Sisteme liniare - metode directe

Radu T. Trîmbiţaş

18 martie 2015

1 Eliminare gaussiană

Să considerăm sistemul liniar cu n ecuaţii şi n necunoscute

$$Ax = b, \tag{1}$$

unde $A \in \mathbb{K}^{n\times n}$, $b \in \mathbb{K}^{n\times 1}$ sunt date, iar $x \in \mathbb{K}^{n\times 1}$ trebuie determinat, sau scris pe componente

$$\left\{\begin{array}{cc} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 + \cdots + a_{1n}x_n = b_1 & (E_1) \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 + \cdots + a_{2n}x_n = b_2 & (E_2) \\ \vdots & \vdots \\ a_{n1}x_1 + a_{n2}x_2 + \cdots + a_{nn}x_n = b_n & (E_n) \end{array}\right. \tag{2}$$

1.1 Eliminare gaussiană cu pivotare parţială

Metoda este dată de algoritmul 1.

1.2 Eliminare gaussiană cu pivot scalat pe coloană

O tehnică care micşorează eroarea şi preîntâmpină anularea flotantă este *pivotarea parţială cu pivot scalat pe coloană.* Definim la început un factor de scară pentru fiecare linie

$$s_i = \max_{j=\overline{1,n}} |a_{ij}| \text{ or } s_i = \sum_{j=1}^{n} |a_{ij}|.$$

Algoritmul 1 Rezolvă sistemul $Ax = b$ prin metoda eliminării a lui Gauss

Intrare: Matricea extinsă $A = (a_{ij}),\ i = \overline{1,n},\ j = \overline{1,n+1}$

Ieşire: Soluţiile $x_1, \ldots, x_n$ sau un mesaj de eroare

{Eliminare}
for $i := 1$ **to** $n-1$ **do**
  Fie p cel mai mic întreg $i \le p \le n$, $a_{p_i} \neq 0$ şi $|a_{pi}| = \max_{i \le j \le n} |a_{ji}|$
  if $\nexists\ p$ **then**
    mesaj ('$\nexists$ soluţie unică'); STOP
  end if
  if $p \neq i$ **then**
    $(E_p) \leftrightarrow (E_i)$
  end if
  for $j := i+1$ **to** n **do**
    $m_{ji} := a_{ji}/a_{ii}$;
    $(E_j - m_{ji}E_i) \rightarrow (E_j)$;
  end for
end for
if $a_{mn} = 0$ **then**
  mesaj ('$\nexists$ soluţie unică'); STOP
end if
{Substituţie inversă}
$x_n := a_{n,n+1}/a_{nn}$;
for $i := n-1$ **downto** 1 **do**
  $x_i = \left[a_{i,n+1} - \sum_{j=i+1}^{n} a_{ij}x_j \right] / a_{ii}$;
end for
Returnează $(x_1, \ldots, x_n)$ {succes} STOP.

Dacă există un i a.î. $s_i = 0$, matricea este singulară. Paşii următori vor stabili interschimbările care se vor face. La al i-lea pas vom găsi cel mai mic întreg p, $i \leq p \leq n$, a.î.

$$\frac{|a_{pi}|}{s_p} = \max_{i \leq j \leq n} \frac{|a_{ji}|}{s_j}$$

şi apoi, $(E_i) \leftrightarrow (E_p)$. Scalarea ne garantează că cel mai mare element din fiecare coloană are înainte de comparaţiile necesare pentru schimbare mărimea relativă 1. Scalarea se realizează doar în comparaţii, nu efectiv în matrice, astfel că împărţirea cu factorul de scalare nu produce nici o eroare de rotunjire.

2 Descompunere (factorizare) LUP

Ideea din spatele descompunerii LUP este de a găsi 3 matrice pătratice de ordinul n L, U şi P astfel încât

$$PA = LU \tag{3}$$

unde

- L este o matrice triunghiulară inferior;
- U este o matrice triunghiulară superior;
- P este o matrice de permutare.

Tripletul (L,U,P) se va numi **descompunere LUP** a matricei A. Orice matrice nesingulară posedă o astfel de descompunere.

Sistemul

$$Ax = b \tag{4}$$

se poate rezolva astfel

$$Ax = b \Longleftrightarrow LUx = Pb \Longleftrightarrow Ly = Pb \wedge Ux = y, \tag{5}$$

deoarece

$$Ax = P^{-1}LUx = P^{-1}Ly = P^{-1}Pb = b. \tag{6}$$

Având descompunerea LUP sistemul se poate rezolva cu algoritmul 2.

Algoritmul 2 Rezolvă sistemul $Ax = b$ având descompunerea LUP

Intrare: Matricele L, U, vectorul b, vectorul de permutare π, toate de dimensiune n

Ieşire: Soluţiile $x_1, \ldots, x_n$

for $i := 1$ **to** n **do**
  $y_i := b_{\pi[i]} - \sum_{j=1}^{i-1} l_{ij} y_j$;
end for
for $i := n$ **downto** 1 **do**
  $x_i = \left[y_i - \sum_{j=i+1}^{n} u_{ij} x_j \right] / u_{ii}$;
end for

Observaţie. Am presupus că matricea P este reprezentată prin vectorul π.

Procedura care urmează (algoritmul 3) calculează descompunerea LUP. Ea reprezintă P ca un vector π, iar L şi U sunt calculate în locul lui A, adică la terminare

$$a_{ij} = \begin{cases} l_{ij}, & \text{pentru } i > j, \\ u_{ij}, & \text{pentru } i \geq j. \end{cases}$$

Algoritmul 3 Descompunere LUP

Intrare: Matricea A, de dimensiune n

Ieşire: Matricele L, U şi P, toate de dimensiune n

$U := A$; $L = I$;
for $k := 1$ **to** $m - 1$ **do**
  alege $i \geq k$ care maximizează $|u_{ik}|$;
  $l_{k,1:k-1} \leftrightarrow l_{i,1:k-1}$;
  $p_{k,:} \leftrightarrow p_{i,:}$;
  for $j := k + 1$ **to** m **do**
    $\ell_{jk} := u_{jk}/u_{kk}$;
    $u_{j,k:m} := u_{j,k:m} - \ell_{jk} u_{k,k:m}$;
  end for
end for

Exemplu. Să se calculeze descompunerea LUP a matricei

```
A =
    2.0000  0       2.0000  0.6000
    3.0000  3.0000 4.0000 -2.0000
    5.0000  5.0000 4.0000  2.0000
   -1.0000 -2.0000 3.4000 -1.0000
```

Calculele decurg astfel

```
>> [l,u,p]=lup(A)
```

interschimb liniile 1 şi 3

```
A =

    5.0000  5.0000 4.0000  2.0000
    3.0000  3.0000 4.0000 -2.0000
    2.0000  0       2.0000  0.6000
   -1.0000 -2.0000 3.4000 -1.0000
```

calculez complementul Schur

```
A =
    5.0000  5.0000  4.0000  2.0000
    0.6000  3.0000  4.0000 -2.0000
    0.4000  0       2.0000  0.6000
   -0.2000 -2.0000  3.4000 -1.0000

A =
    5.0000  5.0000  4.0000  2.0000
    0.6000  0       1.6000 -3.2000
    0.4000 -2.0000  0.4000 -0.2000
   -0.2000 -1.0000  4.2000 -0.6000
```

interschimb liniile 2 şi 3

```
A =
   5.0000  5.0000 4.0000  2.0000
```

```
   0.4000 -2.0000 0.4000 -0.2000
   0.6000  0      1.6000 -3.2000
  -0.2000 -1.0000 4.2000 -0.6000
```

calculez complementul Schur

```
A =
    5.0000  5.0000 4.0000  2.0000
    0.4000 -2.0000 0.4000 -0.2000
    0.6000  0      1.6000 -3.2000
   -0.2000  0.5000 4.2000 -0.6000

A =
    5.0000  5.0000 4.0000  2.0000
    0.4000 -2.0000 0.4000 -0.2000
    0.6000  0      1.6000 -3.2000
   -0.2000  0.5000 4.0000 -0.5000
```

interschimb liniile 3 şi 4

```
A =
    5.0000  5.0000 4.0000  2.0000
    0.4000 -2.0000 0.4000 -0.2000
   -0.2000  0.5000 4.0000 -0.5000
    0.6000  0      1.6000 -3.2000
```

calculez complementul Schur

```
A =
    5.0000  5.0000 4.0000  2.0000
    0.4000 -2.0000 0.4000 -0.2000
   -0.2000  0.5000 4.0000 -0.5000
    0.6000  0      0.4000 -3.2000

A =
    5.0000  5.0000 4.0000  2.0000
    0.4000 -2.0000 0.4000 -0.2000
   -0.2000  0.5000 4.0000 -0.5000
```

```
    0.6000  0       0.4000 -3.0000
```

Rezultatele finale sunt

```
l =
    1.0000 0      0      0
    0.4000 1.0000 0      0
   -0.2000 0.5000 1.0000 0
    0.6000 0      0.4000 1.0000

u =
    5.0000  5.0000 4.0000  2.0000
    0      -2.0000 0.4000 -0.2000
    0       0      4.0000 -0.5000
    0       0      0      -3.0000
p =
    0 0 1 0
    1 0 0 0
    0 0 0 1
    0 1 0 0
```

verificare:

```
>> disp(l*u)

    5.0000  5.0000  4.0000  2.0000
    2.0000  0.0000  2.0000  0.6000
   -1.0000 -2.0000  3.4000 -1.0000
    3.0000  3.0000  4.0000 -2.0000

>> disp(p*A)

    5.0000  5.0000  4.0000  2.0000
    2.0000  0.0000  2.0000  0.6000
   -1.0000 -2.0000  3.4000 -1.0000
    3.0000  3.0000  4.0000 -2.0000
```

3 Descompunere (factorizare) Cholesky

O matrice hermitiană şi pozitiv definită se poate factoriza sub forma $A = LL^*$ sau $A = R^*R$, unde L este o matrice triunghiulară inferior, iar R este triunghiulară superior.

Pentru algoritm a se vedea notele de curs sau algoritmul 4.

Algoritmul 4 Descompunere Cholesky

Intrare: Matricea A, hermitiană şi pozitiv definită
Ieşire: Matricea R, triunghiulară superior

```
R := A;
for k := 1 to m do
   for j := k + 1 to m do
      R_{j,j:m} := R_{j,j:m} − R_{k,j:m} conj(R_{k,j}) / R_{k,k}
   end for
   R_{k,k:m} := R_{k,k:m} / sqrt(R_{k,k})
end for
```

$R := A$;
for $k := 1$ **to** m **do**
  for $j := k+1$ **to** m **do**
    $R_{j,j:m} := R_{j,j:m} - R_{k,j:m}\overline{R_{k,j}}/R_{k,k}$
  end for
  $R_{k,k:m} := R_{k,k:m}/\sqrt{R_{k,k}}$
end for

---

4 Probleme

Problema 1 *Implementaţi eliminarea gaussiană cu pivotare parţială sau scalată pe coloană (la alegere) în MATLAB.*

Problema 2 *Să se implementeze descompunerea LUP. Să se scrie rutine pentru rezolvarea unui sistem folosind descompunerea LUP.*

Problema 3 *Generaţi sisteme cu matrice aleatoare nesingulare ce au soluţia* $[1, \ldots, 1]^T$. *Rezolvaţi-le cu eliminare gaussiană şi descompunere LUP.*

Problema 4 *Să se scrie rutine pentru descompunerea Cholesky a unei matrice hermitiene şi pozitiv definite şi rezolvarea unui sistem cu o astfel de matrice prin descompunere Cholesky. Testaţi rutinele pentru matrice generate aleator şi sisteme cu matrice aleatoare, dar cu soluţie cunoscută.*

Problema 5 *Rezolvaţi sistemul*

$$\begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 & & \dots & 1 \\ -1 & 1 & 0 & & \dots & 1 \\ -1 & -1 & 1 & & \dots & 1 \\ -1 & -1 & -1 & 1 & \dots & 1 \\ \vdots & & \ddots & & \ddots & \vdots \\ -1 & \dots & -1 & -1 & & 1 \end{bmatrix} x = \begin{bmatrix} 2 \\ 1 \\ 0 \\ -1 \\ \vdots \\ -n+2 \end{bmatrix}$$

prin descompunere LUP şi QR. Ce se observă? Explicaţi.

5 Probleme suplimentare

Problema 6 *Scrieţi rutine pentru descompunerea LUP in care permutarea sa se facă fizic sau logic (cu vectori de permutări) şi comparaţi timpii de execuţie pentru sistme cu dimensiunea între 100 şi 300.*