a_{3n}^{(3)} & b_{3}^{(3)} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \ddots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & \cdots & a_{nn}^{(n)} & b_{n}^{(n)} \end{bmatrix}$$



A fórmula geral da eliminação gaussiana é dada por

$$L_i^{(k+1)} \leftarrow L_i^{(k)} - \frac{a_{i\,k}^{(k)}}{a_{kk}^{(k)}} L_k^{(k)}$$

onde
$$k = 1, 2, \dots, n - 1$$
.



Algoritmo para a eliminação gaussiana

```
Input: A, b
 1: Compute the length of b
 2: for k=1:n-1 do
 3:
       for i=k+1:n do
 4:
    I_{ik} = -a_{ik}/a_{kk}
 5:
    for j=1:n do
 6:
         a_{ii} = a_{ii} + I_{ik} a_{ki}
      end for
 8:
        b_i = b_i + l_{ik} b_k
 g.
       end for
10: end for
11: Compute x with backward substitution
12: return
Output: x
```

Esse algoritmo tem uma implementação pedagógica da eliminação gaussiana,

não é o mais eficiente do ponto de vista computacional.



Implementação em GNU Octave

```
function [x, A, b] = gauss(A, b)
   n = length(b);
   for k=1:n-1
      for i=k+1:n
         Lik = -A(i,k)/A(k,k);
         for j=1:n
            A(i,j) = A(i,j) + Lik*A(k,j);
         end
         b(i) = b(i) + Lik*b(k);
      end
   end
   x = backwardsub(A,b);
end
```



Experimento Computacional 1

$$\begin{bmatrix} 2 & 1 & -1 \\ -3 & -1 & 2 \\ -2 & 1 & 2 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 8 \\ -11 \\ -3 \end{bmatrix} \longrightarrow \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 2 \\ 3 \\ -1 \end{bmatrix}$$



Experimento Computacional 2

$$\begin{bmatrix} 1 & 2 & 3 & 4 \\ 2 & 1 & 4 & 3 \\ 3 & 2 & 1 & 4 \\ 4 & 3 & 2 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 10 \\ 10 \\ 10 \\ 10 \end{bmatrix} \longrightarrow \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \\ 1 \end{bmatrix}$$



$$>>$$
 b = [10; 10; 10; 10]

$$>>$$
 [x,A,b] = gauss(A,b)



Experimento Computacional 3

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 1 & 1 & 2 \\ 1 & 2 & 2 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ 2 \\ 1 \end{bmatrix} \longrightarrow \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \\ 1 \end{bmatrix}$$







$$\left[\begin{array}{ccc|c} 1 & 1 & 1 & 1 \\ 1 & 1 & 2 & 2 \\ 1 & 2 & 2 & 1 \end{array}\right]$$





$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 & 1 \\ 1 & 1 & 2 & 2 \\ 1 & 2 & 2 & 1 \end{bmatrix} \qquad \begin{array}{c} L_2 \leftarrow L_2 - L_1 \\ L_3 \leftarrow L_3 - L_1 \end{array}$$

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 1 & 1 \\ 0 & 1 & 1 & 0 \end{bmatrix}$$



Eliminação Gaussiana:

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 & 1 \\ 1 & 1 & 2 & 2 \\ 1 & 2 & 2 & 1 \end{bmatrix} \qquad \begin{array}{c} L_2 \leftarrow L_2 - L_1 \\ L_3 \leftarrow L_3 - L_1 \end{array}$$

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 1 & 1 \\ 0 & 1 & 1 & 0 \end{bmatrix} \qquad \begin{array}{c} L_3 \leftarrow L_3 - \frac{1}{0}L_2 \\ \end{array}$$

Divisão por zero, perigo!



$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 & 1 \\ 1 & 1 & 2 & 2 \\ 1 & 2 & 2 & 1 \end{bmatrix} \qquad \begin{array}{c} L_2 \leftarrow L_2 - L_1 \\ L_3 \leftarrow L_3 - L_1 \end{array}$$

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 1 & 1 \\ 0 & 1 & 1 & 0 \end{bmatrix} \qquad \begin{array}{c} L_3 \leftarrow L_3 - \frac{1}{0} L_2 \\ \text{Divisão por zero, perigo!} \end{array}$$

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 1 & 1 \\ \text{NaN NaN } -\infty & -\infty \end{bmatrix}$$



Eliminação Gaussiana:

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 & | & 1 \\ 1 & 1 & 2 & | & 2 \\ 1 & 2 & 2 & | & 1 \end{bmatrix} \qquad \begin{array}{c} L_2 \leftarrow L_2 - L_1 \\ L_3 \leftarrow L_3 - L_1 \end{array}$$

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 & | & 1 \\ 0 & 0 & 1 & | & 1 \\ 0 & 1 & 1 & | & 0 \end{bmatrix} \qquad \begin{array}{c} L_3 \leftarrow L_3 - \frac{1}{0} L_2 \\ \text{Divisão por zero, perigo!} \end{array}$$

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 & 1 & | & 1 \\ 0 & 0 & 1 & | & 1 \\ \text{NaN NaN } -\infty & | & -\infty \end{bmatrix}$$

Os demais cálculos são comprometidos por NaN e $-\infty$.



Para pensar em casa ...

Exercício computacional:

Pense num algoritmo mais eficiente (em termos de processamento e uso de memória) para implementar a eliminação gaussiana. Implemente esse algoritmo no ambiente GNU Octave.

Exercício computacional:

Pense num algoritmo para a eliminação gaussiana, que resolva o problema de ter um denominador nulo durante o processo de escalonamento da matriz estendida. Implemente esse algoritmo no ambiente GNU Octave.

Mais a frente nesse curso veremos como remediar essa questão do denominador nulo.



Elim. Gauss. = Triangularização + Substituição



Elim. Gauss. = Triangularização + Substituição

flops (Triangularização)
$$\approx \underbrace{(n-1)+(n-2)+\cdots+1}_{\text{divisões}} + \underbrace{(n-1)^2+(n-2)^2+\cdots+1}_{\text{multiplicações}} + \underbrace{(n-1)^2+(n-2)^2+\cdots+1}_{\text{subtrações}}$$



Elim. Gauss. = Triangularização + Substituição

flops (Triangularização)
$$\approx \underbrace{(n-1)+(n-2)+\cdots+1}_{\text{divisões}} + \underbrace{(n-1)^2+(n-2)^2+\cdots+1}_{\text{multiplicações}} + \underbrace{(n-1)^2+(n-2)^2+\cdots+1}_{\text{subtrações}}$$



 ${\sf Elim.\ Gauss.} = {\sf Triangulariza} \\ {\sf ção} + {\sf Substitui} \\ {\sf ção}$

flops (Triangularização)
$$\approx \underbrace{\frac{(n-1)+(n-2)+\cdots+1}{\text{divisões}}}_{\text{total plicações}} + \underbrace{\frac{(n-1)^2+(n-2)^2+\cdots+1}{\text{multiplicações}}}_{\text{subtrações}}$$

$$\sim \frac{2}{3} \, n^3$$

Processamento:

Memória:



Elim. Gauss. = Triangularização + Substituição

flops (Triangularização)
$$\approx \underbrace{\frac{(n-1)+(n-2)+\cdots+1}{\text{divisões}}}_{\text{divisões}} + \underbrace{\frac{(n-1)^2+(n-2)^2+\cdots+1}{\text{multiplicações}}}_{\text{subtrações}}$$

$$\underbrace{\frac{(n-1)^2+(n-2)^2+\cdots+1}{\text{subtrações}}}_{\text{odd}}$$

Processamento:

flops (Gauss)
$$\sim \frac{2}{3} \, n^3 + n^2$$

Memória:

$$mem(cheio) = n^2 + 2n$$



Tempo de processamento para um sistema "cheio"

Intel Core i7 em 2011: 12×10^9 FLOPS Intel Core i7 em 2021: 52×10^9 FLOPS

FLOPS = flops por segundo

n	flops	Tempo de CPU	
	(Elim. Gauss.)	2011	2021
10	767	64 ns	14 ns
10^{2}	$6,7 imes 10^5$	56 μ s	13 μ s
10^{3}	$6,7 \times 10^{8}$	56 ms	13 ms
10^{4}	$6,7 imes 10^{11}$	56 s	13 s
10^{5}	$6,7 \times 10^{14}$	15 horas	4 horas
10^{6}	$6,7 \times 10^{17}$	643 dias	148 dias
10^{7}	$6,7 \times 10^{20}$	1,7k anos	406 anos
10 ⁸	$6,7\times10^{23}$	1,7M anos	406k anos



Uso de memória para um sistema "cheio"

1 double = 8 bytes

		memória
n	entradas	memoria
10	120	1 kB
10^{2}	10×10^3	80 kB
10^{3}	$1 imes 10^6$	8 MB
10^{4}	$100 imes 10^6$	763 MB
10^{5}	$10 imes 10^9$	75 GB
10^{6}	$1 imes 10^{12}$	7 TB
10^{7}	100×10^{12}	727 TB
10 ⁸	1×10^{16}	71 PB



Moral sobre sistemas lineares "cheios"

- 1. Sistemas lineares "cheios" são muito desafiadores, tanto em tempo de CPU quanto ao uso de memória;
- Sistemas "cheios" que são intratáveis via métodos diretos podem ser atacados por métodos iterativos junto com estratégias de armazenamento otimizadas;
- Na maioria das aplicações práticas as matrizes tem estruturas especiais (e.g. simétrica, em banda etc), que podem ser exploradas para reduzir tempo de CPU e uso de memória;
- 4. O método numérico a ser utilizado na solução do sistema linear, bem como a estratégia de armazenamento, devem ser escolhidos com sabedoria!

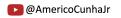
Como citar esse material?

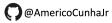
A. Cunha, *Eliminação Gaussiana*, Universidade do Estado do Rio de Janeiro – UERJ, 2021.











Essas notas de aula podem ser compartilhadas nos termos da licença Creative Commons BY-NC-ND 3.0, com propósitos exclusivamente educacionais.



