

CI 3 : INGÉNIERIE NUMÉRIQUE & SIMULATION

CHAPITRE 4 – RÉOLUTION D’UN SYSTÈME LINÉAIRE INVERSIBLE PAR LA MÉTHODE DE GAUSS

Savoir

Problème discret multidimensionnel, linéaire, conduisant à la résolution d’un système linéaire inversible (ou de Cramer) par la méthode de Gauss avec recherche partielle du pivot.

Problématique

Outre la compréhension et la mise en œuvre de l’algorithme, deux problèmes numérique peuvent se poser :

- les erreurs d’arrondis peuvent provoquer des erreurs importantes selon la méthode choisie ;
- des comparaisons d’un réel à zéro peuvent aussi engendrer des erreurs numériques.

1	Système linéaire	1
1.1	Définitions	2
1.2	Opérations élémentaires	2
1.3	Notation matricielle	3
2	Pivot de Gauss	3
2.1	Pivot d’une ligne	3
2.2	Algorithme du pivot	4
2.3	Matrice échelonnée	5
2.4	Matrices échelonnées réduites	5
3	Implémentation de l’algorithme	6
3.1	Choix d’un type de données	6
3.2	Fonctions élémentaires	6
3.3	Algorithme complet	8
3.4	Résolution de systèmes linéaires avec Numpy	8

1 Système linéaire

Remarque

Les résultats du cours sont écrits avec des coefficients réels mais restent vrais avec des coefficients complexes.

1.1 Définitions

On dit d'un système qu'il est linéaire s'il est de la forme :

$$\begin{cases} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \dots + a_{1p}x_p = b_1 \\ \dots \\ a_{n1}x_1 + a_{n2}x_2 + \dots + a_{np}x_p = b_n \end{cases}$$

On note $n, p \in \mathbb{N}^*$ (n équations et p inconnues), $\forall i \in \{1, \dots, n\}, \forall j \in \{1, \dots, p\}, a_{ij} \in \mathbb{R}$. i désigne l'indice de la ligne et j l'indice de la colonne.

$b_1, \dots, b_n \in \mathbb{R}$ est appelé second membre.

On dit que le système est homogène si $b_1 = b_2 = \dots = b_n = 0$.

Exemple de système linéaire (S) et son système homogène associé (S_0) :

$$(S) \begin{cases} x + y - 2z + 4t = 5 \\ 2x + 2y - 3z + t = 3 \\ 3x + 3y - 4z - 2t = 1 \end{cases} \quad (S_0) \begin{cases} x + y - 2z + 4t = 0 \\ 2x + 2y - 3z + t = 0 \\ 3x + 3y - 4z - 2t = 0 \end{cases}$$

Exemple de système non linéaire :

$$\begin{cases} x + \cos y + xy = 2 \\ x - y^2 = 4 \end{cases}$$

Une solution d'un système linéaire est un p -uplet de réels, c'est-à-dire un élément de (x_1, \dots, x_p) qui vérifie les n équations.

Si un système a au moins une solution, il est dit compatible (incompatible sinon).

1.2 Opérations élémentaires

Les opérations élémentaires sont les suivantes :

- opération de transvection (*Gaussian Elimination*) :
 - $(L_i) \leftarrow (L_i) + \lambda(L_j)$ où $i, j \in \{1, \dots, n\}, i \neq j, \lambda \in \mathbb{R}$;
 - $(L_i) \leftarrow \alpha(L_i)$ où $i \in \{1, \dots, n\}, \alpha \in \mathbb{R}^*$;
- opération d'échange de lignes :
 - $(L_i) \leftrightarrow (L_j)$ où $i, j \in \{1, \dots, n\}$.

Remarque

Pour éviter les fractions on peut également utiliser $(L_i) \leftarrow \alpha(L_i) + \lambda L_j$ où $i, j \in \{1, \dots, n\}$, $\alpha \neq 0$, $\lambda \in \mathbb{R}$ qui est une combinaison des deux premiers items.

Propriété

L'utilisation des opérations élémentaires sur un système ne change pas l'ensemble de ses solutions. Autrement dit, elles donnent des systèmes équivalents au premier.

1.3 Notation matricielle

Remarque

Les opérations élémentaires sur les lignes du système n'opèrent que sur les coefficients.

Définition

Au système défini précédemment, on associe la matrice de ses coefficients :

$$\begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & \dots & a_{1(p-1)} & a_{1p} \\ & & a_{ij} & & \\ a_{n1} & a_{n2} & \dots & a_{n(p-1)} & a_{np} \end{pmatrix} \in \mathcal{M}_{n,p}(\mathbb{R})$$

$\mathcal{M}_{n,p}(\mathbb{R})$ désigne l'ensemble des matrices à coefficients réels à n lignes et p colonnes.

Définition

On note $B = \begin{pmatrix} b_1 \\ \vdots \\ b_n \end{pmatrix}$ la matrice de second membre et $(A|B)$ la matrice A augmentée de B .

Définition

Si deux matrices M et M' diffèrent d'un nombre fini d'opération sur les lignes, on dit qu'elles sont équivalentes en lignes et on note $M \sim_L M'$.

Remarque

Sous forme matricielle le système s'écrit $AX = B$ avec X le vecteur inconnu.

2 Pivot de Gauss

2.1 Pivot d'une ligne

Définition

On appelle pivot d'une ligne le premier nombre non nul de cette ligne.

2.2 Algorithme du pivot

Premier cas, chacun des coefficients de la première colonne est nul. En conséquence, on note $M = \left(\begin{array}{c|c} 0 & \\ \vdots & \\ 0 & \end{array} \middle| M \right)$

Dans un second cas, la première colonne contient au moins un nombre non nul.

Quitte à effectuer un changement de ligne, on se ramène au cas où $a_{11} \neq 0$:

$$\left(\begin{array}{c|ccc} a_{11} & \alpha & \alpha & \alpha \\ \alpha & & & \\ \alpha & & \alpha & \\ \alpha & & & \end{array} \right) \quad \text{Les } \alpha \text{ représentent des nombres possiblement nuls.}$$

On fait apparaître des zéros sous a_{11} avec des opérations de la forme $(L_2) \leftarrow (L_2) - \frac{a_{21}}{a_{11}}(L_1)$

$$\left(\begin{array}{c|ccc} a_{11} & \alpha & \alpha & \alpha \\ 0 & & & \\ \vdots & & & \\ 0 & & & \end{array} \middle| M' \right)$$

On effectue le pivot à nouveau sur la matrice M' .

En généralisant, lorsqu'on en est à la ligne i , les lignes $i+1$ à n subissent la transvection suivante :

$$\forall k \in [i+1, n] \quad L_k \leftarrow L_k - \frac{a_{k,i}}{a_{i,i}} L_i$$

Remarque

Le nombre de colonnes diminue à chaque pivot.

L'algorithme se termine en un nombre fini d'étapes.

Soit le système suivant à résoudre ainsi que la matrice augmentée qui lui est associée :

$$\begin{cases} x + y - 2z + 4t = 5 \\ 2x + 2y - 3z + t = 3 \\ 3x + 3y - 4z - 2t = 1 \\ 1x + 2y + 3z + 3t = -1 \end{cases} \quad \left(\begin{array}{cccc|c} 1 & 1 & -2 & 4 & 5 \\ 2 & 2 & -3 & 1 & 3 \\ 3 & 3 & -4 & -2 & 1 \\ 1 & 2 & 3 & 3 & -1 \end{array} \right)$$

$$\begin{cases} (L_2) \leftarrow (L_2) - 2(L_1) \\ (L_3) \leftarrow (L_3) - 3(L_1) \\ (L_4) \leftarrow (L_4) - (L_1) \end{cases} \Rightarrow \left(\begin{array}{cccc|c} 1 & 1 & -2 & 4 & 5 \\ 0 & 0 & 1 & -7 & -7 \\ 0 & 0 & 2 & -14 & -14 \\ 0 & 1 & 5 & -1 & -6 \end{array} \right)$$

$$(L_2) \leftrightarrow (L_4) \Rightarrow \left(\begin{array}{cccc|c} 1 & 1 & -2 & 4 & 5 \\ 0 & 1 & 5 & -1 & -6 \\ 0 & 0 & 2 & -14 & -14 \\ 0 & 0 & 1 & -7 & -7 \end{array} \right)$$

Exemple

Exemple

$$(L_4) \leftarrow (L_4) - \frac{1}{2}(L_3) \quad \Rightarrow \quad \left(\begin{array}{cccc|c} 1 & 1 & -2 & 4 & 5 \\ 0 & 1 & -1 & -7 & -6 \\ 0 & 0 & 2 & -14 & -14 \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{array} \right)$$

Remarque

Numériquement, le codage du 0 posant des problèmes informatiques, il est difficile de s'assurer qu'un pivot est non nul. On utilisera donc la méthode du **pivot partiel**. Le pivot utilisé ne sera donc pas le premier nombre non nul d'une ligne, mais le plus grand élément d'une colonne (en valeur absolue). Si le pivot n'est pas sur la première ligne, on effectuera les échanges de lignes nécessaires. On s'affranchit ainsi de comparaisons à 0.

2.3 Matrice échelonnée

A la fin du pivot, on obtient une matrice de la forme :

$$\begin{pmatrix} \alpha & \beta & \beta & \beta & \beta \\ 0 & 0 & \alpha & \beta & \beta \\ 0 & 0 & 0 & \alpha & \beta \\ 0 & 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix} \quad \text{avec } \alpha \text{ non nul et } \beta \text{ réel quelconque.}$$

Définition

On dit d'une matrice qu'elle est échelonnée en ligne si :

1. une ligne est nulle, les suivantes le sont aussi ;
2. L_1, \dots, L_r désignent les lignes non nulles, $j(L_1), \dots, j(L_r)$ désignent la position des pivots dans ces lignes et $j(L_1) < \dots < j(L_r)$.

Exemple

Les matrices suivantes ne sont pas échelonnées :

$$\begin{pmatrix} 1 & 0 & 2 & 3 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 2 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix} \quad \begin{pmatrix} 1 & 0 & 2 & 3 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix} \quad \begin{pmatrix} 1 & 0 & 2 & 3 \\ 0 & 0 & 1 & 2 \\ 0 & 0 & 1 & 5 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}$$

Propriété

Le pivot de Gauss permet d'obtenir une matrice échelonnée en lignes.

Définition

Le rang d'une matrice échelonnée désigne le nombre de ses pivots (ce qui correspond aussi au nombre de lignes non nulles).

2.4 Matrices échelonnées réduites

On peut poursuivre le pivot en :

1. divisant les lignes non nulles par leur pivot, les pivot deviennent alors 1 ;

2. faisant apparaître des zéros au dessus des pivots.

Propriété

Toute matrice est équivalente en ligne à une et une seule matrice échelonnée réduite.

En conséquence, on peut définir le rang d'une matrice quelconque comme le rang de sa matrice échelonnée réduite en ligne.

On peut définir (le nombre) le rang d'un système comme le rang de la matrice de ses coefficients (A).

Remarque

Deux matrices équivalentes en ligne ont le même rang.

3 Implémentation de l'algorithme

3.1 Choix d'un type de données

On verra ultérieurement que la bibliothèque numpy permet de gérer plus aisément le calcul matriciel. Dans un premier temps, le système à résoudre sera mis sous forme matricielle afin que les valeurs puissent être stockées dans un tableau. On cherchera donc à résoudre le système suivant :

$$A \cdot X = B$$

La matrice $A \in \mathcal{M}_{n,n}(\mathbb{R})$ sera stockée dans un tableau de n lignes et n colonnes. Le vecteur B , second membre de l'équation, sera stocké dans un tableau de n lignes et une colonne.

3.2 Fonctions élémentaires

3.2.1 Recherche du pivot

Dans le cadre d'une résolution numérique, on utilise un pivot partiel.

python

On considère qu'on est à la ligne i . À la ligne i , les éléments compris entre les colonnes 0 et $i - 1$ sont théoriquement nuls. Initialement, le plus grand élément de la ligne est a priori en position i .

On cherche alors le plus grand élément, en valeur absolu de la ligne $i + 1$ à la ligne n (n exclus en Python).

On renvoie enfin l'indice du pivot.

3.2.2 Échange de lignes

L'échange de lignes peut être nécessaire pour réordonner les lignes de la matrice si le pivot de la ligne considéré est plus petit que le pivot d'une des lignes suivantes.

python

Remarque

En python, le passage des objets se faisant par référence, il n'est pas nécessaire de retourner une liste.

3.2.3 Transvection de lignes

python

3.2.4 Phase de remontée : résolution du système

Une fois toutes les transvections réalisées, on est en présence d'une matrice échelonnée T . Le système a donc été mis sous la forme $T \cdot X = Y$. On va donc résoudre le système en partant «du bas».



3.3 Algorithme complet



3.4 Résolution de systèmes linéaires avec Numpy

Il est possible d'utiliser la bibliothèque Numpy pour résoudre le système $A \cdot X = B$. Pour cela, les matrices A et B peuvent être mises sous la forme d'une liste de liste.



```
A=[[1,2,3],[4,5,6],[7,8,9]]  
B=[[1],[2],[3]]  
numpy.linalg.solve
```

Références

- [1] Adrien Petri, *Pivot de Gauss – Systèmes linéaires*, Notes de cours de TSI 1, Lycée Rouvière, Toulon.
- [2] Wack et Al., *Informatique pour tous en classes préparatoires aux grandes écoles*, Éditions Eyrolles.