

Algorithmes numériques – Rapport

Polynôme caractéristique, valeurs propres et vecteurs propres

Axel Delsol, Pierre-Loup Pissavy

Janvier 2014

Table des matières

1	Préambule	2
1.1	Structure du programme	2
1.2	Compilation et logiciels utilisés	3
1.3	Jeux de tests	3
2	Polynôme caractéristique	5
2.1	Méthode de Leverrier	5
2.1.1	Présentation	5
2.1.2	Programme	5
2.2	Méthode de Leverrier améliorée	6
2.2.1	Présentation	6
2.2.2	Programme	6
2.3	Résultats des tests	8
2.4	Comparaisons	8
3	Valeurs propres et vecteurs propres	9
3.1	Méthode des puissances itérées	9
3.1.1	Présentation	9
3.1.2	Programme	9
3.2	Résultats des tests	10
3.2.1	Résultats avec une précision 10^{-5}	10
3.2.2	Résultats avec une précision 10^{-9}	12
3.3	Comparaisons	13
4	Conclusion	14

1 Préambule

1.1 Structure du programme

Nous avons conçu un programme principal avec menus, présenté sous la forme suivante :

```
Menu principal : Polynôme caractéristique, valeurs propres et
vecteurs propres

Choisir le mode de saisie de la matrice :
1- Utiliser le générateur de matrices
0- Entrer manuellement les valeurs
(Saisie des valeurs de la matrice...)

(Affichage de la matrice correspondante...)
Quelle résolution utiliser ?
1- Méthode de Leverrier
2- Méthode de Leverrier améliorée
9- Nouvelle série de points (Menu principal)
0- Quitter
Votre choix :
```

FIGURE 1.1 – Aperçu : Menu Principal

Au lancement, le programme demande la saisie des valeurs, qu'il stocke dans un tableau, puis affiche le menu. Après chaque méthode, il est possible de réutiliser le jeu de données (chaque méthode qui doit modifier les valeurs utilise un duplicata).

Le menu principal est codé dans le fichier source `main.c`. Les méthodes sont codées dans des fichiers individuels sauf les méthodes de leverrier qui sont réunies. Les prototypes des fonctions sont écrits dans les headers correspondants. La liste de tous ces fichiers est présentée figure 1.3.

Le stockage des valeurs se fait en double précision (type `double`, 64 bits) afin d'obtenir des résultats suffisamment précis.

De plus, les méthodes de leverrier utilisent une structure de polynôme (composée du degré et des coefficients), présentée figure 1.2, pour faciliter la compréhension du code.

```
4 | typedef struct polynome
5 | {
6 |     int d; //degree
7 |     double* poln; //coefficients
8 | } polynome;
```

FIGURE 1.2 – Code : Structure de Polynôme

```

generateur.c
leverrier.c
main.c
matrices.c
pile.c
polynome.c
puissancesIt.c
useful.c
file.h
generateur.h
leverrier.h
matrices.h
pile.h
polynome.h
puissancesIt.h
useful.h
makefile

```

FIGURE 1.3 – Aperçu : Arborescence des fichiers C et `makefile`

1.2 Compilation et logiciels utilisés

La compilation est gérée par un `makefile`.

Le compilateur utilisé est GCC. Il suffit de taper `make` pour lancer la compilation, puis `./main` pour lancer le programme.

Pour nettoyer les fichiers temporaires, il faudra taper `make clean`.

Ce `makefile` permet également de générer ce rapport ainsi que quelques fichiers qui y sont intégrés.

1.3 Jeux de tests

Nous avons choisi d'effectuer les tests des méthodes de Leverrier et des puissances itérées sur les mêmes matrices. Les matrices utilisées sont celles du TP sur les méthodes de résolution de systèmes d'équations, de dimension 3 à 15. Ceci nous permet de calculer l'image de la valeur propre donnée par la puissance itérée du polynôme caractéristique obtenu dans les méthodes de Leverrier. On peut ainsi contrôler les résultats puisque normalement, l'image d'une valeur propre par le polynôme caractéristique de la matrice associée est égale à 0.

Note : Les résultats sont tronqués à 10^{-6} pour des raisons de lisibilité mais les calculs ont été effectués avec la précision de la machine.

$$\text{Creuse à 70\%} \begin{pmatrix} 6.000000 & 5.000000 & 5.000000 & 2.000000 & 0.000000 \\ 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 9.000000 & 0.000000 \\ 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 6.000000 & 0.000000 \\ 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 \\ 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 \end{pmatrix} \quad (1)$$

$$\text{A bord} \begin{pmatrix} 1.000000 & 0.500000 & 0.250000 & 0.125000 & 0.062500 & 0.031250 & 0.015625 & 0.007812 \\ 0.500000 & 1.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 \\ 0.250000 & 0.000000 & 1.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 \\ 0.125000 & 0.000000 & 0.000000 & 1.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 \\ 0.062500 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 1.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 \\ 0.031250 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 1.000000 & 0.000000 & 0.000000 \\ 0.015625 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 1.000000 & 0.000000 \\ 0.007812 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 0.000000 & 1.000000 \end{pmatrix} \quad (2)$$

$$\text{Ding Dong} \begin{pmatrix} 0.200000 & 0.333333 & 1.000000 \\ 0.333333 & 1.000000 & -1.000000 \\ 1.000000 & -1.000000 & -0.333333 \end{pmatrix} \quad (3)$$

[illegible]

[illegible]

2 Polynôme caractéristique

2.1 Méthode de Leverrier

2.1.1 Présentation

La méthode de Leverrier permet de déterminer le polynôme caractéristique d'une matrice $A \in M_{n,n}(\mathbb{R})$ c'est-à-dire le déterminant $|A - \lambda I_n| = P(\lambda)$ où I_n est la matrice identité. Le but est donc de déterminer les coefficients a_i du polynome $P(\lambda) = a_n + a_{n-1}\lambda + \dots + a_0\lambda^n$.

Pour les trouver, on définit d'abord $S_p = \text{Tr}(A^p)$ puis on applique les identités de Newton l'aide de la formule suivante :

$$\forall p \in \{1, \dots, n\}, \quad \begin{cases} a_0 = (-1)^n \\ a_p = -\frac{\sum_{i=0}^{p-1} a_i \cdot S_{p-i}}{p} \end{cases}$$

2.1.2 Programme

```
9 void leverrier(double** A, int n)
10 {
11     int i, j;
12     double tempo;
13     double* coeffs=(double*) malloc ((n+1)*sizeof(double)); //tableau coeffs
14     double* traces=(double*) malloc (n*sizeof(double)); //tableau traces
15     double** tmp;
16     polynome* p;
17
18     //On remplit notre tableau contenant les traces
19     for (i=1; i<=n; i++)
20     {
21         tmp=puissanceMatrice(A, n, i);
22         traces[i-1]=trace(tmp, n);
23         for (j=0; j<n; j++)
24         {
25             free(tmp[j]);
26         }
27         free(tmp);
28     }
29
30     //On remplit le tableau des coefficients
31     for(i=0; i<=n; i++)
32     {
33         coeffs[i]=0;
34     }
35     coeffs[n]=pow(-1.0,n);
36     for(i=1; i<=n; i++)
37     {
38         for(j=0;j<i;j++)
39         {
40             coeffs[n-i] = coeffs[n-i] - coeffs[n-j]*traces[i-j-1];
41         }
42         coeffs[n-i] = coeffs[n-i]/i;
43     }
```

```

44 | p=creerPoly(n+1, "tableau", coeffs);
45 | menuAffichage(p);
46 |
47 | //liberation memoire
48 | //libération du tableau de trace
49 | free(traces);
50 | //libération du polynome
51 | free(p->poln);
52 | free(p);
53 | }

```

FIGURE 2.1 – Code : leverrier.c

2.2 Méthode de Leverrier améliorée

2.2.1 Présentation

2.2.2 Programme

```

55 | void leverrierA(double** A, int n)
56 | {
57 |     int i, j;
58 |     double tempo;
59 |     double** tmp;
60 |     double* coeffs=(double*) malloc ((n+1)*sizeof(double)); //tableau coeffs
61 |     double** Ak=(double**) malloc (n*sizeof(double*));
62 |     double** B=(double**) malloc (n*sizeof(double*));
63 |     double** I=(double**) malloc (n*sizeof(double*));
64 |     polynome* p;
65 |
66 |     for (i=0; i<n; i++)
67 |     {
68 |         Ak[i]=(double*) malloc (n*sizeof(double));
69 |         I[i]=(double*) malloc (n*sizeof(double));
70 |         B[i]=(double*) malloc (n*sizeof(double));
71 |     }
72 |
73 |     //Création matrice identité, initialisation de B et copie de A
74 |     for (i=0; i<n; i++)
75 |     {
76 |         for (j=0; j<n; j++)
77 |         {
78 |             Ak[i][j]=A[i][j];
79 |             if (i==j)
80 |             {
81 |                 I[i][j]=1;
82 |                 B[i][j]=1;
83 |             }
84 |             else
85 |             {
86 |                 I[i][j]=0;
87 |                 B[i][j]=0;
88 |             }
89 |         }
90 |     }
91 |
92 |     //On remplit le tableau des coefficients
93 |     for(i=0; i<=n; i++)
94 |     {
95 |         coeffs[i]=0;
96 |     }
97 |
98 |     coeffs[0]=pow(-1,n);
99 |
100 |
101 |     for(i=1; i<=n; i++)
102 |     {
103 |         Ak=produitMatriciel(B,A,n,n,n);

```

```

104     coeffs[i]=trace(Ak,n)/i;
105     tmp=produitSMatriciel(I,n,n,coeffs[i]);
106     for(j=0;j<n;j++)
107     {
108         free(B[j]);
109     }
110     free(B);
111     B=difference(Ak,tmp,n,n);
112     for(j=0;j<n;j++)
113     {
114         free(Ak[j]);
115         free(tmp[j]);
116     }
117     free(tmp); free(Ak);
118 }
119
120 //On inverse le tableau des coefficients
121 for(i=0;i<=((n+1)/2)-1;i++)
122 {
123     if ((n%2) == 0)
124     {
125         coeffs[i]=-coeffs[i];
126     }
127     tempo = coeffs[i];
128     coeffs[i] = coeffs[n-i];
129     coeffs[n-i] = tempo;
130 }
131
132 p=creerPoly(n+1, "tableau", coeffs);
133 menuAffichage(p);
134
135 //liberation memoire
136 for (i=0; i<n; i++)
137 {
138     free(B[i]);
139 }
140 free(B);
141 //liberation du polynome
142 free(p->poln);
143 free(p);
144 }

```

FIGURE 2.2 – Code : leverrier.c

2.3 Résultats des tests

Système analysé	Polynôme caractéristique obtenu
(1)	Polynome Leverrier : $P(x) \approx +6.000000 \cdot x^4 - 1.000000 \cdot x^5$ Polynome Leverrier amélioré : $P(x) \approx +6.000000 \cdot x^4 - 1.000000 \cdot x^5$
(2)	Polynome Leverrier : $P(x) \approx 0.666687 - 6.000122 \cdot x + 23.000305 \cdot x^2 - 49.333740 \cdot x^3 + 65.000305 \cdot x^4 - 54.000122 \cdot x^5 + 27.666687 \cdot x^6 - 8.000000 \cdot x^7 + 1.000000 \cdot x^8$ Polynome Leverrier amélioré : $P(x) \approx -0.666687 + 6.000122 \cdot x - 23.000305 \cdot x^2 + 49.333740 \cdot x^3 - 65.000305 \cdot x^4 - 54.000122 \cdot x^5 + 27.666687 \cdot x^6 - 8.000000 \cdot x^7 - 1.000000 \cdot x^8$
(3)	Polynome Leverrier : $P(x) \approx -1.896296 + 2.311111 \cdot x + 0.866667 \cdot x^2 - 1.000000 \cdot x^3$ Polynome Leverrier amélioré : $P(x) \approx -1.896296 + 2.311111 \cdot x + 0.866667 \cdot x^2 - 1.000000 \cdot x^3$
(4)	Polynome Leverrier : $P(x) \approx -1884.003497 - 58.681818 \cdot x + 3081.727273 \cdot x^2 - 49621.000000 \cdot x^3 + 406120.000000 \cdot x^4 - 1693692.000000 \cdot x^5 + 3506217.000000 \cdot x^6 - 3506217.000000 \cdot x^7 + 1693692.000000 \cdot x^8 - 406120.000000 \cdot x^9 + 49621.000000 \cdot x^{10} - 3081.000000 \cdot x^{11} + 91.000000 \cdot x^{12} - 1.000000 \cdot x^{13}$ Polynome Leverrier amélioré : $P(x) \approx 1.000000 - 91.000000 \cdot x + 3081.000000 \cdot x^2 - 49621.000000 \cdot x^3 + 406120.000000 \cdot x^4 - 1693692.000000 \cdot x^5 + 3506217.000000 \cdot x^6 - 3506217.000000 \cdot x^7 + 1693692.000000 \cdot x^8 - 406120.000000 \cdot x^9 + 49621.000000 \cdot x^{10} - 3081.000000 \cdot x^{11} + 91.000000 \cdot x^{12} - 1.000000 \cdot x^{13}$
(5)	Polynome Leverrier : $P(x) \approx -0.000000 - 0.000000 \cdot x - 0.000000 \cdot x^2 - 0.000000 \cdot x^3 - 0.000000 \cdot x^4 + 0.000000 \cdot x^5 + 0.000000 \cdot x^6 - 0.000000 \cdot x^7 + 0.000000 \cdot x^8 - 0.000000 \cdot x^9 + 0.000000 \cdot x^{10} - 0.000277 \cdot x^{11} + 0.050664 \cdot x^{12} - 0.931768 \cdot x^{13} + 2.335873 \cdot x^{14} - 1.000000 \cdot x^{15}$ Polynome Leverrier amélioré : $P(x) \approx 0.000000 + 0.000000 \cdot x + 0.000000 \cdot x^2 + 0.000000 \cdot x^3 + 0.000000 \cdot x^4 + 0.000000 \cdot x^5 + 0.000000 \cdot x^6 + 0.000000 \cdot x^7 + 0.000000 \cdot x^8 - 0.000000 \cdot x^9 + 0.000000 \cdot x^{10} - 0.000277 \cdot x^{11} + 0.050664 \cdot x^{12} - 0.931768 \cdot x^{13} + 2.335873 \cdot x^{14} - 1.000000 \cdot x^{15}$

2.4 Comparaisons

3 Valeurs propres et vecteurs propres

3.1 Méthode des puissances itérées

3.1.1 Présentation

3.1.2 Programme

```
10 void puissancesIt(double** A, int n, double precision)
11 {
12     int i, cpt=0;
13     double ecart = 1.;
14     double** x1 = (double**) malloc (n*sizeof(double));
15     double** x2;
16     double** x3;
17     double** xt;
18     double** xtx;
19     //Initialisation de x1 -> vecteur unité
20     for (i=0; i<n; i++)
21     {
22         x1[i] = (double*) malloc (sizeof(double));
23         x1[i][0] = 1.;
24     }
25     while (ecart > precision)
26     {
27         cpt++;
28         x2 = produitMatriciel(A,x1,n,n,1); //x2 = A x1
29         diviserComposantes(x2,n);
30         x3 = difference(x2, x1, n, 1); //x3 = x2-x1
31         ecart = norme(x3, n); //norme(x2-x1)-> écart
32         //libération mémoire
33         for (i=0; i<n; i++)
34         {
35             free(x3[i]);
36             free(x1[i]);
37         }
38         free(x3);
39         free(x1);
40         x1 = x2; //xi = x(i+1)
41     }
42     printf("Nombre d'itérations : %d\n", cpt);
43     printf("Approximation du vecteur propre :\n");
44     for (i=0; i<n; i++)
45     {
46         printf("x[%d]=%f\n", (i+1), x1[i][0]);
47     }
48     xt = transpose(x1, n, 1);
49     x2 = produitMatriciel(xt, A, 1, n, n); //xt A
50     x3 = produitMatriciel(x2, x1, 1, n, 1); //xt A x
51     xtx = produitMatriciel(xt, x1, 1, n, 1); //xt x
52     printf("Approximation de la valeur propre maximum : %f\n", x3[0][0]/xtx[0][0]);
53     //libération mémoire
54     for (i=0; i<n; i++)
55     {
56         free(x1[i]);
57     }
58     free(xt[0]); free(x2[0]); free(x3[0]); free(xtx[0]);
```

```

59 || free(xt); free(x2); free(x3); free(xtx); free(x1);
60 || }

```

FIGURE 3.1 – Code : puissancesIt.c

3.2 Résultats des tests

Remarque : Les tests ont été effectués deux fois : une en précision 10^{-5} et une en 10^{-9} afin d'observer l'impact de la précision sur les résultats.

3.2.1 Résultats avec une précision 10^{-5}

Système analysé	Itération	Vecteur	Valeur	Image par Leverrier	Image par Leverrier amélioré
(1)	3	$\begin{pmatrix} 1.000000 \\ 0.000000 \\ 0.000000 \\ 0.000000 \\ 0.000000 \end{pmatrix}$	6.000000	0.000000	0.000000
(2)	43	$\begin{pmatrix} 73.898567 \\ 63.999989 \\ 31.999995 \\ 15.999997 \\ 7.999999 \\ 3.999999 \\ 2.000000 \\ 1.000000 \end{pmatrix}$	1.577333	0.000000	-590.987420
(3)	365	$\begin{pmatrix} 0.353044 \\ -1.549648 \\ 1.000000 \end{pmatrix}$	1.569365	0.000000	0.000000

Système analysé	Itération	Vecteur	Valeur	Image par Leverrier	Image par Leverrier amélioré
(4)	33	$\begin{pmatrix} 1.557371 \\ 3.071013 \\ 4.454695 \\ 5.584562 \\ 6.354832 \\ 6.694680 \\ 6.581598 \\ 6.048019 \\ 5.178865 \\ 4.099349 \\ 2.954549 \\ 1.884488 \\ 1.000000 \end{pmatrix}$	35.613867	-3143394623488.0	-3143394623488.0
(5)	11	$\begin{pmatrix} 7.243207 \\ 4.511415 \\ 3.408464 \\ 2.779831 \\ 2.364104 \\ 2.065033 \\ 1.837827 \\ 1.658468 \\ 1.512781 \\ 1.391800 \\ 1.289546 \\ 1.201862 \\ 1.125759 \\ 1.059028 \\ 1.000000 \end{pmatrix}$	1.845928	0.000000	0.000000

3.2.2 Résultats avec une précision 10^{-9}

Système analysé	Itération	Vecteur	Valeur	Image par Leverrier	Image par Leverrier amélioré
(1)	3	$\begin{pmatrix} 1.000000 \\ 0.000000 \\ 0.000000 \\ 0.000000 \\ 0.000000 \end{pmatrix}$	6.000000	0.000000	0.000000
(2)	64	$\begin{pmatrix} 73.898579 \\ 64.000000 \\ 32.000000 \\ 16.000000 \\ 8.000000 \\ 4.000000 \\ 2.000000 \\ 1.000000 \end{pmatrix}$	1.577333	-0.000000	-590.987420
(3)	587	$\begin{pmatrix} 0.353046 \\ -1.549652 \\ 1.000000 \end{pmatrix}$	1.569365	-0.000000	-0.000000
(4)	54	$\begin{pmatrix} 1.557373 \\ 3.071016 \\ 4.454700 \\ 5.584567 \\ 6.354838 \\ 6.694686 \\ 6.581603 \\ 6.048024 \\ 5.178869 \\ 4.099351 \\ 2.954550 \\ 1.884488 \\ 1.000000 \end{pmatrix}$	35.613861	-334626816.0	-334626816.0

Système analysé	Itération	Vecteur	Valeur	Image par Leverrier	Image par Leverrier amélioré
(5)	17	$\begin{pmatrix} 7.243208 \\ 4.511416 \\ 3.408464 \\ 2.779831 \\ 2.364104 \\ 2.065033 \\ 1.837827 \\ 1.658468 \\ 1.512781 \\ 1.391800 \\ 1.289546 \\ 1.201862 \\ 1.125759 \\ 1.059028 \\ 1.000000 \end{pmatrix}$	1.845928	0.000000	0.000000

3.3 Comparaisons

4 Conclusion