**MNUM – Projekt 2.15**

Zadanie 1  
Obliczanie wartości własnych macierzy nieosobliwych metodą rozkładu QR w wersji z przesunięciami oraz bez przesunięć

Idea pojedynczego kroku metody bez przesunięć (przekształcenie do ):

Ponieważ jest ortogonalna, więc

Macierz jest macierzą przekształconą przez podobieństwo, więc ma te same wartości własne. Można pokazać, że dla macierzy symetrycznej , macierz będzie zbiegać do macierzy diagonalnej .

Algorytm metody z przesunięciami

Za przyjmuje się bliższą wartość własną podmacierzy z prawego dolnego rogu macierzy . Po wyzerowaniu wszystkich elementów ostatniego wiersza poza ostatnim elementem (diagonalnym) postępujemy analogicznie z macierzą zmniejszoną do wymiarowości .

Kod algorytmu metody QR bez przesunięć (plik: eigval.m):

function [ w, iteracje, success ] = eigval( A ,tol, imax )

%eigval Oblicznie wartosci wlasnych metoda rozkladu QR bez przesuniec

% tol - tolerancja

% imax - maksymalna liczba iteracji

% w - wektor wartości własnych

% iteracje - liczba iteracji potrzebnych do znalezienia wartości własnych

% success - czy udało się uzyskać wynik zanim liczba iteracji

% przekroczyła imax

success = 1;

z = zeros(size(A,1));

for i= 1:imax

b = A - diag(diag(A));

if (b == z) | max(max(abs(b))) < tol

break;

end

[q, r] = qrmgs(A);

A = r \* q; %macierz przekształcona

end

if i == imax

success = 0;

disp('Uwaga: osiągnięto imax');

end

w =diag(A);

iteracje = i;

end

Kod algorytmu metody QR z przesunięciami (plik: eigvalS.m):

function [ eigenvalues, iteracje,success] = eigvalS( A, tol, imax )

%eigvalS Oblicznie wartosci wlasnych metoda rozkladu QR z przesunieciami

% tol - tolerancja

% imax - maksymalna liczba iteracji

success = 1;

n=size(A,1);

eigenvalues = diag(zeros(n));

INITIALsubmatrix = A; %macierz początkowa (oryginalna)

iteracje = 0;

for k = n:-1:2

DK = INITIALsubmatrix; %macierz startowa dla jednej wart. własnej

i = 0;

while i<= imax & max(abs(DK(k,1:k-1)))>tol

DD = DK(k-1:k,k-1:k); %macierz 2x2 prawego dolnego rogu

[ev1,ev2]=quadpolynroots(1,-(DD(1,1)+DD(2,2)), DD(2,2)\*DD(1,1)-DD(2,1)\*DD(1,2));

%najbliższa DK(k,k) wartość własna podmacierzy DD

if abs(ev1 - DD(2,2)) < abs(ev2-DD(2,2))

shift = ev1;

else

shift = ev2;

end

DK = DK - eye(k)\*shift; %macierz przesunięta

[Q1,R1] = qrmgs(DK); %faktoryzajca QR

DK = R1 \*Q1 +eye(k)\*shift; %macierz przekształcona

i = i+1;

iteracje = iteracje + 1;

end

if i >imax

success = 0;

disp('imax reached')

end

eigenvalues(k) = DK(k,k);

if k>2

INITIALsubmatrix = DK(1:k-1,1:k-1); %deflacja macierzy

else

eigenvalues(1) = DK(1,1); %ostatnia wartość własna

end

end

end

Kod algorytmu rozkładu QR - zmodyfikowany algorytm Grama-Shmidta (plik: qrmgs.m):

function [ Q, R ] = qrmgs( A )

%qrmgs Rozkład QR zmodyfikowanym algorytmem Grama-Schmidta

[m, n] = size(A);

Q = zeros(m,n);

R = zeros(n,n);

d = zeros(1,n);

%Rozkład QR

for i =1:n

Q(:,i) = A(:,i);

R(i,i) = 1;

d(i) = Q(:,i)' \* Q(:,i);

for j = i+1:n

R(i,j) = (Q(:,i)'\*A(:,j))/d(i);

A(:,j) = A(:,j) - R(i,j)\*Q(:,i);

end

end

%Normowanie układu

for i=1:n

dd = norm(Q(:,i));

Q(:,i) = Q(:,i)/dd;

R(i,i:n) = R(i,i:n) \*dd;

end

end

Kod algorytmu oblicznia pierwiastków równania kwadratowego (plik: quadpolynroots.m) :

function [ x1, x2 ] = quadpolynroots( a,b,c )

%quadpolynroots Funkcja zwracajaca pierwistki wielomianu stopnia 2

% a,b,c - wspolczynniki wielomianu

l1 = -b + sqrt(b\*b - 4\*a\*c);

l2 = -b - sqrt(b\*b - 4\*a\*c);

%wybieramy licznik o wiekszym module

if abs(l1) > abs(l2)

licznik = l1;

else

licznik = l2;

end

x1 = licznik/(2\*a);

%drugi pierwiastek obliczmy ze wzorów Viete'a

x2 = ((-b)/a) - x1;

end

Wyniki:

Badane będzie 30 losowych macierzy o rozmiarach 5x5, 10x10 i 20x20. Maksymalna liczba iteracji (imax) została ustawiona na 10 000.

Rozmiar 5x5

W tym przypadku wszystkie metody były zbieżne.

Średnie liczby iteracji:

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Macierz i metoda | Średnia liczba iteracji | Liczba nieudanych prób |
| Macierz symetryczna  Algorytm bez przesunięć | 413.8000 | 0 |
| Macierz symetryczna  Algorytm z przesunięciami | 7.3667 | 0 |
| Macierz niesymetryczna  Algorytm z przesunięciami | 9.4000 | 0 |

Rozmiar 10x10

W jednym przypadku metoda bez przesunięć okazała się rozbieżna. Algorytm z przesunięciami był zbieżny dla wszystkich macierzy

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Macierz i metoda | Średnia liczba iteracji | Liczba nieudanych prób |
| Macierz symetryczna  Algorytm bez przesunięć | 808.3667 | 1 |
| Macierz symetryczna  Algorytm z przesunięciami | 14.3333 | 0 |
| Macierz niesymetryczna  Algorytm z przesunięciami | 20.5667 | 0 |

Rozmiar 20x20

W jednym przypadku metoda bez przesunięć okazała się rozbieżna. Algorytm z przesunięciami był zbieżny dla wszystkich macierzy

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Macierz i metoda | Średnia liczba iteracji | Liczba nieudanych prób |
| Macierz symetryczna  Algorytm bez przesunięć | 1.9205e+03 | 1 |
| Macierz symetryczna  Algorytm z przesunięciami | 27.6333 | 0 |
| Macierz niesymetryczna  Algorytm z przesunięciami | 43.9667 | 0 |

Wnioski:

Rozkład QR w wersji bez przesunięć wymaga znacznie większej liczby iteracji, nie nadaję się także do macierzy niesymetrycznych. Algorytm w wersji z przesunięciami wymaga mniejszego nakładu obliczeniowego, mimo większej złożoności każdego kroku, gdyż jest szybciej zbieżny. Jest on ponadto bardziej uniwersalny ze względu na obsugę macierzy niesymetrycznych.