Definitionen, Bemerkungen & Beispiele

Numerik HM1/2 · Kapitel 1-4

1 Kapitel 2: Rechnerarithmetik

1.1 Definition 2.1: Maschinenzahlen

Unter Normalisierung $m_1 \neq 0$ (falls $x \neq 0$):

$\mathbb{M} = \{x \in \mathbb{R} \mid x = 0.m_1 m_2 ... m_n \cdot B^{e-\text{ bias}}\} \cup \{0\}$

Wert: $x = \sum_{i=1}^{n} m_i \cdot B^{-i} \cdot B^e$

1.1.1 Vorgehen: Zahlensystem-Umwandlung

Schritt 1: Mantisse normalisieren ($0.m_1 m_2 ...$ mit $m_1 \neq 0$)

Schritt 2: Exponent bestimmen (Verschiebungen zählen)

Schritt 3: Wert berechnen: $\sum m_i \cdot B^{-i} \cdot B^e$

1.1.2 Beispiel 2.1a: Dezimalzahl

Gegeben: $x_1 = 0.2345 \times 10^3$

Schritt 1: Mantisse bereits normalisiert: 0.2345

Schritt 2: Exponent: $e = 3$

Schritt 3: Wert berechnen:

$$\begin{aligned} x_1 &= (2 \cdot 10^{-1} + 3 \cdot 10^{-2} + 4 \cdot 10^{-3} + 5 \cdot 10^{-4}) \cdot 10^3 \\ &= 2 \cdot 10^2 + 3 \cdot 10^1 + 4 \cdot 10^0 + 5 \cdot 10^{-1} \\ &= 200 + 30 + 4 + 0.5 = 234.5 \end{aligned}$$

1.1.3 Beispiel 2.1b: Binärzahl

Gegeben: $x_2 = 0.111 \times 2^3$

Schritt 1: Mantisse normalisiert: 0.111_2

Schritt 2: Exponent: $e = 3$

Schritt 3: Wert berechnen:

$$\begin{aligned} x_2 &= (1 \cdot 2^{-1} + 1 \cdot 2^{-2} + 1 \cdot 2^{-3}) \cdot 2^3 \\ &= 1 \cdot 2^2 + 1 \cdot 2^1 + 1 \cdot 2^0 \\ &= 4 + 2 + 1 = 7 \end{aligned}$$

1.1.4 Beispiel 2.1c: Hexadezimalzahl

Gegeben: $x_5 = 0.\text{AB3C9F} \times 16^4$, mit $A = 10, B = 11$

Schritt 1: Mantisse normalisiert: $0.\text{AB3C9F}_{16}$

Schritt 2: Exponent: $e = 4$

Schritt 3: Wert berechnen (Auszug):

$$\begin{aligned} x_5 &= (10 \cdot 16^{-1} + 11 \cdot 16^{-2} + 3 \cdot 16^{-3} + ...) \cdot 16^4 \\ &= 10 \cdot 16^3 + 11 \cdot 16^2 + 3 \cdot 16^1 + ... \\ &= 40960 + 2816 + 48 + ... = 43836.62... \end{aligned}$$

1.2 Definition 2.2: Fehler

Absoluter Fehler: $|\tilde{x} - x|$

Relativer Fehler: $\frac{|\tilde{x}-x|}{|x|}$ (falls $x \neq 0$)

1.2.1 Vorgehen: Fehlerberechnung

Schritt 1: Zahl auf n Stellen runden

Schritt 2: Absoluter Fehler: $|\tilde{x} - x|$

Schritt 3: Relativer Fehler: $\frac{|\tilde{x}-x|}{|x|}$

Schritt 4: Prüfen: $|\text{rd}(x) - x| \leq \frac{B}{2} \cdot B^{e-(n+1)}$

1.2.2 Beispiel 2.2: Rundungsfehler

Gegeben: $x = 180.1234567 = 0.1801234567 \times 10^3$

Auf $n = 7$ Stellen runden.

Schritt 1: Rundung auf 7 Stellen:

$$\text{rd}(x) = 0.1801235 \times 10^3$$

(8. Stelle ist $6 \geq 5 \rightarrow$ aufrunden)

Schritt 2: Absoluter Fehler:

$$\begin{aligned} |\text{rd}(x) - x| &= |0.1801235 - 0.1801234567| \times 10^3 \\ &= 0.0000000433 \times 10^3 \\ &= 0.433 \times 10^{-4} \end{aligned}$$

Schritt 3: Relativer Fehler:

$$\frac{|\text{rd}(x) - x|}{|}x| = \frac{0.433 \times 10^{-4}}{180.1234567} \approx 2.4 \times 10^{-7}$$

Schritt 4: Prüfung ($B = 10, e = 3, n = 7$):

$$\frac{B}{2} \cdot B^{e-(n+1)} = 5 \times 10^{3-8} = 0.5 \times 10^{-4}$$

$$0.433 \times 10^{-4} < 0.5 \times 10^{-4} \checkmark$$

1.3 Definition 2.3: Maschinengenauigkeit

$$\varepsilon_{\text{mach}} = \frac{1}{2} \cdot B^{1-n}$$

Maximaler relativer Rundungsfehler.

1.3.1 Vorgehen: Maschinengenauigkeit

Schritt 1: Mantissenlänge n bestimmen

Schritt 2: Basis B identifizieren

Schritt 3: Formel anwenden: $\varepsilon_{\text{mach}} = \frac{1}{2} \cdot B^{1-n}$

Schritt 4: Bei IEEE: hidden bit beachten!

1.3.2 Beispiel 2.3a: IEEE Double Precision

Gegeben: IEEE-754 Double Precision

Schritt 1: Mantissenlänge bestimmen:

- 52 Bit gespeichert
- 1. 1 hidden bit
- $\to n = 53$

Schritt 2: Basis: $B = 2$ (binär)

Schritt 3: Formel anwenden:

$$\begin{aligned}\varepsilon_{\text{mach}} &= \frac{1}{2} \cdot 2^{1-53} \\ &= \frac{1}{2} \cdot 2^{-52} \\ &= 2^{-53}\end{aligned}$$

Schritt 4: Dezimal umrechnen:

$$\varepsilon_{\text{mach}} \approx 1.110223 \times 10^{-16}$$

1.4 Definition 2.4: Konditionszahl

Absolute: $\kappa = |f'(x)|$

Relative: $\kappa_{\text{rel}} = \frac{|x \cdot f'(x)|}{|f(x)|}$

2 Kapitel 3: Nullstellenprobleme

2.1 Definition 3.1: Fixpunkt

x^* heißt **Fixpunkt** von F, falls:

$$F(x^*) = x^*$$

2.1.1 Vorgehen: Fixpunktform

Schritt 1: Nullstellenproblem $f(x) = 0$ gegeben

Schritt 2: Nach x auflösen: $F(x) = x$

Schritt 3: Mehrere Formen möglich!

Schritt 4: Konvergenz prüfen: $|F'(x^*)| < 1$

2.1.2 Beispiel 3.1: Fixpunktform

Gegeben: $p(x) = x^3 - x + 0.3 = 0$

Schritt 1: Nullstellenproblem identifiziert

Schritt 2: Umformen nach x:

Variante A: $x^3 - x + 0.3 = 0$

$$\to x = x^3 + 0.3$$

$$\to F(x) = x^3 + 0.3$$

Variante B: $x^3 = x - 0.3$

$$\to x = \sqrt[3]{x - 0.3}$$

$$\to F(x) = \sqrt[3]{x - 0.3}$$

Schritt 3: Beide Formen sind gültig

Schritt 4: Konvergenz prüfen (Variante A):

$$F'(x) = 3x^2$$

Bei $x^* \approx 0.339$: $|F'(0.339)| = 3 \cdot 0.339^2 \approx 0.34 < 1$ ✓

2.1.3 Vorgehen: Fixpunktiteration

Schritt 1: Fixpunktform $x = F(x)$ aufstellen

Schritt 2: Startwert x_0 wählen

Schritt 3: Iterieren: $x_{n+1} = F(x_n)$

Schritt 4: Konvergenz prüfen: $|F'(x^*)| < 1$

Schritt 5: Abbruch bei $|x_{n+1} - x_n| < \varepsilon$

2.1.4 Beispiel 3.2: Fixpunktiteration

Gegeben: $F(x) = x^3 + 0.3$, Startwert $x_0 = 0$

Schritt 1: Fixpunktform bereits gegeben

Schritt 2: Startwert: $x_0 = 0$

Schritt 3: Iteration durchführen:

$$x_1 = F(x_0) = 0^3 + 0.3 = 0.3$$

$$x_2 = F(x_1) = 0.3^3 + 0.3 = 0.027 + 0.3 = 0.327$$

$$x_3 = F(x_2) = 0.327^3 + 0.3 \approx 0.335$$

$$x_4 = F(x_3) = 0.335^3 + 0.3 \approx 0.338$$

$$x_5 = F(x_4) \approx 0.339$$

Schritt 4: Konvergenz (siehe Beispiel 3.1): ✓

Schritt 5: $|x_5 - x_4| \approx 0.001 \longrightarrow$ Abbruch bei $\varepsilon = 0.01$

Fixpunkt: $x^* \approx 0.339$

2.2 Newton-Verfahren

$$x_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)}{f'(x_n)}$$

2.2.1 Vorgehen: Newton-Verfahren

Schritt 1: Funktion $f(x)$ und Ableitung $f'(x)$ bestimmen

Schritt 2: Startwert x_0 wählen (nahe Nullstelle)

Schritt 3: Iterieren: $x_{n+1} = x_n - \frac{f(x_n)}{f'(x_n)}$

Schritt 4: Konvergenz prüfen: $\frac{|f(x) \cdot f''(x)|}{|f'(x)|^2} < 1$

Schritt 5: Abbruch bei $|f(x_n)| < \varepsilon$ oder $|x_{n+1} - x_n| < \varepsilon$

Schritt 6: Quadratische Konvergenz bei einfachen Nullstellen

2.2.2 Beispiel 3.4: Newton für $x^2 = 2$

Gegeben: $f(x) = x^2 - 2$, Startwert $x_0 = 1$

Schritt 1: Funktionen bestimmen:

$$f(x) = x^2 - 2$$

$$f'(x) = 2x$$

$$f''(x) = 2$$

Schritt 2: Startwert: $x_0 = 1$

Schritt 3: Iteration:

$$x_1 = x_0 - \frac{x_0^2 - 2}{2x_0} = 1 - \frac{1-2}{2} = 1.5$$

$$x_2 = 1.5 - \frac{1.5^2 - 2}{2 \cdot 1.5} = 1.5 - \frac{0.25}{3} \approx 1.4167$$

$$x_3 = 1.4167 - \frac{1.4167^2 - 2}{2 \cdot 1.4167} \approx 1.4142$$

Schritt 4: Konvergenzprüfung bei $x \approx 1.414$:

$$\frac{|f(x) \cdot f''(x)|}{|f'(x)|^2} = \frac{|(x^2-2) \cdot 2|}{|2x|^2} \approx \frac{0}{8} < 1$$

Schritt 5: $|f(x_3)| = |1.4142^2 - 2| \approx 0.0002 < \varepsilon$

Schritt 6: $\sqrt{2} \approx 1.4142$ (quadratische Konvergenz!)

3 Kapitel 4: Lineare Gleichungssysteme

3.1 Definition 4.1: Dreiecksmatrizen

Untere: $l_{ij} = 0$ für $j > i$

Obere: $r_{ij} = 0$ für $i > j$

Normiert: Diagonale = 1

3.1.1 Vorgehen: Gauss-Elimination

Schritt 1 - Vorwärtselimination:
- Zeile 2: − Vielfaches von Zeile 1
- Zeile 3: − Vielfaches von Zeile 1
- Dann weiter mit Zeile 3: − Vielfaches von Zeile 2

Schritt 2: Ergebnis ist obere Dreiecksmatrix

Schritt 3 - Rückwärtseinsetzen:
- x_n aus letzter Zeile
- x_{n-1} aus vorletzter (mit x_n)
- Weiter bis x_1

3.1.2 Beispiel 4.1: Gauss 3×3 System

Gegeben:

$$\begin{aligned} x_1 + 2x_2 + 3x_3 &= 6 \\ 2x_1 + 5x_2 + 2x_3 &= 4 \\ 6x_1 - 3x_2 + x_3 &= 2 \end{aligned}$$

Schritt 1a: Eliminiere x_1 aus Zeile 2: Zeile 2 − 2 · Zeile 1:

$$\begin{aligned} (2 - 2 \cdot 1)x_1 + (5 - 2 \cdot 2)x_2 + (2 - 2 \cdot 3)x_3 &= 4 - 2 \cdot 6 \\ 0x_1 + x_2 - 4x_3 &= -8 \end{aligned}$$

Schritt 1b: Eliminiere x_1 aus Zeile 3: Zeile 3 − 6 · Zeile 1:

$$0x_1 - 15x_2 - 17x_3 = -34$$

Schritt 1c: Eliminiere x_2 aus Zeile 3: Zeile 3 − (-15) · neue Zeile 2:

$$0x_1 + 0x_2 - 77x_3 = -154$$

Schritt 2: Obere Dreiecksform erreicht:

$$\begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 0 & 1 & -4 \\ 0 & 0 & -77 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 6 \\ -8 \\ -154 \end{pmatrix}$$

Schritt 3 - Rückwärts:

$$x_3 = \frac{-154}{-77} = 2$$

$$x_2 = \frac{-8 + 4 \cdot 2}{1} = 0$$

$$x_1 = \frac{6 - 2 \cdot 0 - 3 \cdot 2}{1} = 0$$

Lösung: $(x_1, x_2, x_3) = (0, 0, 2)$

3.1.3 Vorgehen: LR-Zerlegung

Schritt 1: Gauss-Elimination durchführen

Schritt 2: Multiplikatoren in $\boldsymbol{L}$ speichern

Schritt 3: Resultat ist $\boldsymbol{R}$

Schritt 4 - Lösen:
- $\boldsymbol{L}\boldsymbol{y} = \boldsymbol{b}$ (Vorwärts)
- $\boldsymbol{R}\boldsymbol{x} = \boldsymbol{y}$ (Rückwärts)

3.1.4 Beispiel 4.2: LR-Zerlegung

Gegeben: System aus Beispiel 4.1

Schritt 1: Gauss durchgeführt (siehe 4.1)

Schritt 2: Multiplikatoren sammeln:
- Zeile 2: Faktor war 2
- Zeile 3: Faktor war 6, dann −15

$$\boldsymbol{L} = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 2 & 1 & 0 \\ 6 & -15 & 1 \end{pmatrix}$$

Schritt 3: Resultat nach Gauss:

$$R = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 0 & 1 & -4 \\ 0 & 0 & -77 \end{pmatrix}$$

Schritt 4: Lösen (für $b = \begin{pmatrix} 6 \\ 4 \\ 2 \end{pmatrix}$):

Vorwärts ($Ly = b$):

$$y_1 = 6$$

$$2y_1 + y_2 = 4 \to y_2 = -8$$

$$6y_1 - 15y_2 + y_3 = 2 \to y_3 = -154$$

Rückwärts ($Rx = y$): wie in 4.1

3.1.5 Vorgehen: QR (Gram-Schmidt)

Schritt 1: Spalten $a_1, a_2, ...$ von A

Schritt 2: $u_1 = \frac{a_1}{\|a_1\|}$

Schritt 3: Für $i = 2, ..., n$:
- $v_i = a_i - \sum_{j=1}^{i-1} (a_i^T u_j) u_j$
- $u_i = \frac{v_i}{\|v_i\|}$

Schritt 4: $Q = [u_1 \mid ... \mid u_n]$

Schritt 5: $R = Q^T A$

3.1.6 Beispiel 4.3: QR für 2×2

Gegeben: $A = \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 4 & 2 \end{pmatrix}$

Schritt 1: Spalten:

$$a_1 = \begin{pmatrix} 3 \\ 4 \end{pmatrix}, \quad a_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \end{pmatrix}$$

Schritt 2: Ersten orthonormalen Vektor:

$$\|a_1\| = \sqrt{3^2 + 4^2} = 5$$

$$u_1 = \frac{1}{5} \begin{pmatrix} 3 \\ 4 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0.6 \\ 0.8 \end{pmatrix}$$

Schritt 3: Zweiten Vektor orthogonalisieren:

$$a_2^T u_1 = 1 \cdot 0.6 + 2 \cdot 0.8 = 2.2$$

$$v_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \end{pmatrix} - 2.2 \begin{pmatrix} 0.6 \\ 0.8 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \end{pmatrix} - \begin{pmatrix} 1.32 \\ 1.76 \end{pmatrix}$$

$$v_2 = \begin{pmatrix} -0.32 \\ 0.24 \end{pmatrix}$$

$$\|v_2\| = \sqrt{0.32^2 + 0.24^2} = 0.4$$

$$u_2 = \frac{1}{0.4} \begin{pmatrix} -0.32 \\ 0.24 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -0.8 \\ 0.6 \end{pmatrix}$$

Schritt 4: $Q = \begin{pmatrix} 0.6 & -0.8 \\ 0.8 & 0.6 \end{pmatrix}$

Schritt 5:

$$R = Q^T A = \begin{pmatrix} 0.6 & 0.8 \\ -0.8 & 0.6 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 4 & 2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 5 & 2.2 \\ 0 & 0.4 \end{pmatrix}$$

3.1.7 Vorgehen: Jacobi-Verfahren

Schritt 1: Zerlegung: $A = L + D + R$

Schritt 2: Startvektor $x^{(0)}$ wählen

Schritt 3: Für jede Komponente i:

$$x_i^{(k+1)} = \frac{b_i - \sum_{j \neq i} a_{ij} x_j^{(k)}}{a_{ii}}$$

Schritt 4: Alle gleichzeitig berechnen

Schritt 5: Konvergenz: Matrix diagonaldominant?

Schritt 6: Abbruch: $\|x^{(k+1)} - x^{(k)}\| < \varepsilon$

3.1.8 Beispiel 4.4: Jacobi-Iteration

Gegeben:

$$4x_1 + x_2 = 5$$
$$x_1 + 3x_2 = 7$$

Start: $x^{(0)} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix}$

Schritt 1: Zerlegung erkannt

Schritt 2: Startwert: $x^{(0)} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix}$

Schritt 3+4: Erste Iteration ($k = 0$):

$$x_1^{(1)} = \frac{5 - 1 \cdot 0}{4} = 1.25$$

$$x_2^{(1)} = \frac{7 - 1 \cdot 0}{3} = 2.33$$

Iteration 2 ($k = 1$):

$$x_1^{(2)} = \frac{5 - 1 \cdot 2.33}{4} = 0.67$$

$$x_2^{(2)} = \frac{7 - 1 \cdot 1.25}{3} = 1.92$$

Iteration 3 ($k = 2$):

$$x_1^{(3)} = \frac{5 - 1 \cdot 1.92}{4} = 0.77$$

$$x_2^{(3)} = \frac{7 - 1 \cdot 0.67}{3} = 2.11$$

Schritt 5: Diagonaldominanz: $|4| > |1|$ ✓, $|3| > |1|$ ✓

Schritt 6: Konvergiert gegen $(1, 2)$

3.1.9 Vorgehen: Gauß-Seidel

Wie Jacobi, aber in Schritt 3:

Für Komponente i:
- Nutze **neue** $x_j^{(k+1)}$ für $j < i$
- Nutze **alte** $x_j^{(k)}$ für $j > i$

Sequentiell von oben nach unten!

Meist schnellere Konvergenz.

3.1.10 Beispiel 4.5: Gauß-Seidel

Gegeben: System aus 4.4

Start: $x^{(0)} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix}$

Iteration 1 ($k = 0$):

$$x_1^{(1)} = \frac{5 - 1 \cdot 0}{4} = 1.25$$

$$x_2^{(1)} = \frac{7 - 1 \cdot 1.25}{3} = 1.92$$

(nutzt neues $x_1^{(1)}$!)

Iteration 2 ($k = 1$):

$$x_1^{(2)} = \frac{5 - 1 \cdot 1.92}{4} = 0.77$$

$$x_2^{(2)} = \frac{7 - 1 \cdot 0.77}{3} = 2.08$$

Iteration 3 ($k = 2$):

$$x_1^{(3)} = \frac{5 - 1 \cdot 2.08}{4} = 0.73$$

$$x_2^{(3)} = \frac{7 - 1 \cdot 0.73}{3} = 2.09$$

Vergleich: Schnellere Konvergenz als Jacobi!

Lösung: $(1, 2)$

3.1.11 Definition 4.6: Eigenwert

$$\boldsymbol{A} \cdot \boldsymbol{v} = \lambda \cdot \boldsymbol{v}$$

$\lambda \in \mathbb{C}$ = Eigenwert, $\boldsymbol{v} \neq \boldsymbol{0}$ = Eigenvektor

3.1.12 Vorgehen: Eigenwerte (2×2)

Schritt 1: $\boldsymbol{A} = \begin{pmatrix} a & b \\ c & d \end{pmatrix}$

Schritt 2: Charakteristisches Polynom:

$$p(\lambda) = \lambda^2 - (a + d)\lambda + (ad - bc)$$

Schritt 3: Lösen: $\lambda_{1,2} = \ldots$

Schritt 4: Für jeden λ: $(\boldsymbol{A} - \lambda \boldsymbol{I})\boldsymbol{v} = \boldsymbol{0}$

3.1.13 Beispiel 4.7: Eigenwerte 2×2

Gegeben: $\boldsymbol{A} = \begin{pmatrix} 4 & 1 \\ 2 & 3 \end{pmatrix}$

Schritt 1: Matrix identifiziert: $a = 4, b = 1, c = 2, d = 3$

Schritt 2: Charakteristisches Polynom:

$$\begin{aligned} p(\lambda) &= \lambda^2 - (4 + 3)\lambda + (4 \cdot 3 - 1 \cdot 2) \\ &= \lambda^2 - 7\lambda + 10 \end{aligned}$$

Schritt 3: Nullstellen (pq-Formel):

$$\lambda_{1,2} = \frac{7}{2} \pm \sqrt{\left(\frac{7}{2}\right)^2 - 10}$$

$$\lambda_{1,2} = \frac{7}{2} \pm \sqrt{(2.25)} = \frac{7}{2} \pm \frac{3}{2}$$

$$\lambda_1 = 5, \quad \lambda_2 = 2$$

Schritt 4: Eigenvektor zu $\lambda_1 = 5$:

$$(\boldsymbol{A} - 5\boldsymbol{I})\boldsymbol{v} = \begin{pmatrix} -1 & 1 \\ 2 & -2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} v_1 \\ v_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix}$$

$$\to -v_1 + v_2 = 0 \to \boldsymbol{v}_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \end{pmatrix}$$

Eigenvektor zu $\lambda_2 = 2$:

$$(\boldsymbol{A} - 2\boldsymbol{I})\boldsymbol{v} = \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 2 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} v_1 \\ v_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix}$$

$$\to 2v_1 + v_2 = 0 \to \boldsymbol{v}_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ -2 \end{pmatrix}$$

3.1.14 Vorgehen: Potenzmethode

Schritt 1: Startvektor $\boldsymbol{v}^{(0)}$ wählen (zufällig)

Schritt 2: Iteration:

$$\boldsymbol{w}^{(k)} = \boldsymbol{A}\boldsymbol{v}^{(k-1)}$$

Schritt 3: Normieren:

$$\boldsymbol{v}^{(k)} = \frac{\boldsymbol{w}^{(k)}}{\|}\boldsymbol{w}^{(k)}\|$$

Schritt 4: Eigenwert approximieren:

$$\lambda \approx \left(\boldsymbol{v}^{(k)}\right)^T \boldsymbol{A}\boldsymbol{v}^{(k)}$$

Konvergiert zum betragsmäßig größten EW.

3.1.15 Beispiel 4.8: Potenzmethode

Gegeben: $\boldsymbol{A} = \begin{pmatrix} 4 & 1 \\ 2 & 3 \end{pmatrix}$, Start: $\boldsymbol{v}^{(0)} = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix}$

Iteration 1:

Schritt 2: $\boldsymbol{w}^{(1)} = \begin{pmatrix} 4 & 1 \\ 2 & 3 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 4 \\ 2 \end{pmatrix}$

Schritt 3: $\|\boldsymbol{w}^{(1)}\| = \sqrt{16 + 4} = \sqrt{20} \approx 4.47$

$$\boldsymbol{v}^{(1)} = \frac{\begin{pmatrix} 4 \\ 2 \end{pmatrix}}{4.47} \approx \begin{pmatrix} 0.89 \\ 0.45 \end{pmatrix}$$

Iteration 2:

Schritt 2: $\boldsymbol{w}^{(2)} = \begin{pmatrix} 4 & 1 \\ 2 & 3 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0.89 \\ 0.45 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 4.01 \\ 3.13 \end{pmatrix}$

Schritt 3: $\|\boldsymbol{w}^{(2)}\| \approx 5.08$

$$\boldsymbol{v}^{(2)} \approx \begin{pmatrix} 0.79 \\ 0.62 \end{pmatrix}$$

Iteration 3: $\boldsymbol{v}^{(3)} \approx \begin{pmatrix} 0.71 \\ 0.71 \end{pmatrix}$

Schritt 4: Eigenwert (nach Konvergenz):

$$\begin{aligned} \lambda &= \boldsymbol{v}^T \boldsymbol{A}\boldsymbol{v} \\ &= \begin{pmatrix} 0.71 \\ 0.71 \end{pmatrix}^T \begin{pmatrix} 4 & 1 \\ 2 & 3 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 0.71 \\ 0.71 \end{pmatrix} \\ &\approx 5 \end{aligned}$$

Ergebnis: Größter EW $\lambda_1 = 5$ (vgl. 4.7)