

Numerické řešení soustav lineárních rovnic

středa 13. listopadu 2019 11:57



linear_pri...

Numerické řešení soustav lineárních rovnic

Mirko Navara

<http://cmp.felk.cvut.cz/~navara/>

Centrum strojového vnímání, katedra kybernetiky FEL ČVUT
Karlovo náměstí, budova G, místnost 104a

<http://math.feld.cvut.cz/nemecek/nummet.html>

5. prosince 2018

Úloha: Hledáme řešení soustavy *n* lineárních rovnic o *n* neznámých x_1, x_2, \dots, x_n

$$\begin{aligned} a_{1,1}x_1 + a_{1,2}x_2 + \dots + a_{1,n}x_n &= b_1 \\ a_{2,1}x_1 + a_{2,2}x_2 + \dots + a_{2,n}x_n &= b_2 \\ &\vdots \\ a_{n,1}x_1 + a_{n,2}x_2 + \dots + a_{n,n}x_n &= b_n \end{aligned}$$

Maticový tvar:

$$A \cdot x = b,$$

kde $A = (a_{i,j})_{i,j=1,\dots,n}$ je (regulární) matice soustavy,
 $b = (b_1, b_2, \dots, b_n)^T$ vektor pravých stran,
 $x = (x_1, x_2, \dots, x_n)^T$ vektor neznámých.

Cramerovo pravidlo má velkou výpočetní složitost a numerické chyby.
Druhy problémů

→ výpočet detektovatelnosti je si

Matice soustavy:

- phné, ne příliš velké,
- řidké, často velmi velké (mj. u kubického splnu).

Špatná podmíněnost

Lze použít 0 -

$$x = A^{-1}b$$

→ špatně se zjištý, ještě

Malá změna koeficientů soustavy nebo pravé strany může způsobit velkou změnu řešení.

Zpětné dosazení (nepřesného) řešení x_c dá **reziduum řešení**:

$$r = b - Ax_c,$$

→ řešení dosazit, a s počítáním rozdíl pí

Pokud matice A^{-1} má velké prvky, může být reziduum r malé, i když se vektor x_c podstatně liší od přesného řešení \bar{x} .

$$\begin{aligned} r &= A\bar{x} - Ax_c = A(\bar{x} - x_c), \\ \bar{x} - x_c &= A^{-1}r. \end{aligned}$$

Jouli prvky matice A^{-1} velké, může i malá složka vektoru r způsobit velký rozdíl $\bar{x} - x_c$.

Malé reziduum nezaruje malou chybu řešení!

Takové soustavy nazýváme **špatně podmíněné**.

Příklad: Soustava

$$\begin{aligned} 2x + 6y &= 8 \\ 2x + 6.00001y &= 8.00001 \end{aligned}$$

má řešení $x = 1, y = 1$;
minimální změna koeficientů na soustavu

$$\begin{array}{rcl} 2x + & 6y & = 8 \\ & 2x + 5.99999y & = 8.00002 \end{array}$$

změně řešení na $x = 10, y = -2$.

Inverzní matice k oběma soustavám mají prvky řádové 10^5 , což ukazuje na jejich špatnou podmíněnost.
Rovnice v soustavách jsou „skoro lineárně závislé“.

Zdroje chyb

- neprécnosť koeficientů soustavy a pravé strany,
- zaokrouhlovací chyby při výpočtu,
- chyby metody – nekonečný proces je nahrazen konečným počtem kroků (u iteračních metod).

Princip metody

Po konečném počtu kroků vedou (teoreticky) k přesnému řešení.

Gaušsova eliminace (GEM)

Postupné úpravy maticy soustavy pomocí ekvivalentních úprav (nemění řešení soustavy) na horní trojúhelníkovou matici, ze které lze zpětným dosazováním snadno získat řešení.

Rozšířená matice soustavy má prvky

$$\begin{aligned} a_{i,j}^{(0)} &= a_{i,j}, \quad \text{pro } i = 1, 2, \dots, n, j = 1, 2, \dots, n; \\ a_{i,n+1}^{(0)} &= b_i, \quad \text{pro } i = 1, 2, \dots, n. \end{aligned}$$

Soustavu

$$\begin{aligned} a_{1,1}^{(0)}x_1 + a_{1,2}^{(0)}x_2 + \cdots + a_{1,n}^{(0)}x_n &= a_{1,n+1}^{(0)} \\ a_{2,1}^{(0)}x_1 + a_{2,2}^{(0)}x_2 + \cdots + a_{2,n}^{(0)}x_n &= a_{2,n+1}^{(0)} \\ &\vdots \\ a_{n,1}^{(0)}x_1 + a_{n,2}^{(0)}x_2 + \cdots + a_{n,n}^{(0)}x_n &= a_{n,n+1}^{(0)} \end{aligned}$$

převedeme povolenými úpravami na tvar

$$\begin{aligned} a_{1,1}^{(0)}x_1 + a_{1,2}^{(0)}x_2 + \cdots + a_{1,n}^{(0)}x_n &= a_{1,n+1}^{(0)} \\ a_{2,2}^{(1)}x_2 + \cdots + a_{2,n}^{(1)}x_n &= a_{2,n+1}^{(1)} \\ &\vdots \\ a_{n,n}^{(n-1)}x_n &= a_{n,n+1}^{(n-1)}, \end{aligned}$$

ze kterého zpětnou substitucí vypočítáme vektor řešení.

Pokud vyjde na diagonále nulový prvek, stačí provést **zaměnit s odpovídající složkou vektoru řešení**, resp. **sloupcem** v tom případě **musíme**

To lze, pokud je matice soustavy regulární.

Algoritmus:

Pro $k = 1, 2, \dots, n-1$, pro $i = k+1, k+2, \dots, n$ a $j = k+1, k+2, \dots, n+1$

$$a_{i,j}^{(k)} = a_{i,j}^{(k-1)} - \frac{a_{i,k}^{(k-1)}}{a_{k,k}^{(k-1)}} a_{k,j}^{(k-1)}.$$

Pokud po provedení **přímého chodu** je nějaký diagonální prvek $a_{i,i}^{(i-1)} = 0$ (resp. $|a_{i,i}^{(i-1)}| < \varepsilon$), matice soustavy je (resp. může být) singulární.

V opačném případě použijeme **zpětnou substituci**

$$x_i = \frac{1}{a_{i,i}^{(i-1)}} \left(a_{i,n+1}^{(i-1)} - \sum_{j=i+1}^n a_{i,j}^{(i-1)} x_j \right), \quad \text{pro } i = n, n-1, \dots, 1.$$

Výběr hlavního prvku

Pokud číslo na diagonále je v absolutní hodnotě malé, jeho malá změna vytvoří velkou změnu výsledku při dělení a rostou zaokrouhlovací chyby.

Proto v každém kroku eliminace vybereme na diagonálu koeficient s co největší absolutní hodnotou = **hlavní prvek (pivot)**.

GEM s výběrem hlavního prvku

- **úplným** – vybíráme z $(n-k)^2$ prvků zbylé čtvercové podmatice (výpočetně složitě),
- **sloupcovný** – vybíráme v rámci sloupců a pouze vyměňme řádky,
- **řádkový** – vybíráme v rámci řádku a vyměníme sloupeček (**i poradí neznámých!**).

Gaussova-Jordanova redukce

GEM může pokračovat eliminací prvků nad diagonálou.

Diagonální prvky lze převést na jednotky.

Sloupec pravých stran je pak vektor řešení.

Pro jedno použití je větší složitost, ale vyplatí se, pokud máme mnoho úloh lišících se pouze pravou stranou (např. výpočet inverzní matice, kdy řešíme soustavu lineárních rovnic současně pro n pravých stran, kde vycházíme z jednotkové matice).

Označme

$$\text{LU-rozklad}$$

$$L_1 = \begin{pmatrix} 1 & 0 & \dots & 0 \\ \frac{a_{2,1}}{a_{1,1}} & 1 & 0 & \dots \\ \frac{a_{3,1}}{a_{1,1}} & 0 & 1 & \dots \\ \vdots & \vdots & \ddots & \\ -\frac{a_{n,1}}{a_{1,1}} & 0 & \dots & 1 & 0 \end{pmatrix}$$

a vynásobme $L_1 \cdot A$. Dostaneme první přidruženou soustavu z GEM s vymurovaným prvním sloupcem podél diagonály. Pokračujeme:

$$A_0 = A, \quad A_{i+1} = L_{i+1} \cdot A_i \quad \text{pro } i = 0, 1, \dots, n-2,$$

kde

$$L_{i+1} = \begin{pmatrix} 1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & 1 & \dots & 0 \\ 0 & -\frac{a_{i+2,i+1}}{a_{i+1,i+1}} & \dots & \vdots \\ \vdots & \vdots & \vdots & 1 & 0 \\ 0 & 0 & -\frac{a_{n,i+1}}{a_{i+1,i+1}} & \dots & 0 & 1 \end{pmatrix}.$$

Po provedení $n-1$ maticových násobení máme

$$L_{n-1} \cdot L_{n-2} \cdots L_2 \cdot L_1 \cdot A = U,$$

kde matice U je horní trojúhelníková (=výsledek prvního chodu GEM) a $\bar{L} = L_{n-1} \cdot L_{n-2} \cdots L_2 \cdot L_1$ dolní trojúhelníková s jednotkami na diagonále.

$$\begin{aligned} \bar{L} \cdot A &= U, \\ \bar{A} &= \bar{L}^{-1} \cdot U = L \cdot U. \end{aligned}$$

\rightarrow složitost $O(n^3)$

Původní soustavu $Ax = L \cdot Ux = b$ nahradíme dvěma soustavami s trojúhelníkovými maticemi

$$Ly = b,$$

$$Ux = y,$$

3

(nebo $Ax = L \cdot Ux = Ly = b$),

které řešíme zpětnou substitucí.

Rozepsání součinu $L \cdot U$ dostaváme**Algoritmus:**Pro $r = 1, 2, \dots, n$

Když někde chybí programovat

$$u_{i,r} = a_{i,r} - \sum_{s=1}^{i-1} l_{i,s} a_{s,r} \quad \text{pro } i = 1, 2, \dots, r,$$

$$l_{i,r} = \frac{1}{u_{r,r}} (a_{i,r} - \sum_{s=1}^{r-1} l_{i,s} u_{s,r}) \quad \text{pro } i = r+1, r+2, \dots, n,$$

$$y_i = b_i - \sum_{s=1}^{i-1} l_{i,s} y_s \quad \text{pro } i = 1, 2, \dots, n,$$

$$x_i = \frac{1}{u_{i,i}} (y_i - \sum_{s=i+1}^n u_{i,s} x_s) \quad \text{pro } i = n, \dots, 2, 1.$$

Potřebujeme všechny prvky $u_{r,r} \neq 0$ (i během výpočtu) nemulové \Rightarrow výběr hlavního prvku (částečný); zmenší

se tam i zaokrouhlovací chyby.

Poznámka: Celý algoritmus můžeme realizovat „na místě“, v jediné čtvercové matici. Pro překrývající se diagonální prvky použijeme $u_{r,r}$, protože na diagonále matice \mathbf{L} jsou jedničky, které nepočítáme ani neukládáme.

Poznámka: Tato metoda je zvláště vhodná pro řadu úloh lišících se pouze pravými stranami.
Lze použít i výpočet inverzní matice \mathbf{A}^{-1} (ovšem větší složitost).

Výpočet inverzní matice

\mathbf{E} = jednotková matici

$\mathbf{A} \cdot \mathbf{A}^{-1} = \mathbf{E} \Rightarrow \mathbf{A}$ vynásoben j-tým sloupcem matice \mathbf{A}^{-1} je rovna j-tému sloupci jednotkové matice \mathbf{E} .

$\mathbf{x}_j = j$ -tý sloupec \mathbf{A}^{-1}

$\mathbf{e}_j = j$ -tý sloupec \mathbf{E}

$$\mathbf{A} \mathbf{x}_j = \mathbf{e}_j$$

Máme soustavu rovnic, kde \mathbf{x}_j je vektor neznámých.

Jednotlivé sloupce inverzní matice \mathbf{A}^{-1} dostaneme jako řešení soustavy pro různé pravé strany – sloupce matice \mathbf{E} .

Můžeme využít GEM pro jednu matici soustavy a několik pravých stran současně; stačí „prodloužit“ cyklus pro řádky rozšířené matici soustavy typu $(n \times 2n)$, tedy $j = k+1, k+2, \dots, 2n$ (viz Gaussova-Jordanova redukce).

Použití LU-rozkladu: $\mathbf{A} = \mathbf{L} \cdot \mathbf{U}$:

$$\mathbf{A}^{-1} = (\mathbf{L} \cdot \mathbf{U})^{-1} = \mathbf{U}^{-1} \cdot \mathbf{L}^{-1}.$$

Výpočet \mathbf{U}^{-1} a \mathbf{L}^{-1} je snadný, inverzní matici k trojúhelníkové je opět trojúhelníková.

Výpočet determinantu

Podle definice pouze pro velmi malé řady.

n	2	3	4	5	10	20	30
počet operací	4	18	96	600	36 288 000	$4 \cdot 8 \cdot 10^{19}$	$7,9 \cdot 10^{33}$

GEM: po eliminaci jako součin prvků na diagonále:

$$\det \mathbf{A} = \pm a_{1,1}^{(0)} a_{2,2}^{(1)} a_{3,3}^{(2)} \dots a_{n,n}^{(n-1)}$$

POZOR! Výměna řádků či sloupců (při výběru hlavního prvku) mění znaménko determinantu. (Stačí si pamatovat, že počet výměn byl sudý nebo lichý.)

LU-rozklad $\mathbf{A} = \mathbf{L} \cdot \mathbf{U}$:

$$\det \mathbf{A} = \det(\mathbf{L} \cdot \mathbf{U}) = \det \mathbf{L} \cdot \det \mathbf{U} = u_{1,1} u_{2,2} u_{3,3} \dots u_{n,n}.$$

(Jedná se o trojúhelníkové matice a \mathbf{L} má navíc na diagonále jednotky.)
Opět nutno ošetřit znaménko při výměnách řádků nebo sloupců.

4

Zpřesnění výsledků pomocí rezidua

Přesné řešení $\bar{\mathbf{x}}$ můžeme vyjádřit pomocí nepřesného řešení \mathbf{x}_c :

$$\bar{\mathbf{x}} = \mathbf{x}_c + \delta,$$

kde $\delta = (\delta_1, \delta_2, \dots, \delta_n)^T$ je **vektor oprav.**

$$\begin{aligned} \mathbf{A} \bar{\mathbf{x}} &= \mathbf{b} \\ \mathbf{A} (\mathbf{x}_c + \delta) &= \mathbf{b} \quad \text{nezávazně} \\ \mathbf{A} \mathbf{x}_c + \mathbf{A} \delta &= \mathbf{b} \\ \mathbf{A} \delta &= \mathbf{b} - \mathbf{A} \mathbf{x}_c = \mathbf{r} \end{aligned}$$

Vektor oprav je řešením stejně soustavy s pravou stranou nahrázenou reziduem \mathbf{r} .

Je-li reziduum podobně velké jako původní pravé strany, nemá smysl pokračovat.

Postup můžeme několikrát opakovat (je výhodné použít LU-rozklad) a získat další zpřesnění řešení.

$$\mathbf{x}_c^{(1)}, \mathbf{x}_c^{(2)}, \mathbf{x}_c^{(3)}, \dots$$

Iterační metody

Snaží se konstruovat posloupnosti vektorů, konvergující k přesnému řešení soustavy.

Normy vektoru a matic

$\mathbb{R}^n \dots n$ -rozměrný aritmetický vektorový prostor

$\mathbb{R}^{n,n} \dots$ prostor čtvercových matic řádu n

$\mathbf{o} \in \mathbb{R}^n \dots$ nulový vektor

$\mathbf{O} \in \mathbb{R}^{n,n} \dots$ nulová matice

$\mathbf{E} \in \mathbb{R}^{n,n} \dots$ jednotková matice

Definice: **Vektorová norma** je zobrazení $\|\cdot\|_v: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ splňující

• $\|\mathbf{x}\|_v \geq 0$, přičemž $\|\mathbf{x}\|_v = 0 \Leftrightarrow \mathbf{x} = \mathbf{o}$,

• $\|\mathbf{x}\|_v = |\mathbf{v}| \|\mathbf{x}\|_v$,

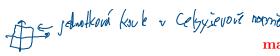
• $\|\mathbf{x} + \mathbf{y}\|_v \leq \|\mathbf{x}\|_v + \|\mathbf{y}\|_v$ (trojúhelníková nerovnost).

Příklad:

$$\|\mathbf{x}\|_v = \sqrt{\sum_{i=1}^n x_i^2}$$

Ano ✓ jednotková matice

- $\|\mathbf{x}\|_1 = \sqrt{\sum_{i=1}^n x_i^2}$
- $\|\mathbf{x}\|_r = \max_{i=1, \dots, n} |x_i|$
- $\|\mathbf{x}\|_\infty = \sum_{i=1}^n |x_i|$
- $\|\mathbf{x}\|_q = \left(\sum_{i=1}^n |x_i|^q \right)^{\frac{1}{q}}, \quad q \geq 1$



euklidovská

maximová, Čebyševova

součtová, „manhattanská“

společná, obecnější předchozích

Změna měřítka: Je-li $\|\cdot\|_v$ vektorová norma a $r > 0$, pak $\|\mathbf{x}\|_u = r \|\mathbf{x}\|_v$ je také vektorová norma.

Definice: Maticová norma je zobrazení $\|\cdot\|_M: \mathbb{R}^{n,n} \rightarrow \mathbb{R}$ splňující

- $\|\mathbf{B}\|_M \geq 0$, přičemž $\|\mathbf{B}\|_M = 0 \Leftrightarrow \mathbf{B} = \mathbf{O}$
- $\|c\mathbf{B}\|_M = |c| \|\mathbf{B}\|_M$
- $\|\mathbf{B} + \mathbf{C}\|_M \leq \|\mathbf{B}\|_M + \|\mathbf{C}\|_M$ (trojúhelníková nerovnost)
- $\|\mathbf{B} \cdot \mathbf{C}\|_M \leq \|\mathbf{B}\|_M \|\mathbf{C}\|_M$ (Schwarzova nerovnost)

Příklad:

- $\|\mathbf{B}\|_F = \sqrt{\sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n a_{i,j}^2}$ euklidovská, Frobeniova
- $\|\mathbf{B}\|_H = \max_{i=1, \dots, n} \sum_{j=1}^n |a_{i,j}|$ řádková → v každém řádku vezmout součet absolutních hodnot a vybrat
- $\|\mathbf{B}\|_S = \max_{j=1, \dots, n} \sum_{i=1}^n |a_{i,j}|$ sloupcová → -- Slopa'

Příklad: Co není maticová norma:

$$\|\mathbf{B}\|_C = \max_{i,j=1, \dots, n} |a_{ij}|$$

splňuje první 3 podmínky, ale nikoli Schwarzovu nerovnost:

$$\left\| \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \right\|_C = \left\| \begin{pmatrix} 2 & 2 \\ 2 & 2 \end{pmatrix} \right\|_C = 2 \not\leq \left\| \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \right\|_C \cdot \left\| \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \right\|_C = 1 \cdot 1 = 1.$$

Příklad: Pro libovolnou maticovou normu $\|\cdot\|_M$ je libovolná maticová norma.

$$\left\| \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}^k \right\|_M = 2^k \left\| \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \right\|_M \rightarrow \infty \text{ pro } k \rightarrow \infty,$$

$$\left\| \begin{pmatrix} \frac{1}{4} & \frac{1}{4} \\ \frac{1}{4} & \frac{1}{4} \end{pmatrix}^k \right\|_M = \frac{1}{2^k} \left\| \begin{pmatrix} \frac{1}{4} & \frac{1}{4} \\ \frac{1}{4} & \frac{1}{4} \end{pmatrix} \right\|_M \rightarrow 0 \text{ pro } k \rightarrow \infty.$$



Konvergence nekonečného součinu: Dosadime $\mathbf{B} := \mathbf{B}^k$ (k-tá mocnina matice \mathbf{B} , $k \in \mathbb{N}$):

$$\|\mathbf{B}^k \cdot \mathbf{C}\|_M \leq \|\mathbf{B}\|_M \|\mathbf{C}\|_M \Rightarrow \|\mathbf{B}^k \cdot \mathbf{C}\|_M \rightarrow 0 \text{ pro } \|\mathbf{B}\|_M < 1, k \rightarrow \infty.$$

Definice: Operátorová norma indukovaná vektorovou normou $\|\cdot\|_v$ je zobrazení, které matici $\mathbf{B} \in \mathbb{R}^{n,n}$ přiřazuje je nejménší číslo $\|\mathbf{B}\|_V$ takové, že

$$\forall \mathbf{x} \in \mathbb{R}^n : \|\mathbf{B}\mathbf{x}\|_v \leq \|\mathbf{B}\|_V \|\mathbf{x}\|_v. \quad (*)$$

Ekvivalentně

$$\|\mathbf{B}\|_V = \sup_{\mathbf{x} \neq \mathbf{0}} \frac{\|\mathbf{B}\mathbf{x}\|_v}{\|\mathbf{x}\|_v} = \sup_{\|\mathbf{u}\|_v=1} \|\mathbf{B}\mathbf{u}\|_v. \quad \left(\mathbf{u} = \frac{\mathbf{x}}{\|\mathbf{x}\|_v} \right).$$

Důsledek:

$$\|\mathbf{E}\|_V = 1.$$

Poznámka: Zde máme prostor konečné dimenze, kde sup je max.

Věta: Operátorová norma je maticová norma.

Důkaz: Vše triviální, kromě Schwarzovy nerovnosti. Pokud je $\|\mathbf{B}\mathbf{C}\|_V > 0$, je $\mathbf{y} := \mathbf{C}\mathbf{x} \neq 0$,

$$\begin{aligned} \|\mathbf{B}\mathbf{C}\|_V &= \max_{\mathbf{x} \neq \mathbf{0}} \frac{\|\mathbf{B}\mathbf{C}\mathbf{x}\|_v}{\|\mathbf{x}\|_v} = \max_{\mathbf{x} \neq \mathbf{0}} \left(\frac{\|\mathbf{B}\mathbf{y}\|_v \|\mathbf{C}\mathbf{x}\|_v}{\|\mathbf{x}\|_v} \right) \\ &\leq \left(\max_{\mathbf{y} \in \mathbb{R}^n, \mathbf{y} \neq \mathbf{0}} \frac{\|\mathbf{B}\mathbf{y}\|_v}{\|\mathbf{y}\|_v} \right) \left(\max_{\mathbf{x} \neq \mathbf{0}} \frac{\|\mathbf{C}\mathbf{x}\|_v}{\|\mathbf{x}\|_v} \right) \\ &\leq \left(\max_{\mathbf{z} \neq \mathbf{0}} \frac{\|\mathbf{B}\mathbf{z}\|_v}{\|\mathbf{z}\|_v} \right) \left(\max_{\mathbf{x} \neq \mathbf{0}} \frac{\|\mathbf{C}\mathbf{x}\|_v}{\|\mathbf{x}\|_v} \right) \\ &= \|\mathbf{B}\|_V \cdot \|\mathbf{C}\|_V. \end{aligned}$$

Tvrzení:

- ||·||_R je indukovaná ||·||_r ,
- ||·||_S je indukovaná ||·||_s ,
- ||·||_F není indukovaná ||·||_e

Důkaz: Nechť $\mathbf{x}, \mathbf{y} \in \mathbb{R}^n$, $r \in (0, 1)$. Každá norma konvexní kombinace $r\mathbf{x} + (1-r)\mathbf{y}$ splňuje

$$\|r\mathbf{x} + (1-r)\mathbf{y}\|_v \leq r\|\mathbf{x}\|_v + (1-r)\|\mathbf{y}\|_v \leq \max\{\|\mathbf{x}\|_v, \|\mathbf{y}\|_v\}.$$

1. „Jednotková koule“ v normě $\|\cdot\|_r$ je hyperkrychle; je konvexním obalem svých vrcholů, tj. vektorů tvaru $(\pm 1, \pm 1, \dots, \pm 1)$. Její obraz v lineárním zobrazení je konvexním obalem obrazů těchto vrcholů. Maximum normy

6

nastává pro některý z nich, řekněme \mathbf{u} ; i -tá složka vektoru $\mathbf{B}\mathbf{u}$ je maximální, pokud se shodují znaménka odpovídajících složek i -tého řádku maticy \mathbf{B} a vektoru \mathbf{u} nebo $-\mathbf{u}$,

$$\forall j : b_{ij} \mathbf{u}_j \geq 0,$$

nebo

$$\forall j : b_{ij} \mathbf{u}_j \leq 0.$$

Pak je

$$\begin{aligned} (\mathbf{B}\mathbf{u})_i &= \sum_i b_{ij} u_j = \sum_i b_{ij} \operatorname{sign}(b_{ij}) = \sum_j |b_{ij}|, \\ \|\mathbf{B}\mathbf{u}\|_R &= \max_{\mathbf{u}=(\pm 1, \dots, \pm 1)} \max_i (\mathbf{B}\mathbf{u})_i = \max_i \sum_j |b_{ij}| = \|\mathbf{B}\|_R = \|\mathbf{B}\|_R \cdot \|\mathbf{u}\|_r. \end{aligned}$$

2. „Jednotková koule“ v normě $\|\cdot\|_s$ je konvexním obalem svých vrcholů, tj. vektorů tvaru $(\pm 1, 0, 0, \dots, 0)$, $(0, \pm 1, 0, \dots, 0), \dots, (0, 0, \dots, 0, \pm 1)$. Její obraz v lineárním zobrazení je konvexním obalem obrazu těchto vrcholů. Maximum normy nastává pro některý z nich, řekněme \mathbf{u} ; jelikož $\mathbf{B}\mathbf{u}$ je sloupec maticy \mathbf{B} (vynásobený $+1$ nebo -1), $\|\mathbf{B}\mathbf{u}\|_s$ je největší norma $\|\cdot\|_s$ sloupu maticy \mathbf{B} .

3. Jednotková matice má operátorovou normu jednotkovou, ale Frobeniovu \sqrt{n} .

Tvrzení: Operátorová norma je bezrozměrná, změna měřítka vektorové normy nemá vliv. Pokud vektorovou normu vynásobíme $r > 0$, $\|\mathbf{x}\|_u = r\|\mathbf{x}\|_v$, operátorová norma se nezmění:

$$\max_{\mathbf{x} \neq \mathbf{o}} \frac{\|\mathbf{B}\mathbf{x}\|_u}{\|\mathbf{x}\|_u} = \max_{\mathbf{x} \neq \mathbf{o}} \frac{r\|\mathbf{B}\mathbf{x}\|_v}{r\|\mathbf{x}\|_v} = \max_{\mathbf{x} \neq \mathbf{o}} \frac{\|\mathbf{B}\mathbf{x}\|_v}{\|\mathbf{x}\|_v} = \|\mathbf{B}\|_V.$$

Slabší podmínka:

Definice: Maticová norma $\|\cdot\|_M$ se nazývá **souhlasná** s vektorovou normou $\|\cdot\|_v$, jestliže splňuje podmínu

$$\forall \mathbf{B} \in \mathbb{R}^{n,n} \quad \forall \mathbf{x} \in \mathbb{R}^n : \|\mathbf{B}\mathbf{x}\|_v \leq \|\mathbf{B}\|_M \|\mathbf{x}\|_v,$$

tj. jestliže je větší nebo rovná operátorové normě indukované vektorovou normou $\|\cdot\|_v$.

Příklad: Operátorová norma vynásobená jakýmkoli číslem ≥ 1 (ale ne < 1) je maticová norma souhlasná s $\|\cdot\|_v$.

Příklad: Nesouhlasné normy:

$$\left\| \begin{pmatrix} 2 & 2 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 2 \\ 2 \end{pmatrix} \right\|_r = \left\| \begin{pmatrix} 8 \\ 0 \end{pmatrix} \right\|_r = 8 > \left\| \begin{pmatrix} 2 & 2 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \right\|_S \cdot \left\| \begin{pmatrix} 2 \\ 2 \end{pmatrix} \right\|_r = 2 \cdot 2 = 4.$$

Věta: Ke každé maticové normě $\|\cdot\|_M$ existuje alespoň jedna souhlasná vektorová norma $\|\cdot\|_v$, a to $\|\mathbf{x}\|_v = \|\mathbf{x}\|_M$, kde

$$\mathbf{X} = \begin{pmatrix} x_1 & 0 & 0 & \dots & 0 \\ x_2 & 0 & 0 & \dots & 0 \\ \vdots & & & & \\ x_n & 0 & 0 & \dots & 0 \end{pmatrix}.$$

Důkaz:

$$\|\mathbf{B}\mathbf{x}\|_v = \left\| \begin{pmatrix} \sum_{j=1}^n b_{1,j} x_j & 0 & \dots & 0 \\ \sum_{j=1}^n b_{2,j} x_j & 0 & \dots & 0 \\ \vdots & & & \\ \sum_{j=1}^n b_{n,j} x_j & 0 & \dots & 0 \end{pmatrix} \right\|_M = \|\mathbf{B} \cdot \mathbf{X}\|_M \leq \|\mathbf{B}\|_M \|\mathbf{X}\|_M = \|\mathbf{B}\|_M \|\mathbf{x}\|_v.$$

Důsledek: $\|\cdot\|_F$ je souhlasná s $\|\cdot\|_e$.

Důkaz:

$$\left\| \begin{pmatrix} x_1 & 0 & 0 & \dots & 0 \\ x_2 & 0 & 0 & \dots & 0 \\ \vdots & & & & \\ x_n & 0 & 0 & \dots & 0 \end{pmatrix} \right\|_F^2 = \sum_{i=1}^n x_i^2 = \|\mathbf{x}\|_e^2.$$

Definice: Posloupnost vektorů $\mathbf{x}^{(0)}, \mathbf{x}^{(1)}, \mathbf{x}^{(2)}, \dots$ konverguje k vektoru $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n$, jestliže

$$\lim_{k \rightarrow \infty} x_i^{(k)} = x_i \quad \text{pro } i = 1, 2, \dots, n.$$

Věta: Posloupnost vektorů $\mathbf{x}^{(0)}, \mathbf{x}^{(1)}, \mathbf{x}^{(2)}, \dots$ konverguje k vektoru $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^n$, právě když

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \|\mathbf{x}^{(k)} - \mathbf{x}\|_v = 0,$$

kde za normu můžeme zvolit libovolnou z výše uvedených vektorových norm.

(Konvergence nezáleží na volbě normy.)

Definice: Posloupnost matic $\mathbf{B}^{(0)} = (b_{i,j}^{(0)})_{i,j=1}^n$, $\mathbf{B}^{(1)} = (b_{i,j}^{(1)})_{i,j=1}^n$, $\mathbf{B}^{(2)} = (b_{i,j}^{(2)})_{i,j=1}^n, \dots$ konverguje k matici $\mathbf{B} = (b_{i,j})_{i,j=1}^n$, jestliže

$$\lim_{k \rightarrow \infty} b_{i,j}^{(k)} = b_{i,j} \quad \text{pro každé } i, j = 1, 2, \dots, n.$$

($\mathbf{B}^{(k)}$... k -tý člen posloupnosti)

Věta: Posloupnost matic $\mathbf{B}^{(0)}, \mathbf{B}^{(1)}, \mathbf{B}^{(2)}, \dots$ konverguje k matici \mathbf{B} , právě když

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \|\mathbf{B}^{(k)} - \mathbf{B}\|_M = 0,$$

pro nějakou maticovou normu $\|\cdot\|_M$.

(Konvergence nezáleží na volbě normy.)

Definice: Matici \mathbf{B} je konvergentní, jestliže posloupnost matic $\mathbf{B}, \mathbf{B}^2, \mathbf{B}^3, \mathbf{B}^4, \dots$ konverguje k nulové matici. V opačném případě řekneme, že matice \mathbf{B} je divergentní.

Vlastní čísla a spektrální poloměr

Definice: Číslo $\lambda \in \mathbb{C}$ je vlastní (charakteristické) číslo matice $\mathbf{B} \in \mathbb{R}^{n,n}$, též vlastní číslo lineárního zobrazení $\mathbf{x} \mapsto \mathbf{Bx}$, jestliže existuje nenulový vektor $\mathbf{x} \in \mathbb{C}^n$ (vlastní (charakteristický) vektor) splňující

$$\lambda \mathbf{x} = \mathbf{Bx}.$$

Věta: Číslo λ je vlastní číslo matice \mathbf{B} , právě když $\det(\mathbf{B} - \lambda \mathbf{E}) = 0$.

Důkaz: Je-li λ vlastní číslo matice \mathbf{B} , pak $\exists \mathbf{x} \neq \mathbf{o} : \lambda \mathbf{x} = \mathbf{Bx}$, tedy $\mathbf{Bx} - \lambda \mathbf{x} = \mathbf{o}$, $(\mathbf{B} - \lambda \mathbf{E}) \mathbf{x} = \mathbf{o}$.

Nechť $\det(\mathbf{B} - \lambda \mathbf{E}) \neq 0$, tedy matice $\mathbf{B} - \lambda \mathbf{E}$ je regulární. Homogenní soustava rovnic s regulární maticí soustavy má pouze trivální řešení \Rightarrow spor.

Naopak z předpokladu $\det(\mathbf{B} - \lambda \mathbf{E}) = 0$ přímo plyne, že matice $\mathbf{B} - \lambda \mathbf{E}$ je singulární a $\exists \mathbf{x} \neq \mathbf{o} : (\mathbf{B} - \lambda \mathbf{E}) \mathbf{x} = \mathbf{o}$. Tedy $\mathbf{Bx} - \lambda \mathbf{x} = \mathbf{o}$, $\lambda \mathbf{x} = \mathbf{Bx}$.

Výpočet vlastních čísel

Pro matice malých řádů:

- Vypočteme det($\mathbf{B} - \lambda \mathbf{E}$), což je polynom v proměnné λ stupně n (charakteristický polynom matice \mathbf{B}).
- Vlastní čísla λ_i jsou kořeny charakteristického polynomu matice \mathbf{B} (rovnice $\det(\mathbf{B} - \lambda \mathbf{E}) = 0$ je charakteristická rovnice).

Poznámka: Za vlastní čísla nadále považujeme všechny kořeny charakteristické rovnice včetně komplexních. (O těch bychom měli správně hovořit jen v komplexním vektorovém prostoru; v reálném není násoben komplexním číslem definováno.)

Definice: Spektrální poloměr matice $\mathbf{B} \in \mathbb{R}^{n,n}$ je číslo

$$\rho(\mathbf{B}) = \max_{i=1,2,\dots,n} |\lambda_i|,$$

kde $\lambda_i, i = 1, 2, \dots, n$, jsou vlastní čísla matice \mathbf{B} (včetně komplexních).

Věta: Každá maticová norma $\|\cdot\|_M$ splňuje

$$\|\mathbf{B}\|_M \geq \varrho(\mathbf{B}).$$

Důkaz: (Jen pro případ, že vlastní číslo λ s největší absolutní hodnotou je reálné.)

Nechť \mathbf{y} je vlastní vektor příslušný λ , $\lambda\mathbf{y} = \mathbf{B}\mathbf{y}$.

Maticová norma $\|\cdot\|_M$ je souhlasná s nějakou vektorovou normou $\|\cdot\|_v$, tedy větší nebo rovná příslušné operátorové normě $\|\cdot\|_V$, indukovanej $\|\cdot\|_v$, pro kterou platí

$$\|\mathbf{B}\|_M \geq \|\mathbf{B}\|_V = \max_{\mathbf{x} \neq \mathbf{o}} \frac{\|\mathbf{B}\mathbf{x}\|_v}{\|\mathbf{x}\|_v} \geq \frac{\|\mathbf{B}\mathbf{y}\|_v}{\|\mathbf{y}\|_v} = \frac{|\lambda| \|\mathbf{y}\|_v}{\|\mathbf{y}\|_v} = |\lambda| = \varrho(\mathbf{B}).$$

Věta: Matice \mathbf{B} je konvergentní $\iff \varrho(\mathbf{B}) < 1$.

Věta: Postačující podmínka konvergentnosti matice \mathbf{B} :

- $\|\mathbf{B}\|_M < 1$ pro **nějakou** maticovou normu,
neboli
- lineární zobrazení $\mathbf{x} \mapsto \mathbf{B}\mathbf{x}$, reprezentované maticí \mathbf{B} , je kontraktivní (vzhledem k nějaké vektorové normě, souhlasné s maticovou normou $\|\cdot\|_M$).

Příklad: Matice

$$\mathbf{B} = \begin{pmatrix} 0.8 & 0.8 \\ 0.1 & 0.1 \end{pmatrix}$$

je konvergentní, $\|\mathbf{B}\|_S = 0.9 < 1$, ačkoli $\|\mathbf{B}\|_R = 1.6 > 1$, $\|\mathbf{B}\|_F = \sqrt{1.3} > 1$,

Maticové iterační metody

Hledáme posloupnost vektorů $\mathbf{x}^{(k)} \in \mathbb{R}^n$ splňující $\mathbf{x}^{(k)} \rightarrow \bar{\mathbf{x}}$, tj. $\|\mathbf{x}^{(k)} - \bar{\mathbf{x}}\|_v \rightarrow 0$.

Použijeme rekurentní vzorec

$$\mathbf{x}^{(k+1)} = F_k(\mathbf{x}^{(k)}, \mathbf{x}^{(k-1)}, \dots, \mathbf{x}^{(k-m)}).$$

Omezíme se na **lineární jednobodové stacionární maticové iterační metody**, tj. F_k nezávisí na k , závisí jen na $\mathbf{x}^{(k)}$, a to „lineárně“ (správně afinně),

$$\mathbf{x}^{(k+1)} = \mathbf{B}\mathbf{x}^{(k)} + \mathbf{c}.$$

Např.

$$\begin{aligned} \mathbf{b} &= \mathbf{A}\mathbf{x}, \\ \mathbf{x} + \mathbf{b} &= \mathbf{x} + \mathbf{A}\mathbf{x} = (\mathbf{E} + \mathbf{A})\mathbf{x}, \\ \mathbf{x} &= (\mathbf{E} + \mathbf{A})\mathbf{x} - \mathbf{b}, \\ \mathbf{x}^{(k+1)} &= \underbrace{(\mathbf{E} + \mathbf{A})}_{\mathbf{B}} \mathbf{x}^{(k)} \underbrace{- \mathbf{b}}_{\mathbf{c}}. \end{aligned}$$

Vektor chyby:

$$\begin{aligned} \varepsilon^{(k)} &= \mathbf{x}^{(k)} - \bar{\mathbf{x}} \quad (\text{předpokládáme } \neq \mathbf{o}) \\ \mathbf{x}^{(k)} &= \mathbf{B}\mathbf{x}^{(k-1)} + \mathbf{c} \\ \bar{\mathbf{x}} &= \mathbf{B}\bar{\mathbf{x}} + \mathbf{c} \\ \mathbf{x}^{(k)} - \bar{\mathbf{x}} &= \mathbf{B}(\mathbf{x}^{(k-1)} - \bar{\mathbf{x}}) = \mathbf{B}^2(\mathbf{x}^{(k-2)} - \bar{\mathbf{x}}) = \dots = \mathbf{B}^k(\mathbf{x}^{(0)} - \bar{\mathbf{x}}) \\ \varepsilon^{(k)} &= \mathbf{B}\varepsilon^{(k-1)} = \dots = \mathbf{B}^k\varepsilon^{(0)} \\ \lim_{k \rightarrow \infty} \mathbf{B}^k &= \mathbf{O} \quad \Rightarrow \quad \lim_{k \rightarrow \infty} \varepsilon^{(k)} = \mathbf{o}. \end{aligned}$$

Věta: Nutná a postačující podmínka konvergence iterační metody tvaru $\mathbf{x}^{(k+1)} = \mathbf{B}\mathbf{x}^{(k)} + \mathbf{c}$ je $\varrho(\mathbf{B}) < 1$.
Pak pro vzdálenost od limity $\bar{\mathbf{x}}$ platí

$$\|\mathbf{x}^{(k)} - \bar{\mathbf{x}}\|_v \leq \frac{\varrho(\mathbf{B})}{1 - \varrho(\mathbf{B})} \|\mathbf{x}^{(k)} - \mathbf{x}^{(k-1)}\|_v.$$

Postačující podmínka je $\|\mathbf{B}\|_M < 1$ (pro **nějakou** maticovou normu).
(Počáteční odhad i vektorová norma mohou být libovolné.)

Jacobiova iterační metoda (JIM)

Vyjádříme matici \mathbf{A} ve tvaru

$$\mathbf{A} = \mathbf{D} + \mathbf{L} + \mathbf{U},$$

kde \mathbf{D} je diagonální, \mathbf{L} ostře dolní trojúhelníková a \mathbf{U} ostře horní trojúhelníková.

$$\begin{aligned} \mathbf{A}\mathbf{x} &= (\mathbf{D} + \mathbf{L} + \mathbf{U})\mathbf{x} = \mathbf{D}\mathbf{x} + (\mathbf{L} + \mathbf{U})\mathbf{x} = \mathbf{b}, \\ \mathbf{D}\mathbf{x} &= -(\mathbf{L} + \mathbf{U})\mathbf{x} + \mathbf{b}, \\ \mathbf{x} &= \mathbf{D}^{-1}(-(\mathbf{L} + \mathbf{U})\mathbf{x} + \mathbf{b}), \end{aligned}$$

..

volíme

$$\mathbf{x}^{(k+1)} = \underbrace{-\mathbf{D}^{-1}(\mathbf{L} + \mathbf{U})}_{\mathbf{B}_{\text{JIM}}} \mathbf{x}^{(k)} + \underbrace{\mathbf{D}^{-1}\mathbf{b}}_{\mathbf{c}_{\text{JIM}}}.$$

Předpokládáme, že hlavní diagonálna matice \mathbf{A} neobsahuje žádný nulový prvek (toho lze dosáhnout výměnou řádků nebo sloupců).

Chceme, aby na diagonále byly „velké“ prvky.

Po složkách:

$$\begin{aligned} x_1 &= -\frac{1}{a_{1,1}}(a_{1,2}x_2 + a_{1,3}x_3 + \dots + a_{1,n}x_n) + \frac{b_1}{a_{1,1}} \\ x_2 &= -\frac{1}{a_{2,2}}(a_{2,1}x_1 + a_{2,3}x_3 + \dots + a_{2,n}x_n) + \frac{b_2}{a_{2,2}} \\ &\vdots \\ x_n &= -\frac{1}{a_{n,n}}(a_{n,1}x_1 + a_{n,2}x_2 + \dots + a_{n,n-1}x_{n-1}) + \frac{b_n}{a_{n,n}} \\ x_i^{(k+1)} &= -\frac{1}{a_{i,i}} \left(\sum_{j=1}^{i-1} a_{i,j} x_j^{(k)} + \sum_{j=i+1}^n a_{i,j} x_j^{(k)} \right) + \frac{b_i}{a_{i,i}}, \quad i = 1, 2, \dots, n. \end{aligned}$$

Podmínka ukončení: $\|\mathbf{x}^{(k+1)} - \mathbf{x}^{(k)}\|_v < \varepsilon$.

Gaußsova-Seidelova iterační metoda (GSM)

Každá už vypočtená složka vektoru $\mathbf{x}^{(k+1)}$ se ihned použije v dalším výpočtu.

$$x_i^{(k+1)} = -\frac{1}{a_{i,i}} \left(\sum_{j=1}^{i-1} a_{i,j} x_j^{(k+1)} + \sum_{j=i+1}^n a_{i,j} x_j^{(k)} \right) + \frac{b_i}{a_{i,i}}, \quad i = 1, 2, \dots, n.$$

Pro realizaci výpočtu stačí pouze jeden vektor \mathbf{x} .

Maticový tvar:

$$\begin{aligned} (\mathbf{D} + \mathbf{L})\mathbf{x} &= -\mathbf{U}\mathbf{x} + \mathbf{b}, \\ \mathbf{x} &= -(\mathbf{D} + \mathbf{L})^{-1}(\mathbf{U}\mathbf{x} - \mathbf{b}), \\ \mathbf{x}^{(k+1)} &= \underbrace{-(\mathbf{D} + \mathbf{L})^{-1}\mathbf{U}}_{\mathbf{B}_{\text{GSM}}} \mathbf{x}^{(k)} + \underbrace{(\mathbf{D} + \mathbf{L})^{-1}\mathbf{b}}_{\mathbf{c}_{\text{GSM}}}. \end{aligned}$$

Věta: JIM (resp. GSM) konverguje pro libovolnou počáteční iteraci právě tehdy, když $\rho(\mathbf{B}_{\text{JIM}}) < 1$ (resp. $\rho(\mathbf{B}_{\text{GSM}}) < 1$).

Pokud $\rho(\mathbf{B}_{\text{JIM}}) = \rho(\mathbf{B}_{\text{GSM}}) = 0$, dostaneme teoretičky přesné řešení v konečném počtu kroků.

Může se stát, že konverguje pouze jedna z těchto metod (nebo žádná).

Problém: určení vlastních čísel maticy.

Věta: Nechť $\|\mathbf{B}_{\text{JIM}}\|_M < 1$ (resp. $\|\mathbf{B}_{\text{GSM}}\|_M < 1$), pak JIM (resp. GSM) konverguje a pro příslušné iterační posloupnosti získané z libovolné počáteční iterace $\mathbf{x}^{(0)} \in R^n$ platí odhad

$$\|\mathbf{x}^{(k)} - \bar{\mathbf{x}}\|_v \leq \frac{\|\mathbf{B}\|_M}{1 - \|\mathbf{B}\|_M} \|\mathbf{x}^{(k)} - \mathbf{x}^{(k-1)}\|_v,$$

10

kde \mathbf{B} je příslušná iterační matice (normy matice a vektorů můžeme volit, ale musí být souhlasné).

Definice: Matici $\mathbf{A} \in R^{n,n}$ se nazývá **ostře diagonálně dominantní**, jestliže

$$|a_{i,i}| > \sum_{j=1, j \neq i}^n |a_{i,j}| \quad \text{pro každé } i = 1, 2, \dots, n.$$

Poznámka: Pro transponovanou matici dostaneme jinou podmíinku, ale stejně užitečnou.

Věta: Nechť matice $\mathbf{A} \in R^{n,n}$ je ostře diagonálně dominantní, pak JIM i GSM konverguje pro libovolnou počáteční iteraci.

Poznámka: Ostře diagonálně dominantní je např. matice soustavy rovnic pro koeficienty kubického splinu, kdy navíc matice soustavy je řídká, takže složitost jedné iterace je tměrná n .

Definice: Matici $\mathbf{A} \in R^{n,n}$ se nazývá **pozitivně definitní**, jestliže pro každý nenulový vektor $\mathbf{x} \in R^n$ platí

$$\mathbf{x}^\top \mathbf{A} \mathbf{x} > 0.$$

Věta: Nechť matice $\mathbf{A} \in R^{n,n}$ je symetrická a pozitivně definitní, pak GSM konverguje.

Poznámka: Symetrická a pozitivně definitní je např. matice soustavy normálních rovnic u metody nejmenších čtverců.

Superrelaxační metoda (SOR – Successive OverRelaxation method)

Konvergenci urychlí jakákoli modifikace, která vede ke zmenšení spektrálního poloměru matice \mathbf{B} .

$$\begin{aligned}
 D\mathbf{x} &= D\mathbf{x} + \omega \overbrace{(-A\mathbf{x} + \mathbf{b})}^{\circ} = \\
 &= D\mathbf{x} + \omega ((-L - D - U)\mathbf{x} + \mathbf{b}), \\
 D\mathbf{x} + \omega L\mathbf{x} &= (1 - \omega)D\mathbf{x} - \omega U\mathbf{x} + \omega \mathbf{b}, \quad (\text{GSM: } \omega := 1) \\
 (D + \omega L)\mathbf{x} &= [(1 - \omega)D - \omega U]\mathbf{x} + \omega \mathbf{b}, \\
 \mathbf{x} &= (D + \omega L)^{-1} [(1 - \omega)D - \omega U]\mathbf{x} + \omega (D + \omega L)^{-1}\mathbf{b}, \\
 \mathbf{x}^{(k+1)} &= \underbrace{(D + \omega L)^{-1} [(1 - \omega)D - \omega U]}_{B_\omega} \mathbf{x}^{(k)} + \underbrace{\omega (D + \omega L)^{-1}\mathbf{b}}_{c_\omega},
 \end{aligned}$$

kde ω je **relaxační faktor**. (Pro $\omega = 1$ dostáváme GSM.) Po složkách:

$$x_i^{(k+1)} = \frac{\omega}{a_{i,i}} \left(- \sum_{j=1}^{i-1} a_{i,j} x_j^{(k+1)} - \sum_{j=i+1}^n a_{i,j} x_j^{(k)} + b_j \right) + (1 - \omega) x_i^{(k)}$$

Věta: Metoda SOR konverguje pro libovolnou počáteční iteraci právě tehdy, když $\rho(\mathbf{B}_\omega) < 1$.

Věta: (Ostrowského) Nechť \mathbf{A} je symetrická matici s kladnými prvky na diagonále. Pak platí $\rho(\mathbf{B}_\omega) < 1$ právě tehdy, když matici \mathbf{A} je pozitivně definitní a $0 < \omega < 2$.

Poznámka: Často je lepší relaxační faktor nadhadnotit.

Jaký postup volit?

Poznámka: Složitost řešení soustavy n lineárních rovnic o n neznámých s jedním vektorem pravých stran pomocí GEM a dalších přímých metod je úměrná n^3 . Je-li matice soustavy trojúhelníková (speciálně při zpětném chodu GEM a v řešení soustavy při známém LU-rozkladu), vychází složitost úměrná n^2 . Rovněž vynásobení vektoru pravých stran známou inverzní maticí má složitost úměrnou n^2 . Je-li matice soustavy diagonální, je složitost řešení úměrná n .

U iteračních metod má v obecném případě jeden krok složitost úměrnou n^2 . Počet kroků závisí na požadované přesnosti a rychlosti konvergence (a ta na spektrálním poloměru iterační matici).

Úloha:

$$\mathbf{A}\mathbf{x} = \mathbf{B}$$

Poznámka: Matice \mathbf{B} zde reprezentuje pravé strany soustavy, nikoli iterační matici.

- \mathbf{A} plná (málo nulových prvků), \mathbf{B} málo sloupců: GEM nebo její modifikace
- \mathbf{A} plná, \mathbf{B} mnoho sloupců: výpočet \mathbf{A}^{-1} a řešení maticovým násobením nebo LU-rozklad
- \mathbf{A} řídká (mnoho nulových prvků) nepravidelně: GEM s výběrem hlavního prvku
- \mathbf{A} řídká pravidelně: iterační metody JIM, GSM, SOR

Literatura

[Navara, Němeček] Navara, M., Němeček, A.: *Numerické metody*. Skriptum ČVUT, Praha, 2005.

[Num. Recipes] Press, W.H., Flannery, B.P., Teukolsky, S.A., Vetterling, W.T.: Numerical Recipes (The Art of Scientific Computing). Cambridge University Press, Cambridge, 1986.

[Num. Recipes] Press, W.H., Flannery, B.P., Teukolsky, S.A., Vetterling, W.T.: Numerical Recipes (The Art of Scientific Computing). 2nd edition, Cambridge University Press, Cambridge, 1992.

[Handbook Lin. Alg.] Hogben, L. (ed.): Handbook of Linear Algebra. Chapman & Hall/CRC, Boca Raton/London/New York, 2007.

