# 作业七:矩阵分解与方程求解报告

学号: 202128013229021

姓名: 刘炼

## 程序说明

运行环境

python 3.6 及以上

依赖包

numpy

argparse

## 程序介绍

一个综合程序,根据选择参数的不同,实现不同的矩阵分解;在此基础上,实现 Ax=b方程组的求解,以及计算A的行列式;

下面给出不同矩阵分解的计算以及利用此实现的方程求解

## LU 分解

## 分解条件和思路

分解的基本条件如下:

- 1. 是一个square matrix  $(n \times n)$
- 2. 在分解过程中,任意主元都不能为0

具体计算思路为:将输入矩阵A利用初等变换的方式进行部分主元的高斯消去法,在变换的同时将执行列取代运算的乘数记录。最终根据运算,得到分解后的结果可以表示为PA=LU。在具体计算过程中,首先要判断输入矩阵是否是方阵,并且在计算过程中,要判定是否有为0的主元,如果存在,则报错。

## 分解后矩阵的性质

分解得到的矩阵P, L, U 分别具有如下的性质:

1. L 为下三角矩阵, 且U为上三角矩阵, P为行变换矩阵

```
2. 对于i = 1, ..., n, L_{ii} = 1且U_{ii} \neq 03. PA = LU,其中A为输入矩阵。
```

## 方程求解

对于原来的方程Ax = b, 其中PA = LU, 所以原来的方程可以变为LUx = Pb, 进一步推导为:

$$y = Ux = L^{-1}Pb$$
  $x = U^{-1}y$ 

由于L和U分别为下三角矩阵和上三角矩阵,对于y进行计算不需要再进行高斯消去操作,可以很简便进行计算。

## 实例

```
[[11. 10. 4. 18. 18.]
 [5. 2. 8. 16. 14.]
 [16. 13. 0. 2. 14.]
 [11. 15. 19. 8. 2.]
[ 9. 11. 8. 17. 8.]]
   -----the LU FACTORIZATION RESULTS------
[[0. 0. 1. 0. 0.]
[0. 0. 0. 1. 0.]
 [0. 1. 0. 0. 0.]
[0. 0. 0. 0. 1.]
[1. 0. 0. 0. 0.]]
[[ 1.
        0. 0.
                    0. 0.
[ 0.688 1.
                         0.
 [ 0.312 -0.34 1.
                    0.
 [ 0.562 0.608 -0.246 1.
[ 0.688 0.175 0.046 0.905 1.
        13. 0. 2. 14. ]
6.062 19. 6.625 -7.625]
[[16.
[ 0.
       0. 14.464 17.629 7.031]
 [ 0.
              0. 16.18 6.492]
 [ 0.
        0.
             0.
                     0. 3.509]]
[ 0.
original results
[[16. 13. 0. 2. 14.]
 [11. 15. 19. 8. 2.]
 [5. 2. 8. 16. 14.]
[ 9. 11. 8. 17. 8.]
[11. 10. 4. 18. 18.]]
 -----b----
[ 5. 14. 15. 17. 14.]
  ----x: equation results---
[ 8.307 -5.942 0.465 1.521 -3.122]
```

```
matrix[[i,j], :] = matrix[[j,i], :]
    return matrix
def PLUFactorization(matrix):
    1.1.1
   :param matrix: 输入矩阵
   :param P L U: 分解得到的输出矩阵
   U = np.copy(matrix)
   row_len=U.shape[0]
   col_len=U.shape[1]
   assert (row_len == col_len), "PLU Factorization needs
a square matrix" # 检测是否为一个方阵
    P, L = np.eye(row_len), np.zeros((row_len,row_len)) #
P 初始化一个 I 矩阵, L矩阵初始化为一个0矩阵
   for i in range(row_len):
       j = np.argmax(abs(U[i:, i])) + i # 找到当前列的从i
开始的最大值,然后进行交换
       U = change_{row}(U, i, j)
       P = change_row(P, i, j) # 同样的,需要对P和L 进行行交
换
       L = change_row(L, i, j)
       pivot = U[i,i] # 保存主元
       assert(pivot!=0), "Error! a zero pivot is
encoutered" # 检测是否存在主元为0 的错误
       for k in range(i,row_len):
           L[k,i] = U[k,i]/pivot
       for m in range(i+1, row_len):
           for n in range(i+1,row_len):
               U[m,i] = 0
               U[m,n] -= L[m,i] * U[i, n]
   return P, L, U # 这里的matrix经过变化,已经处理为U
```

## QR分解

#### 分解思路和条件

OR分解的基本条件如下:

1. 列向量无关的 $m \times n$ 矩阵

具体计算思路为: 利用施密特正交化构建正交矩阵 $Q \in R^{m \times n}$ ,具体为从输入矩阵A的 $\mathbf{n}$ 个列 $A_{*i} \in R^{m \times 1}$ 中构建正交基,具体构建方法如下:

$$q_1=rac{a_1}{v_1}$$
 
$$q_k=rac{a_k-\sum_{i=1}k-1 < q_i|a_k>q_i}{v_k}$$
 其中有 $v_1=||a_1||$ 且 $v_k=||a_k-\sum_{i=1}k-1 < q_i|a_k>q_i||$ 

#### 分解后矩阵的性质

1. A = QR, 其中A为输入矩阵 2. Q为正交矩阵,R为上三角矩阵

#### 方程求解

对于原来的方程Ax = b, 其中A = QR, 所以原来的方程可以变为QRx = b, 进一步推导为:

$$y = Rx = Q^T b$$
(由于 $Q$ 是正交矩阵,所以 $Q^{-1} = Q^T$ ) $x = R^{-1}y$ 

由于R为上三角矩阵,对于y进行计算不需要再进行高斯消去操作,可以很简便进行计算。

## 实例

```
def check(matrix):# 判断QR分解的矩阵条件: 所有列线性无关, 即矩阵

秩=列数

rank = matrix_rank(matrix)

n=matrix.shape[-1]

return rank == n
```

```
def QRFactorization(matrix): # QR 分解

:::

:param matrix: 输入矩阵
:return: 正交矩阵Q, 上三角矩阵R

:::

assert(check(matrix)), "Error! Not all columns in
matrix are linearly independent"

Q = np.zeros_like(matrix)

for index, a in enumerate(matrix.T):

u = np.copy(a)

for i in range(index):

u=u-np.dot(np.dot(Q[:, i].T,a), Q[:, i]) #减去

分量

norm_factor=norm(u) #归一化

Q[:, index]=u/norm_factor

R = np.dot(Q.T,matrix)

return Q, R
```

## Householder 约减

#### 分解思路和条件

具体计算思路为: 利用householder变换构建正交矩阵 $Q \in R^{m \times n}$ ,具体为从输入矩阵A的n个列 $A_{*i} \in R^{m \times 1}$ 中构建正交基,其中householder变换构造如下:

$$u=a-||a||_2 imes e_1$$
  $R=I-2rac{uu^T}{u^Tu}$  其中的 $a$ 为每个子矩阵的第一列

对于所有的R 进行累计,得到

$$P = R_{n-1} \dots R_1$$

## 分解后矩阵的性质

- 1. PA = T, 其中A为输入矩阵
- 2. P为正交矩阵, T为上三角矩阵

## 方程求解

对于原来的方程Ax = b, 其中PA = T,所以原来的方程可以变为 PAx = Pb = Tx,进一步推导为:

$$y=Tx=Pb$$
(由于 $P$ 是正交矩阵,所以 $P^{-1}=P^T$ )  $x=T^{-1}y$ 

由于T为上三角矩阵,对于y进行计算不需要再进行高斯消去操作,可以很简便进行计算。

```
[[11. 10. 4. 18. 18.]
 [ 11. 10. 4. 18. 18.]
[ 5. 2. 8. 16. 14.]
[ 16. 13. 0. 2. 14.]
[ 11. 15. 19. 8. 2.]
[ 9. 11. 8. 17. 8.]]
      -----the HOUSEHOLDER REDUCTION RESULTS------
[[ 0.448  0.203  0.651  0.448  0.366]
 [-0.126 -0.466 -0.431 0.678 0.35 ]
 [-0.098 0.832 -0.383 0.371 -0.117]
   0.537 0.117 -0.451 -0.404 0.576]
 [ 0.697 -0.188 -0.202  0.198 -0.631]]
[ 24.576 24.088 14.852 22.42 23.844] [ -0. 6.226 11.444 0.795 -10.658] [ -0. -0. 12.388 11.781 4.348] [ 0. 0. -0. 17.174 8.773] [ 0. 0. -0. 0. 2.447]
                                                    2.447]]
original results
[[11. 10. 4. 18. 18.]
[5. 2. 8. 16. 14.]
 [16. 13. -0. 2. 14.]
[11. 15. 19. 8. 2.]
[ 9. 11. 8. 17. 8.]]
[ 5. 14. 15. 17. 14.]
     -----x: equation results-----
[ 8.307 -5.942 0.465 1.521 -3.122]
```

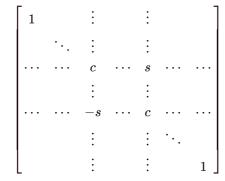
```
def HouseholderReduction(matrix):# Householder 约减 (为了简
便,这里只考虑实数,所以设u为1)
   1.1.1
   :param matrix: 输入矩阵
   :return: 正交矩阵P, 上三角矩阵T
   row_len=matrix.shape[0]
   P = np.identity(row_len)
   T = np.copy(matrix)
   for index in range(row_len - 1):
       a = T[index:, index]
       u = np.copy(a)
       norm_factor=norm(a) # 归一化因子
       u[0] -= norm_factor # 矩阵列向量-归一化因子*单位向量(变
换构造第一二步)
       u = u.reshape(-1, 1)
       R=2.0*(np.dot(u, u.T))/(u.T.dot(u))
       I = np.identity(row_len)
       I[index:, index:] -= R # 得到对应的R 变为 I-
2uu.T/u.Tu
       T = np.dot(I, T)
       P = np.dot(I, P)
   return P, T
```

## Givens 约减

## 分解思路和条件

具体计算思路为: 利用givens变换构建正交矩阵 $Q \in R^{m \times n}$ ,具体为从输入矩阵A的n个列 $A_{*i} \in R^{m \times 1}$ 中构建正交基,其中旋转矩阵变换构造如下:

对于向量
$$x=(x_1\;x_2\ldots\;x_n)^T$$
当实现 $i,j$ 两行的旋转时,对应的旋转矩阵为



其中分别为第i,j行进行处理。

## 分解后矩阵的性质

- 1. PA = T, 其中A为输入矩阵
- 2. P为正交矩阵, T为上三角矩阵

#### 方程求解

对于原来的方程Ax = b, 其中PA = T,所以原来的方程可以变为 PAx = Pb = Tx,进一步推导为:

$$y=Tx=Pb$$
(由于 $P$ 是正交矩阵,所以 $P^{-1}=P^T$ ) $x=T^{-1}y$ 

由于T为上三角矩阵,对于y进行计算不需要再进行高斯消去操作,可以很简便进行计算。

## 实例

```
[[11. 10. 4. 18. 18.]
[ 5. 2. 8. 16. 14.]
[16. 13. 0. 2. 14.]
[11. 15. 19. 8. 2.]
[ 9. 11. 8. 17. 8.]
       ----the GIVENS REDUCTION RESULTS-----
[[ 0.448  0.203  0.651  0.448  0.366]
 [-0.126 -0.466 -0.431 0.678 0.35 ]
 [-0.098 0.832 -0.383 0.371 -0.117]
 [ 0.537 0.117 -0.451 -0.404 0.576]
 [ 0.697 -0.188 -0.202  0.198 -0.631]]
[[ 24.576 24.088 14.852 22.42 23.844]
 [ -0. 6.226 11.444 0.795 -10.658]
[ -0. -0. 12.388 11.781 4.348]
[ -0. 0. 0. 17.174 8.773]
[ -0. 0. 0. -0. 2.447]]
original results
[[11. 10. 4. 18. 18.]
 [ 5. 2. 8. 16. 14.]
[ 16. 13. -0. 2. 14.]
[ 11. 15. 19. 8. 2.]
 [ 9. 11. 8. 17. 8.]]
     ----b--
[ 5. 14. 15. 17. 14.]
       ----x: equation results--
  8.307 -5.942 0.465 1.521 -3.1221
```

## 程序代码

```
def GivensReduction(matrix): # givens 分解
    :param matrix: 输入矩阵
    :return: 正交矩阵P, 上三角矩阵T
    1.1.1
    row_len = matrix.shape[0]
    col_len = matrix.shape[1]
    P = np.identity(row_len)
   T = np.copy(matrix)
    for i in range(row_len):
        for j in range(col_len-1,i,-1):
            val_a=T[i,i]
           val_b=T[j,i]
           mag = np.sqrt( (val_a ** 2 + val_b ** 2) )
            c = val_a / mag
            s = val_b / mag
            Pi = np.eye(row_len)
            Pi[i, i] = c
           Pi[j, j] = c
            Pi[i, j] = s
            Pi[j, i] = -s
            P = np.dot(Pi,P)
           T = np.dot(Pi,T)
    return P, T
```

## URV 分解

具体计算思路为:将矩阵分解为 $A = URV^T$ ,其中

- U的前r列时R(A)的标准正交基
- U的后(m-r)列是 $N(A^T)$ 的标准正交基
- V的前r列是 $R(A^T)$ 的标准正交基
- V的后(n-r)列是N(A)的标准正交基

而实际上,标准正交基的求解可以通过Householder 约减来实现(同QR分解和 Givens 约减),故思路较为简单。

#### 分解后矩阵的性质

- 1.  $A = URV^T$ , 其中A为输入矩阵
- 2. U和V为正交矩阵,R可以表示为 $\begin{pmatrix} C_{r\times r} & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$ ,其中r为矩阵A 的秩

#### 方程求解

对于原来的方程Ax=b, 其中 $A=URV^T$ ,所以原来的方程可以变为  $URV^Tx=b$ 

在这种情况下,很难对原方程进行优化,故不考虑在URV分解下的方程求解,只采用QR分解情况下的思路进行方程求解。

## 实例

```
def GivensReduction(matrix): # givens 分解
```

```
:param matrix: 输入矩阵
:return: 正交矩阵P, 上三角矩阵T
row_len = matrix.shape[0]
col_len = matrix.shape[1]
P = np.identity(row_len)
T = np.copy(matrix)
for i in range(row_len):
    for j in range(col_len-1,i,-1):
        val_a=T[i,i]
       val_b=T[j,i]
       mag = np.sqrt( (val_a ** 2 + val_b ** 2) )
        c = val_a / mag
        s = val_b / mag
        Pi = np.eye(row_len)
        Pi[i, i] = c
        Pi[j, j] = c
        Pi[i, j] = s
        Pi[j, i] = -s
        P = np.dot(Pi,P)
       T = np.dot(Pi,T)
return P, T
```

## 方程求解

在上面已经总结了不同分解下的方程求解,这里不再给出具体计算的说明,只给 出相应的代码:

```
import numpy as np
def lowertrinv(L): # 由于L矩阵的对角线元素均为1, 所以直接利用其来
实现约减 (下三角矩阵)
   N = L.shape[0]
   Linv = np.eye(N)
   matrix = np.copy(L)
   for i in range(N-1):
       for j in range(i+1, N):
           Linv[j, :] -= matrix[j,i] * Linv[i, :]
   return Linv
def uppertrinv(U): # 由于U的对角元素并不为1, 所以要先做归一化处理
(上三角矩阵求逆)
   N = U.shape[0]
   Uinv = np.eye(N)
   matrix = np.copy(U)
   for i in range(N):
       Uinv[i, :] = Uinv[i, :]/matrix[i, i]
       matrix[i, :] = matrix[i, :]/matrix[i,i]
   for i in range(N-1, -1, -1):
```

```
for j in range(i-1, -1, -1):
            Uinv[j, :] -= matrix[j,i] * Uinv[i, :]
    return Uinv
def solve(matrixs, data, factorization_type):
   if(factorization_type=='LU'):
        P, L, U = matrixs
        Linv = lowertrinv(L)
        Uinv = uppertrinv(U)
        y = np.dot(P, data)
        tmp = Linv.dot(y)
        x = Uinv.dot(tmp)
        return x
    elif(factorization_type=='QR'):
        Q, R = matrixs
        tmp = np.dot(Q.T, data)
        Rinv = uppertrinv(R)
        x = Rinv.dot(tmp)
        return x
   else:
        P, T = matrixs
        tmp = P.dot(data)
        Tinv = uppertrinv(T)
        x = Tinv.dot(tmp)
        return x
```

## 行列式计算

根据行列式计算规则,只有方阵存在行列式的值,并且,对于方阵A,其行列式结果可以表示为:

$$det(A) = det(BC)$$
 当满足 $A = BC$ 时

且对于上三角矩阵和下三角矩阵,其行列式的结果就等于对角线元素相乘,根据分析,实际上可以使用LU分解来求解A的行列式,并且根据PA = LU分解,其中P的值只能为1或-1,只需要计算其逆序对的数量。且L的主对角元素均为1,所以只需要计算U的主对角元素乘积和P的逆序对,故有:

$$det(A) = \delta(P)det(U)$$
  
其中 $PA = LU$ 

#### 程序代码

```
import numpy as np
def upperdet(matrix): # 计算上三角矩阵的行列式值,也就是对角线元
素相乘
   :param matrix: 输入矩阵
   :param det: 行列式的值
   det = 1
   N = matrix.shape[0]
   for i in range(N):
       det = det * matrix[i,i]
   return det
def ReversedOrder(matrix): # 计算逆序对的数量,并根据结果,输出1
或者-1
   :param matrix: 输入矩阵
   :param num: 逆序对数量对应的最终结果
   orders = np.where(matrix==1)[1]
   count = 0
   for i, num in enumerate(orders):
       for j in range(i):
           if num < orders[j]:</pre>
               count += 1
    return -1 if count%2 else 1
```

## 程序主要文件和运行

- decomposition.py 包含了所给出的五种不同的矩阵分解函数
- solution.py 给出了利用矩阵分解结果求解方程的函数
- determinant.py 包含利用LU分解求解行列式的函数
- produce.py 随机生成给定维度的矩阵数据

- main.py 主程序,利用argparse来打包参数
- run.sh 执行的sh 文件,可以直接通过sh 文件运行程序

#### 一个代表性的执行过程为:

```
python main.py -f LU --solve --determinant
```

其中-f LU表示采用LU分解, --solve表示激活方程求解, --determinant 表示激活行列式计算。

## 主函数代码

```
import numpy as np
import argparse
from decomposition import PLUFactorization,
QRFactorization, HouseholderReduction, GivensReduction,
URVFactorization
from solution import solve
from determinant import upperdet, ReversedOrder
Factorization_Choices =['LU', 'QR', 'Householder',
'Givens', 'URV']
parser = argparse.ArgumentParser(description='Args for
matrix factorization')
parser.add_argument('-f', '--factorization', type=str,
default='URV', choices=Factorization_Choices)
parser.add_argument('-p','--path', type=str,
default='matrix.csv')
parser.add_argument('--solve', default=False,
action='store_true')
parser.add_argument('-d', '--data', type=str,
default='data.csv')
parser.add_argument('--determinant', default=False,
action='store_true')
args = parser.parse_args()
np.set_printoptions(precision=3, suppress=True) #设置小数位
置为3位
def read_data(path):
   matrix = np.loadtxt(path)
    return matrix
if __name__ == '__main__':
    matrix = read_data(args.path)
    print(matrix)
    if(args.factorization == 'LU'):
        matrixs = PLUFactorization(matrix)
```

```
print('----the LU FACTORIZATION RESULTS----
       print('P')
       print(matrixs[0])
       print('L')
       print(matrixs[1])
       print('U')
       print(matrixs[2])
       print('original results')
       print(np.dot(matrixs[1],matrixs[2]))
   elif(args.factorization == 'QR'):
       matrixs = QRFactorization(matrix)
       print('----the QR FACTORIZATION RESULTS----
----')
       print('Q')
       print(matrixs[0])
       print('R')
       print(matrixs[1])
       print('original results')
       print(np.dot(matrixs[0],matrixs[1]))
   elif(args.factorization == 'Householder'):
       matrixs = HouseholderReduction(matrix)
       print('-----the HOUSEHOLDER REDUCTION
RESULTS----')
       print('P')
       print(matrixs[0])
       print('T')
       print(matrixs[1])
       print('original results')
       print(np.dot(matrixs[0].T,matrixs[1]))
   elif(args.factorization == 'Givens'):
       matrixs = GivensReduction(matrix)
       print('----the GIVENS REDUCTION RESULTS----
----')
       print('P')
       print(matrixs[0])
       print('T')
       print(matrixs[1])
       print('original results')
       print(np.dot(matrixs[0].T,matrixs[1]))
   else:
       matrixs = URVFactorization(matrix)
       print('----the URV FACTORIZATION RESULTS----
----')
       print('U')
       print(matrixs[0])
       print('R')
       print(matrixs[1])
       print('V')
       print(matrixs[2])
       print('original results')
```

```
print(np.dot(np.dot(matrixs[0],matrixs[1]),
matrixs[2].T))
   if args.solve:
       data = read_data(args.data)
       print('----')
       print(data)
       if(args.factorization == 'URV'):
           matrixs = HouseholderReduction(matrix)
       x = solve(matrixs, data, args.factorization)
       print('-----x: equation results-----')
       print(x)
   if args.determinant:
       assert(matrix.shape[0] == matrix.shape[1]),
"Error! Only square matrix available for determinant
computation"
       if(args.factorization == 'LU'):
           P, _, U = matrixs
       else:
           P, _, U = PLUFactorization(matrix)
       delta = ReversedOrder(P)
       det = delta * upperdet(U)
       print('----')
       print(det)
```