Grau de Matemàtiques. Curs 2020-2021. Semestre de primavera

MÈTODES NUMÈRICS II EXAMEN PARCIAL. 9 d'abril de 2021

Exercici 1 (relacionat amb la pràctica 1, 1.5 punts)

Heu d'imitar el que fa el vostre programa en un cas molt senzill.

Es considera el PVF

$$y''(x) + 6y'(x) - 50y(x) = 100x \quad \forall x \in [0, 1],$$

 $y(0) = 1,$
 $y(1) = 1.$

Es discretitza el problema usant diferències centrades de segon ordre per a y'(x) i y''(x), amb pas de discretització h = 0.2.

- (a) Escriviu explícitament el sistema lineal que cal resoldre.
- (b) Prenent com a aproximació inicial el vector amb totes les components nul·les, feu tres iterats del mètode de Jacobi. Calculeu la $\| \|_{\infty}$ de la matriu d'iteració de Jacobi.
- (c) Prenent com a aproximació inicial el vector amb totes les components nul·les, feu dos iterats del mètode de Gauss-Seidel.

Exercici 2 (tema 1, 4 punts)

Es considera el sistema lineal real 3×3 , Ax = b, amb $b = (1, 2, 3)^T$ i

$$A = \left(\begin{array}{ccc} 1 & c & 0 \\ 0 & 1 & c \\ c & 0 & 1 \end{array}\right) ,$$

on $c \in \mathbb{R}$, $c \neq -1$, és un paràmetre. Es vol estudiar l'ús dels mètodes iteratius habituals (Jacobi, Gauss-Seidel i SOR) en aquest cas.

- (a) Sigui B_J la matriu d'iteració del mètode de Jacobi. Calculeu, en funció de c, els seus valors propis $(Spec(B_J))$ i el seu radi espectral $(\rho(B_J))$. Per quins valors de c és convergent el mètode de Jacobi?
- (b) En el cas concret c = -0.5, si es comença amb l'aproximació inicial $x^{(0)} = (0, 0, 0)^T$, feu una previsió de les iteracions k que caldria fer del mètode de Jacobi per tal que s'obtingui $||x^{(k)} x||_{\infty} < 10^{-9}$, on x és la solució del sistema.
- (c) Sigui B_1 la matriu d'iteració del mètode de Gauss-Seidel. Calculeu $Spec(B_1)$ i $\rho(B_1)$, en funció de c. Per quins valors de c és convergent el mètode de Gauss-Seidel? Per als valors de c tals que tant Jacobi com Gauss-Seidel són convergents, quin ho farà més ràpidament?

(d) Es considera finalment el mètode SOR. Trobeu la matriu d'iteració B_{ω} , així com el seu polinomi característic (els dos depenen de ω i de c). Seguidament, es considera el cas concret c=-0.5 i es vol estudiar la convergència quan $\omega\approx 1$. Vegeu que, tant si ω és lleugerament inferior a 1 com si ω és lleugerament superior a 1, es verifica $\rho(B_{\omega}) > \rho(B_1)$ (per tant, SOR no millora la convergència de Gauss-Seidel, almenys a prop de $\omega=1$).

Indicació. Per a l'última part, deduïu que, en un entorn de $\omega = 1$, els tres valors propis de B_{ω} són simples: $\lambda_i = \lambda_i(\omega)$; després, calculeu $\lambda_i'(1)$, per tal conèixer el comportament de les gràfiques de $\lambda_i(\omega)$ quan $\omega \approx 1$.

Exercici 3 (tema 2, 4.5 punts)

Sigui $A = (a_{ij})_{1 \le i,j \le 10}$, real, simètrica i verificant

$$a_{ii} = 1 + 2i$$
, $|a_{ij}| \le 1/8$, $\forall i$, $\forall j \ne i$.

Per a cada $i \in \{1, 2, ..., 10\}$, sigui $D_i(A)$ el disc de Gerschgorin associat a la fila i de la matriu A. Observeu que no es pot assegurar que siguin disjunts. També, per a cada $i \in \{1, 2, ..., 10\}$ i cada $\alpha > 0$, sigui $S_{i,\alpha} = (s_{kj})$ la matriu 10×10 que difereix de la identitat només en l'element s_{ii} , el qual val α .

- (a) Per a cada i, es fa la similaritat $B = S_{i,\alpha}AS_{i,\alpha}^{-1}$ amb $\alpha = 0.2$. És el disc $D_i(B)$ disjunt de la resta de discs $D_i(B)$?
- (b) Useu (a) per a separar els 10 valors propis de A; o sigui, doneu 10 subconjunts del pla complex, tals que cadascun contingui exactament un valor propi de A.
- (c) S'aplica el mètode de la potència a la matriu A per a trobar el seu valor propi dominant i un vector propi associat. Fiteu, inferiorment i superiorment, la raó asimptòtica de convergència.
- (d) S'aplica el mètode de Jacobi clàssic a la matriu A per a trobar tots els seus valors propis i una base de vectors propis. Trobeu una fita superior del nombre de similaritats que cal fer per tal d'obtenir una matriu tal que la norma 2 del vector format amb tots els elements no diagonals sigui menor que 10^{-6} .
- (e) Es repeteix (a) amb $\alpha > 0$ arbitrari. Trobeu l'interval de valors de α per als quals es pot assegurar que el disc $D_i(B)$ és disjunt de la resta de discs $D_j(B)$.

Nota. Aquest interval ha de contenir el valor $\alpha = 0.2$ usat en els dos primers apartats.

Solució Exercici 1: Parcial Mètodes Numèrics II

Rubén Bautista Ballester

Abril 2021

Hem de resoldre el problema de valors a la frontera

$$y''(x) + 6y'(x) - 50y(x) = 100x \quad \forall x \in [0, 1], \tag{1}$$

amb condicions y(0) = 1, y(1) = 1.

Primer ho posem en la forma donada a l'enunciat de l'exercici, amb el coeficient de y''(x) igual a -1:

$$-y''(x) - 6y'(x) + 50y(x) = -100x$$
 (2)

d'on s'obté:

$$p(x) = -6, q(x) = 50 > 0, r(x) = -100x$$
(3)

Com a=0,b=1 amb pas h=0.2 llavors n=4 (punts interiors) amb $x_i=i\cdot h$. A més a més, com p i q són constants, deduïm:

$$b_1 = b_2 = b_3 = b_4 = 1 + \frac{h^2}{2}q(x_i) = 1 + \frac{0.2^2}{2} \cdot 50 = 2,$$

$$a_1 = a_2 = a_3 = a_4 = -\frac{1}{2}\left(1 + \frac{h}{2}p(x_i)\right) = -\frac{1}{2}\left(1 + \frac{0.2}{2} \cdot (-6)\right) = -0.2, \quad (4)$$

$$c_1 = c_2 = c_3 = c_4 = -\frac{1}{2}\left(1 - \frac{h}{2}p(x_i)\right) = -\frac{1}{2}\left(1 - \frac{0.2}{2} \cdot (-6)\right) = -0.8.$$

D'altra banda, aplicant les formules obtenim:

$$r = \frac{h^2}{2} \left(r(x_1) - \frac{2a_1\alpha}{h^2}, r(x_2), r(x_3), r(x_4) - \frac{2c_n\beta}{h^2} \right)$$

$$= \frac{0.2^2}{2} \left(-100 \cdot 0.2 - \frac{2 \cdot (-0.2)}{0.2^2}, -100 \cdot 0.4, -100 \cdot 0.6, -100 \cdot 0.8 - \frac{2 \cdot (-0.8)}{0.2^2} \right)$$

$$= (-0.2, -0.8, -1.2, -0.8)$$
(5)

Per tant, el sistema a resoldre és Au=r on

$$A = \begin{bmatrix} 2 & -0.8 & 0 & 0 \\ -0.2 & 2 & -0.8 & 0 \\ 0 & -0.2 & 2 & -0.8 \\ 0 & 0 & -0.2 & 2 \end{bmatrix}$$
 (6)

D'altra banda, volem calcular $||B_j||_{\infty}$. Sabem que

$$B_{j} = -D^{-1}(L+U)$$

$$= -\frac{1}{2}I(L+U)$$

$$= -\frac{1}{2}\begin{bmatrix} 0 & -0.8 & 0 & 0\\ -0.2 & 0 & -0.8 & 0\\ 0 & -0.2 & 0 & -0.8\\ 0 & 0 & -0.2 & 0 \end{bmatrix},$$
(7)

i per tant:

$$||B_j||_{\infty} = \frac{1}{2} \cdot max(0.8, 0.2 + 0.8, 0.2) = \frac{1}{2}.$$
 (8)

Finalment, aplicant les fòrmules de Jacobi i de Gauss Seidel de teoria (o aplicant el exercici del laboratori) obtenim:

- Mètode de Jacobi:
 - 1. (-0.1, -0.4, -0.6, -0.4),
 - 2. (-0.26, -0.65, -0.8, -0.46),
 - 3. (-0.36, -0.746, -0.849, -0.48).
- Mètode de Gauss-Seidel:
 - 1. (-0.1, -0.41, -0.641, -0.4641),
 - 2. (-0.264, -0.6828, -0.85392, -0.485392).

(2)
$$A_{X=0}$$
, 3×3 , $A = \begin{pmatrix} A & C & C \\ C & O & A \end{pmatrix}$, $C \in \mathbb{R}$, $C_{Y} = A_{Y} =$

th el can que di 65 convergerson => 10/11 => 10/3/2(10/ => [65 més rapid que]

(A)
$$SOR: B_{W} = (1+w)^{-1}L^{-1} (1+w)1-w)1-w)2^{-1}L^{-1$$

@
$$\forall i', B = S_{i,d} A S_{i,d}^{n} = \left(\frac{1}{1-1}\right) \leftarrow R(G_i)$$

where $i = (\frac{A}{cd})$

Din(B) le' couhe
$$1+2(i-3)$$
 i radi $\leq 8 \cdot \frac{1}{8} + 1 \cdot \frac{1}{8a} = 1 + \frac{1}{8a}$

Din(B) i $1+2i$ ii $\leq 9 \cdot \frac{1}{8} = \frac{9}{4}$

Din(B) ii $1+2(i+1)$ ii $\leq 8 \cdot \frac{1}{8} + 1 \cdot \frac{1}{9a} = 1 + \frac{1}{9a}$

Volen Di noi., = p. Es suficient 1+2(i-1)+1+ fox < 1+2i-9 (3) 9 + fox < 1) materia Volem Din Din = 6. Es suficient 1+2i+ 9d < 1+2(i+1)-1- 1/8d => 9d+1/2 <1

$$\Rightarrow \text{ Es suficient } \boxed{\frac{9d}{8} + \frac{1}{8d} < 1} \text{ (*)}$$
Ouan $d = 0.2$ $\Rightarrow \frac{9d}{8} + \frac{1}{8d} = \frac{9}{40} + \frac{5}{8} = \frac{9+25}{40} = \frac{34}{40} < 1 \Rightarrow \text{ (ert)}$

Notes:

1) En eh casos i=1 0 i=n -> 3! desc "rei" del 0; (en lla de 2)

2) Per a voure que 0; es disjunt dels altres des, cel miran le tots, i no musi de vicins! Però, si s'imposer les condicions, remelle que surler condicion més laxes Exemple: Ditz le' centre 1+2 (i+2) i radi < 8. 2+1. 2 = 1+ 20 Si when OinDitz = p, of sufficient 1+2i+ 9x (1+2(i+2)-1- 1/2) (=) @ 9d + 2d < 3 (cent si)

6) Separació dels valors propis de A usant @

Vi, fou @ amb d=0.2 → El donc Di(B) es disjust de la reste de discus > => Oi(B) conté un n'inic vop de B (es vap de A)

A men, com que A es sin. => veges reals => usem internell en el llar de dincy. Di (B) està contribut en l'auteural d'extreum (1+2i) 7 9d = (1+2i) 70.225

 $[\forall i=1+20 : centre 1+2i; radi \leq 0.225 = \frac{9}{40}; diàmetre \leq \frac{9}{20}]$

@ Potencia. La ras anulpt. de converg. es r = 1 200 vap dominant 2 = 12 que a sinàtric Vap dominant: 2,0 € [20.775, 21.225] 200 dominant: 29 € [18.775, 19.225] $\uparrow \left\{ \frac{48.775}{21.225} \right\}^{2} = \left(\frac{751}{849} \right)^{2} \approx 0.88457^{2} \approx \boxed{0.782464} \\
\leq \left(\frac{49.225}{20.775} \right)^{2} = \left(\frac{769}{831} \right)^{2} \approx 0.925391^{2} \approx \boxed{0.856349}$ (d) Jacobi clâssic: {Ao=A Yuzz Du=JuAn-1Ju, on Ju= notació que chivina l'element wingen lubon et languit an llowon NIAu)2 = (1- 1 NIAo)2, a N = n(n-1) Per kant, N(An) = (1- 1) 1/2 N(A0) En aquest cas: $\sqrt{N} = \frac{10.9}{2} = 45 \Rightarrow 1 - \frac{1}{N} = 1 - \frac{1}{45} = \frac{44}{45} = \frac{44}{4$ N(Av) = \10-9 = \90 = \45 Si es wil N(DK) < 10-6, és suficient imposor (44) 4/2 / 45 < 10-6 Prevent logo: 4 68(45)+ 1 log(45)<-6 Aillant: K> -12-log(45/32) = 1244.7 => (k = 1245) (e) d'Interval de valon de 170 | Oi(B) & desjunt deh altre, 0; (B)? La condició suficient hobada a @ es 9d + 1/8d <1 => 9d + 1/2 <8 (*) \$(d) Eshediew fld) per a d>0 lun f(d) =+00 4-7 to \$1(d) = 9 - 1/22; \$11(d) = -2/23 <0 Y2>0 Exheu: 0 = \$1(1) () d = 1/3, mini de f(a) 1 + (3) = 93+3=6<8 Resolve fla)=8 => 9 d+ 1=8 => 9 d2-8d+1=0 => d= 8±128 = 4±17 =/d1

Resident $f(a) = 8 \Rightarrow 9 + \frac{1}{4} = 8 \Rightarrow 9 + \frac{1}{2} = 8 \Rightarrow 4 = \frac{8 \pm 1/28}{18} = \frac{4 \pm 1/4}{9} = \frac{1}{4} = \frac{1}{4}$ La condition (*) & equivalent q $d \in (d_1, d_2) \text{ on } d_1 = \frac{4 - \sqrt{2}}{9} \approx 0.15047$ $d_2 = \frac{4 + \sqrt{2}}{9} \approx 0.73842$