

Lösen des Poisson-Problems mittels Finite-Differenzen-Diskretisierung und CG-Verfahren

Marisa Breßler und Anne Jeschke (PPI27)

07.02.2020

Inhaltsverzeichnis

1	Motivation	2
2	Theoretische Grundlagen und Algorithmus	3
2.1	Idee des CG-Verfahrens	3
2.2	Algorithmus	3
3	Experimente und Beobachtungen	5
3.1	Entwicklung des absoluten Fehlers der Iterierten	5
3.2	Konvergenzverhalten für ein festes Epsilon	6
3.3	Konvergenzverhalten für variable Epsilon	7
4	Abschließende Worte	8
	Literatur	9

1 Motivation

In unserem vorherigen Berichten haben wir das Poisson-Problem vorgestellt und einen numerischen Lösungsansatz aufgezeigt, der es durch eine Diskretisierung des Gebietes und des Laplace-Operators in das Lösen eines linearen Gleichungssystems überführt. Die dabei entstehende tridiagonale Blockmatrix ist dünn besetzt, d.h. nur wenige Einträge sind ungleich Null. Deswegen ist es sinnvoll, sie als sogenannte *sparse*-Matrix abzuspeichern. Dieser Speicherplatzvorteil geht jedoch beim Lösen des linearen Gleichungssystems mittels Gauß-Algorithmus und LU-Zerlegung verloren, da eine LU-Zerlegung einer dünn besetzten Matrix im Allgemeinen nicht dünn besetzt ist. Aufgrund dieses Umstandes erscheint es sinnvoll, das lineare Gleichungssystem nicht direkt, sondern iterativ zu lösen. Solche iterativen Lösungsverfahren (wie das Gesamtschrittverfahren von Jacobi, das Einzelschrittverfahren von Gauß-Seidel, das SOR-Verfahren und das CG-Verfahren) bieten gegenüber direkten Verfahren außerdem den Vorteil, dass deren Rechenaufwand im Verhältnis zur in der Praxis für gewöhnlich sehr großen Dimension der Blockmatrix recht gering ist. Da das CG-Verfahrens eine heute durchaus übliche Methode zum Lösen großer linearer Gleichungssysteme darstellt, wollen wir dieses im Folgenden im Rahmen unseres bisherigen Settings (Poisson-Problem und Finite-Differenzen-Diskretisierung) vorstellen und untersuchen.

2 Theoretische Grundlagen und Algorithmus

Im Gegensatz zu den bisher behandelten direkten Verfahren, die nach einer endlichen Anzahl von Rechenschritten den Lösungsvektor x des linearen Gleichungssystems $Ax = b$ mit $A \in \mathbb{R}^{N \times N}$ und $b \in \mathbb{R}^N$ liefern, definiert man bei den iterativen Verfahren eine Folge (x_k) von Vektoren, die bei einem beliebigen Vektor startet und deren Grenzwert für $k \rightarrow \infty$ der genaue Lösungsvektor ist. Man wählt dann ein $\epsilon \in \mathbb{R}$ und berechnet so viele Iterationsschritte, bis das Residuum, also der approximierte Abstand des in diesem Schritt berechneten Folgeelementes zu der exakten Lösung, kleiner als ϵ ist.

Das CG-Verfahren (kurz für *conjugated gradient*) ist ein Verfahren, das nur für symmetrisch positiv definite Matrizen A funktioniert. Diese Voraussetzung wird von unserer Blockmatrix erfüllt, denn sie ist per Definition symmetrisch und irreduzibel diagonaldominant.

2.1 Idee des CG-Verfahrens

Während sich die anderen oben genannten iterativen Verfahren die Methode des Splitting zunutze machen, ist die Idee des CG-Verfahrens die Lösung des linearen Gleichungssystems in ein Minimierungsproblem zu überführen.

Dazu definiert man mit dem Standardskalarprodukt $\langle \cdot, \cdot \rangle$ die Funktion

$$\begin{aligned}\Phi(x) &:= \frac{1}{2} \langle x, Ax \rangle - \langle b, x \rangle \\ &= \frac{1}{2} x^T Ax - x^T b\end{aligned}$$

Diese besitzt genau ein globales Minimum. Dieses liegt genau an der Stelle x , die der Lösung von $Ax = b$ entspricht. Man konstruiert also, um die Lösung von $Ax = b$ zu finden, iterativ eine Folge von immer kleiner werdenden Funktionswerten von Φ .

Um das globale Minimum zu finden, sucht man ausgehend von einem Startwert zunächst nach dem Minimum entlang einer Startrichtung (eines Startgradienten). Von diesem Minimum aus wählt man eine neue Suchrichtung (einen neuen Gradienten), die zu allen vorherigen Suchrichtungen A -konjugiert, d.h. orthogonal in der A -Norm, ist und sucht erneut nach einem Minimum entlang dieses Gradienten. Dies tut man so lange, bis das Residuum kleiner oder gleich ϵ ist. Da es nur genau N zueinander A -konjugierte Richtungen gibt, würde man mit dem CG-Verfahren in der Theorie nach maximal N Schritten sogar die exakte Lösung finden. In der Praxis benötigt man jedoch den Toleranzfaktor ϵ , da durch Rundungsfehler die Suchrichtungen unter Umständen nicht mehr genau orthogonal zueinander stehen und diese Garantie somit verloren geht.

2.2 Algorithmus

Initialisierung: Man startet bei einem beliebigen $x_0 \in \mathbb{R}^N$ und wählt einen Toleranzfaktor ϵ . Man setzt $k := 0$ und berechnet das Anfangsresiduum $r_0 := Ax_0 - b$. Die erste

Suchrichtung ist $d_0 = -r_0$.

Schritt k: Falls $\|r_k\| \leq \epsilon$, hat man bereits eine Lösung im Toleranzbereich gefunden und kann hier aufhören.

Sonst berechnet man $c_k := \langle r_k, r_k \rangle / \langle Ad_k, d_k \rangle$. Dies gibt an, wie weit man in die Suchrichtung gehen muss, um das neue Minimum zu finden.

Dann gilt $x_{k+1} = x_k + c_k d_k$ und $r_{k+1} = r_k + c_k Ad_k = Ax_{k+1} - b$.

Man setzt $\beta_k := \langle g_{k+1}, g_{k+1} \rangle / \langle g_k, g_k \rangle$.

Die neue zu d_k A -konjugierte Suchrichtung ist dann $d_{k+1} := -r_{k+1} + \beta_k d_k$.

Nun setzt man $k := k + 1$ und geht erneut zu Schritt k.

So nähert man sich Schritt für Schritt einer genauen Lösung von $Ax = b$. Um zu verhindern, dass der Algorithmus für sehr viele Iterationen läuft ohne, dass sich das Ergebnis signifikant verbessert, kann man zusätzliche Abbruchbedingungen definieren, wie z.B. eine minimale Reduktion des Residuums nach jedem Schritt oder eine maximale Anzahl der Iterationsschritte.

[1]

3 Experimente und Beobachtungen

3.1 Entwicklung des absoluten Fehlers der Iterierten

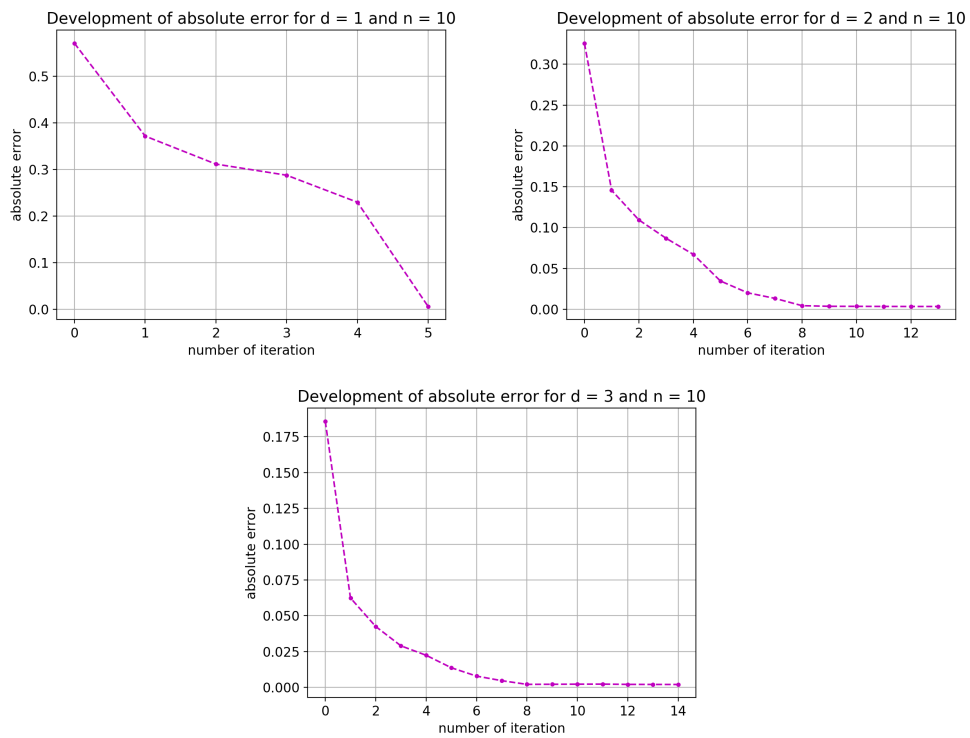


Abbildung 1: Entwicklung des Fehlers pro Iteration für $d \in \{1, 2, 3\}$ und $n = 10$

3.2 Konvergenzverhalten für ein festes Epsilon

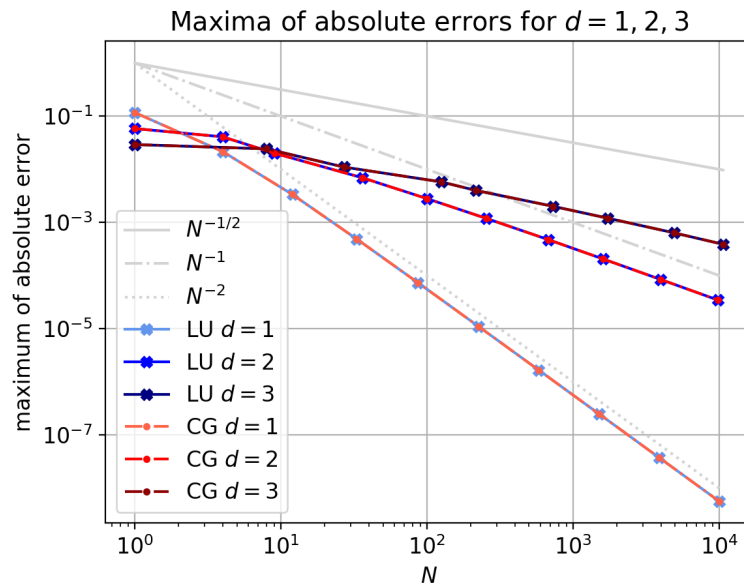


Abbildung 2: Konvergenzverhalten für $\epsilon = 10^{-8}$ für $d \in \{1, 2, 3\}$ im Vergleich zur LU Zerlegung

Konvergenz abh. von Diskretisierung, nicht von Lösungsverfahren

3.3 Konvergenzverhalten für variable Epsilon

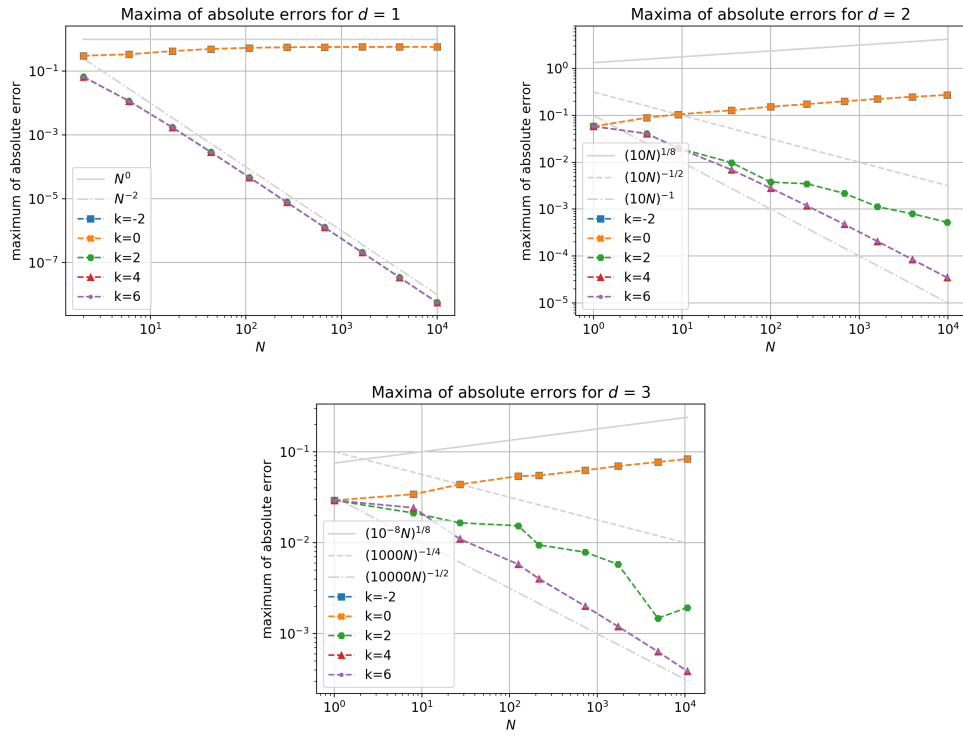


Abbildung 3: Konvergenzverhalten für $\epsilon^{(k)} = n^{-k}$ für $d \in \{1, 2, 3\}$

- 0, -2 gleich

4 Abschließende Worte

Literatur

- [1] Caren Tischendorf. Vorlesung Numerische Lineare Algebra. Vorlesungsskript, Humboldt-Universität zu Berlin, 2019/20.