

Sisteme liniare - metode directe

Radu T. Trîmbițaș

27 martie 2016

1 Eliminare gaussiană

Să considerăm sistemul liniar cu n ecuații și n necunoscute

$$Ax = b, \quad (1)$$

unde $A \in \mathbb{K}^{n \times n}$, $b \in \mathbb{K}^{n \times 1}$ sunt date, iar $x \in \mathbb{K}^{n \times 1}$ trebuie determinat, sau scris pe componente

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \cdots + a_{1n}x_n = b_1 & (E_1) \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \cdots + a_{2n}x_n = b_2 & (E_2) \\ \vdots & \vdots \\ a_{n1}x_1 + a_{n2}x_2 + \cdots + a_{nn}x_n = b_n & (E_n) \end{cases} \quad (2)$$

1.1 Eliminare gaussiană cu pivotare parțială

Metoda este dată de algoritmul 1.

1.2 Eliminare gaussiană cu pivot scalat pe coloană

O tehnică care micșorează eroarea și preîntâmpină anularea flotantă este *pivotarea parțială cu pivot scalat pe coloană*. Definim la început un factor de scară pentru fiecare linie

$$s_i = \max_{j=1, n} |a_{ij}| \text{ or } s_i = \sum_{j=1}^n |a_{ij}|.$$

Algoritmul 1 Rezolvă sistemul $Ax = b$ prin metoda eliminării a lui Gauss

Intrare: Matricea extinsă $A = (a_{ij})$, $i = \overline{1, n}$, $j = \overline{1, n+1}$

Ieșire: Soluțiile x_1, \dots, x_n sau un mesaj de eroare

```
{Eliminare}
1: for  $i := 1$  to  $n - 1$  do
2:   Fie  $p$  cel mai mic întreg  $i \leq p \leq n$ ,  $a_{pi} \neq 0$  și  $|a_{pi}| = \max_{i \leq j \leq n} |a_{ji}|$ 
3:   if  $\nexists p$  then
4:     mesaj (' $\nexists$  soluție unică'); STOP
5:   end if
6:   if  $p \neq i$  then
7:      $(E_p) \leftrightarrow (E_i)$ 
8:   end if
9:   for  $j := i + 1$  to  $n$  do
10:     $m_{ji} := a_{ji}/a_{ii}$ ;
11:     $(E_j - m_{ji}E_i) \rightarrow (E_j)$ ;
12:  end for
13: end for
14: if  $a_{nn} = 0$  then
15:   mesaj (' $\nexists$  soluție unică'); STOP
16: end if
   {Substituție inversă}
17:  $x_n := a_{n,n+1}/a_{nn}$ ;
18: for  $i := n - 1$  downto  $1$  do
19:    $x_i = \left[ a_{i,n+1} - \sum_{j=i+1}^n a_{ij}x_j \right] / a_{ii}$ ;
20: end for
21: Returnează  $(x_1, \dots, x_n)$  {succes} STOP.
```

Dacă există un i a.î. $s_i = 0$, matricea este singulară. Pașii următori vor stabili interschimbările care se vor face. La al i -lea pas vom găsi cel mai mic întreg p , $i \leq p \leq n$, a.î.

$$\frac{|a_{pi}|}{s_p} = \max_{i \leq j \leq n} \frac{|a_{ji}|}{s_j}$$

și apoi, $(E_i) \leftrightarrow (E_p)$. Scalarea ne garantează că cel mai mare element din fiecare coloană are înainte de comparațiile necesare pentru schimbare mărimea relativă 1. Scalarea se realizează doar în comparații, nu efectiv în matrice, astfel că împărțirea cu factorul de scalare nu produce nici o eroare de rotunjire.

2 Descompunere (factorizare) LUP

Ideea din spatele descompunerii LUP este de a găsi 3 matrice pătratice de ordinul n L, U și P astfel încât

$$PA = LU \tag{3}$$

unde

- L este o matrice triunghiulară inferior;
- U este o matrice triunghiulară superior;
- P este o matrice de permutare.

Tripletul (L, U, P) se va numi **descompunere LUP** a matricei A . Orice matrice nesingulară posedă o astfel de descompunere.

Sistemul

$$Ax = b \tag{4}$$

se poate rezolva astfel

$$Ax = b \iff LUx = Pb \iff Ly = Pb \wedge Ux = y, \tag{5}$$

deoarece

$$Ax = P^{-1}LUx = P^{-1}Ly = P^{-1}Pb = b. \tag{6}$$

Având descompunerea LUP sistemul se poate rezolva cu algoritmul 2.

Algoritmul 2 Rezolvă sistemul $Ax = b$ având descompunerea LUP

Intrare: Matricele L , U , vectorul b , vectorul de permutare π , toate de dimensiune n

Ieșire: Soluțiile x_1, \dots, x_n

```
1: for  $i := 1$  to  $n$  do
2:    $y_i := b_{\pi[i]} - \sum_{j=1}^{i-1} l_{ij}y_j$ ;
3: end for
4: for  $i := n$  downto  $1$  do
5:    $x_i = \left[ y_i - \sum_{j=i+1}^n u_{ij}x_j \right] / u_{ii}$ ;
6: end for
```

Observație. Am presupus că matricea P este reprezentată prin vectorul π .

Procedura care urmează (algoritmul 3) calculează descompunerea LUP. Ea reprezintă P ca un vector π , iar L și U sunt calculate în locul lui A , adică la terminare

$$a_{ij} = \begin{cases} l_{ij}, & \text{pentru } i > j, \\ u_{ij}, & \text{pentru } i \leq j. \end{cases}$$

Algoritmul 3 Descompunere LUP

Intrare: Matricea A , de dimensiune m

Ieșire: Matricele L , U și P , toate de dimensiune m

```
 $p = 1 : m$ ;
for  $k := 1$  to  $m - 1$  do
  {Pivotare}
  Alege  $i \geq k$  care maximizează  $|u_{ik}|$ ;
   $A_{k,:} \leftrightarrow A_{i,:}$ ; {interschimbare}
   $p_k \leftrightarrow p_i$ ;
   $lin := i + 1 : m$ ;
  {Calculez complementul Schur}
   $A_{lin,k} := A_{lin,k} / A_{k,k}$ ;
   $A_{lin,lin} := A_{lin,lin} - A_{lin,k}A_{k,lin}$ ;
end for
Extrage  $L$ ,  $U$ , generează  $P$ ;
```

Exemplu. Să se calculeze descompunerea LUP a matricei

```
A =  
 2.0000  0      2.0000  0.6000  
 3.0000  3.0000  4.0000 -2.0000  
 5.0000  5.0000  4.0000  2.0000  
-1.0000 -2.0000  3.4000 -1.0000
```

Calcululele decurg astfel

```
>> [l,u,p]=lup(A)
```

interschimb liniile 1 și 3

```
A =  
  
 5.0000  5.0000  4.0000  2.0000  
 3.0000  3.0000  4.0000 -2.0000  
 2.0000  0      2.0000  0.6000  
-1.0000 -2.0000  3.4000 -1.0000
```

calculez complementul Schur

```
A =  
 5.0000  5.0000  4.0000  2.0000  
 0.6000  3.0000  4.0000 -2.0000  
 0.4000  0      2.0000  0.6000  
-0.2000 -2.0000  3.4000 -1.0000
```

```
A =  
 5.0000  5.0000  4.0000  2.0000  
 0.6000  0      1.6000 -3.2000  
 0.4000 -2.0000  0.4000 -0.2000  
-0.2000 -1.0000  4.2000 -0.6000
```

interschimb liniile 2 și 3

A =

5.0000	5.0000	4.0000	2.0000
0.4000	-2.0000	0.4000	-0.2000
0.6000	0	1.6000	-3.2000
-0.2000	-1.0000	4.2000	-0.6000

calculez complementul Schur

A =

5.0000	5.0000	4.0000	2.0000
0.4000	-2.0000	0.4000	-0.2000
0.6000	0	1.6000	-3.2000
-0.2000	0.5000	4.2000	-0.6000

A =

5.0000	5.0000	4.0000	2.0000
0.4000	-2.0000	0.4000	-0.2000
0.6000	0	1.6000	-3.2000
-0.2000	0.5000	4.0000	-0.5000

interschimb liniile 3 și 4

A =

5.0000	5.0000	4.0000	2.0000
0.4000	-2.0000	0.4000	-0.2000
-0.2000	0.5000	4.0000	-0.5000
0.6000	0	1.6000	-3.2000

calculez complementul Schur

A =

5.0000	5.0000	4.0000	2.0000
0.4000	-2.0000	0.4000	-0.2000
-0.2000	0.5000	4.0000	-0.5000
0.6000	0	0.4000	-3.2000

A =

5.0000	5.0000	4.0000	2.0000
--------	--------	--------	--------

```

    0.4000 -2.0000 0.4000 -0.2000
-0.2000  0.5000 4.0000 -0.5000
    0.6000  0      0.4000 -3.0000

```

Rezultatele finale sunt

l =

```

    1.0000  0      0      0
    0.4000  1.0000  0      0
   -0.2000  0.5000  1.0000  0
    0.6000  0      0.4000  1.0000

```

u =

```

    5.0000  5.0000  4.0000  2.0000
    0      -2.0000  0.4000 -0.2000
    0      0      4.0000 -0.5000
    0      0      0      -3.0000

```

p =

```

    0  0  1  0
    1  0  0  0
    0  0  0  1
    0  1  0  0

```

verificare:

>> disp(l*u)

```

    5.0000  5.0000  4.0000  2.0000
    2.0000  0.0000  2.0000  0.6000
   -1.0000 -2.0000  3.4000 -1.0000
    3.0000  3.0000  4.0000 -2.0000

```

>> disp(p*A)

```

    5.0000  5.0000  4.0000  2.0000
    2.0000  0.0000  2.0000  0.6000
   -1.0000 -2.0000  3.4000 -1.0000
    3.0000  3.0000  4.0000 -2.0000

```

3 Descompunere (factorizare) Cholesky

O matrice hermitiană și pozitiv definită se poate factoriza sub forma $A = LL^*$ sau $A = R^*R$, unde L este o matrice triunghiulară inferior, iar R este triunghiulară superior.

Pentru algoritm a se vedea notele de curs sau algoritmul 4.

Algoritmul 4 Descompunere Cholesky

Intrare: Matricea A , hermitiană și pozitiv definită

Ieșire: Matricea R , triunghiulară superior

```
 $R := A;$   
for  $k := 1$  to  $m$  do  
  for  $j := k + 1$  to  $m$  do  
     $R_{j,j:m} := R_{j,j:m} - R_{k,j:m} \overline{R_{k,j}} / R_{k,k}$   
  end for  
   $R_{k,k:m} := R_{k,k:m} / \sqrt{R_{k,k}}$   
end for
```

4 Probleme

Problema 1 Implementați eliminarea gaussiană cu pivotare parțială sau scalată pe coloană (la alegere) în MATLAB.

Problema 2 Să se implementeze descompunerea LUP. Să se scrie rutine pentru rezolvarea unui sistem folosind descompunerea LUP.

Problema 3 Generați sisteme cu matrice aleatoare nesingulare ce au soluția $[1, \dots, 1]^T$. Rezolvați-le cu eliminare gaussiană și descompunere LUP.

Problema 4 Să se scrie rutine pentru descompunerea Cholesky a unei matrice hermitiene și pozitiv definite și rezolvarea unui sistem cu o astfel de matrice prin descompunere Cholesky. Testați rutinele pentru matrice generate aleator și sisteme cu matrice aleatoare, dar cu soluție cunoscută.

Problema 5 *Rezolvați sistemul*

$$\begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 & \dots & 1 \\ -1 & 1 & 0 & \dots & 1 \\ -1 & -1 & 1 & \dots & 1 \\ -1 & -1 & -1 & 1 & \dots & 1 \\ \vdots & & \ddots & \ddots & \vdots \\ -1 & \dots & -1 & -1 & 1 \end{bmatrix} x = \begin{bmatrix} 2 \\ 1 \\ 0 \\ -1 \\ \vdots \\ -n+2 \end{bmatrix}$$

prin descompunere LUP și QR. Ce se observă? Explicați.

5 Probleme suplimentare

Problema 6 *Scrieți rutine pentru descompunerea LUP în care permutarea să se facă fizic și logic (cu vectori de permutări) și comparați timpii de execuție al ambelor variante pentru sisteme cu dimensiunea între 100 și 300.*