山田龍

2020 年 11 月 23 日

1 Gauss の消去法

2 Gauss-Seidel 法

Gauss-Seidel 法と SOR 法の導出については [1] の導出を参考にした。

$$A = D + L + U \tag{1}$$

の順番で対角成分、下三角成分、上三角成分を定義する。解くべき連立方程式は、

$$(D + L + U)\mathbf{x} = \mathbf{b} \tag{2}$$

$$\mathbf{x} = -D^{-1}(L + U)\mathbf{x} + D^{-1}\mathbf{b} \tag{3}$$

ヤコビ法では、以下の漸化式が成立すれば $x^{(k)}$ は連立方程式の解である。

$$\mathbf{x}^{(k+1)} = -D^{-1}L\mathbf{x}^{(k)} - D^{-1}U\mathbf{x}^{(k)} + D^{-1}\mathbf{b} \tag{4}$$

Gauss-Seidel 法では、以下の漸化式が成立すれば $x^{(k)}$ は連立方程式の解である。

$$\begin{aligned} \mathbf{x}^{(k+1)} &= -D^{-1}L\mathbf{x}^{(k+1)} - D^{-1}U\mathbf{x}^{(k)} + D^{-1}\mathbf{b} && (5) \\ &= -D^{-1}(L + U)\mathbf{x}^{(k)} + D^{-1}\mathbf{b} && (6) \end{aligned}$$

反復の計算は、

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

ここで、$\mathbf{d}^{(k+1)} = \mathbf{x}^{(k+1)} - \mathbf{x}^{(k)}$ を定義する。

$$\begin{aligned} \mathbf{d}^{(k+1)} &= -\left[(D + L)^{-1}U + E\right]\mathbf{x}^{(k)} + (D + L)^{-1}\mathbf{b} \\ &= -\left[(D + L)^{-1}U - D^{-1}U + D^{-1}U + E\right]\mathbf{x}^{(k)} \\ &\quad + \left[(D + L)^{-1} - D^{-1} + D^{-1}\right]\mathbf{b} \\ &= -\left[-L(D + L)^{-1}D^{-1}U + D^{-1}U + E\right]\mathbf{x}^{(k)} \\ &\quad + \left[-L(D + L)^{-1}D^{-1} + D^{-1}\right]\mathbf{b} \\ &= -D^{-1}L\mathbf{x}^{(k+1)} - \left(D^{-1}U + E\right)\mathbf{x}^{(k)} + D^{-1}\mathbf{b} \end{aligned}$$

更に変形する。

$$
\begin{aligned}
&(E+D^{-1}L)\mathbf{d}^{(k+1)} \\
&\qquad = -D^{-1}L(-D^{-1}U\mathbf{x}^{(k)}+D^{-1}\mathbf{b}) \\
&\qquad - \left(D^{-1}U+E\right)(-D^{-1}U\mathbf{x}^{(k-1)}+D^{-1}\mathbf{b}) \\
&\qquad + (D^{-1}+D^{-1}LD^{-1})\mathbf{b} \\
&\qquad = -D^{-1}LD^{-1}U\mathbf{x}^{(k)}-D^{-1}LD^{-1}\mathbf{b} \\
&\qquad + \left(D^{-1}UD^{-1}U+D^{-1}U\right)\mathbf{x}^{(k-1)} \\
&\qquad - (D^{-1}UD^{-1}+D^{-1})\mathbf{b} \\
&\qquad + (D^{-1}+D^{-1}LD^{-1})\mathbf{b}
\end{aligned}
$$

両辺変形して、

$$
\begin{aligned}
D^{-1}(D+L)\mathbf{d}^{(k+1)} &= D^{-1}[-LD^{-1}U\mathbf{x}^{(k)}-LD^{-1}\mathbf{b} \\
&+ \left(UD^{-1}U+U\right)\mathbf{x}^{(k-1)} \\
&+ (-UD^{-1}+LD^{-1})\mathbf{b}] \\
(D+L)\mathbf{d}^{(k+1)} &= -LD^{-1}U\mathbf{x}^{(k)}-LD^{-1}\mathbf{b} \\
&+ \left(UD^{-1}U+U\right)\mathbf{x}^{(k-1)} \\
&+ (-UD^{-1}+LD^{-1})\mathbf{b}
\end{aligned}
$$

左辺の係数の逆行列を両辺にかけて、

$$
\begin{aligned}
\mathbf{d}^{(k+1)} &= (D+L)^{-1}U[-LD^{-1}\mathbf{x}^{(k)}+\left(D^{-1}U+E\right)\mathbf{x}^{(k-1)}-D^{-1}\mathbf{b}] \\
&= (D+L)^{-1}U\mathbf{d}^{(k)}
\end{aligned}
$$

よって Gauss-Seidel 法において解が収束する条件は、

$$||(D+L)^{-1}U||_2 < 1 \tag{7}$$

反復すべき式は、

$$D\mathbf{x}^{(k+1)} = -L\mathbf{x}^{(k+1)} - U\mathbf{x}^{(k)} + \mathbf{b} \tag{8}$$

$$a_{ii}\mathbf{x}_i^{(k+1)} = -\sum_{j=1}^{i-1} a_{ij}\mathbf{x}_j^{(k+1)} - \sum_{j=i+1}^{n} a_{ij}\mathbf{x}_j^{(k+1)} + \mathbf{b}_i \tag{9}$$

3 SOR 法

Gauss-Seidel 法において、緩和係数 ω を持ち込んで改良した解法を SOR 法という。Gauss-Seidel 法の計算式を変形する。

$$(E+D^{-1}L)\mathbf{x}^{(k+1)} = -D^{-1}U\mathbf{x}^{(k)} + D^{-1}\mathbf{b} \tag{10}$$

$$\mathbf{x}^{(k+1)} = \mathbf{x}^{(k)} - D^{-1}L\mathbf{x}^{(k+1)} - (D^{-1}U+E)\mathbf{x}^{(k)} + D^{-1}\mathbf{b} \tag{11}$$

SOR 法では緩和係数 ω を導入する。

$$\mathbf{x}^{(k+1)} = \mathbf{x}^{(k)} + \omega\left[-D^{-1}L\mathbf{x}^{(k+1)} - (D^{-1}U + E)\mathbf{x}^{(k)} + D^{-1}\mathbf{b}\right] \tag{12}$$

$$(E + \omega D^{-1}L)\mathbf{x}^{(k+1)} = \left[E - \omega(D^{-1}U + E)\right]\mathbf{x}^{(k)} + \omega D^{-1}\mathbf{b} \tag{13}$$

反復すべき式は、

$$D\mathbf{x}^{(k+1)} = D\mathbf{x}^{(k)} + \omega\left[-L\mathbf{x}^{(k+1)} - (U + D)\mathbf{x}^{(k)} + \mathbf{b}\right] \tag{14}$$

$$D\mathbf{x}^{(k+1)} = -\omega L\mathbf{x}^{(k+1)} + \left[D - \omega(U + D)\right]\mathbf{x}^{(k)} + \omega\mathbf{b} \tag{15}$$

成分表示すれば、

$$a_{ii}\mathbf{x}_i^{(k+1)} = -\omega\sum_{j=1}^{i-1} a_{ij}\mathbf{x}_j^{(k+1)} + (1-\omega)a_{ii}\mathbf{x}_i^{(k)} - \omega\sum_{j=i+1}^{n} a_{ij}\mathbf{x}_j^{(k)} + \omega\mathbf{b}_i \tag{16}$$

緩和係数は問題に応じて選択される。

4 課題 1

$$\begin{pmatrix} 10 & 1 & 4 & 0 \\ 1 & 10 & 5 & -1 \\ 4 & 5 & 10 & 7 \\ 0 & -1 & 7 & 9 \end{pmatrix}\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 15 \\ 15 \\ 26 \\ 15 \end{pmatrix} \tag{17}$$

$$\begin{pmatrix} 10 & 1 & 4 & 0 \\ 1 & 10 & 5 & -1 \\ 4 & 5 & 10 & 7 \\ 0 & -1 & 7 & 9 \end{pmatrix}\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 16 \\ 16 \\ 25 \\ 16 \end{pmatrix} \tag{18}$$

の解を Gauss の消去法を用いて求める。

4.1 単精度と倍精度

4.2 計算精度

5 課題 2

$$\begin{pmatrix} 1 & -1 & 0 & 0 \\ -1 & 2 & -1 & 0 \\ 0 & -1 & 0 & -1 \\ 0 & 0 & -1 & 2 \end{pmatrix}\begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} \tag{19}$$

の解を SOR 法を用いて求める。

5.1　解と反復係数

6　プログラム

ソースコードを添付しますが、全て https://github.com/tychy/NumericalAnalysisPlayground にあります。各関数のテストもついています。

ソースコード 1　スクリプトファイル名

```python
import numpy as np


def scale(A, x):
    scale_ls = np.zeros_like(x)
    for i in range(A.shape[0]):
        max_idx = 0
        for j in range(A.shape[0]):
            if np.abs(A[i, j]) > np.abs(A[i, max_idx]):
                max_idx = j
        scale_ls[i] = np.abs(A[i, max_idx])
        x[i] = x[i] / np.abs(A[i, max_idx])
        A[i, :] = A[i, :] / np.abs(A[i, max_idx])
    return scale_ls


def pivot(A, x, idx):
    max_idx = idx
    for i in range(idx, A.shape[0]):
        if A[idx, i] > A[idx, max_idx]:
            max_idx = i
    if max_idx != idx:
        buff = np.copy(A[max_idx, :])
        A[max_idx, :] = A[idx, :]
        A[idx, :] = buff
        buffx = x[max_idx]
        x[max_idx] = x[idx]
        x[idx] = buffx
    return


def execute(A, b):
    assert A.shape[0] == A.shape[1], "A must be n * n"
    assert A.shape[0] == b.shape[0], "size of A and b must match"
    print("A:", A)
    print("b:", b)
    L = np.zeros_like(A)
    for i in range(A.shape[0]):
        L[i, i] = 1
    scale_ls = scale(A, b)
    print("Scaled A:", A)

    pivot(A, b, 0)
    for i in range(1, A.shape[0]):
        pivot(A, b, i)
        for j in range(i, A.shape[0]):
```

```
            coef = A[j][i - 1] / A[i - 1][i - 1]
            A[j, :] = A[j, :] - A[i - 1, :] * coef
            b[j] = b[j] - b[i - 1] * coef
            L[j, i - 1] = coef
    x = np.zeros_like(b)
    print("L:", L)
    for i in range(A.shape[0] - 1, -1, -1):
        x[i] += b[i]
        for j in range(i, A.shape[0] - 1):
            x[i] -= A[i][j + 1] * x[j + 1]
        x[i] /= A[i][i]
    print("x:", x)
    for i in range(A.shape[0]):
        A[i, :] = A[i, :] * scale_ls[i]

    return x, L, A


def single(A, b):
    print("-----single-----")
    A_copy = np.copy(A).astype(np.float32)
    b_copy = np.copy(b).astype(np.float32)
    x, L, U = execute(A_copy, b_copy)
    print("A * x:", A @ x.T)
    print("-----END-----")


def double(A, b):
    print("double")

    A_copy = np.copy(A).astype(np.float64)
    b_copy = np.copy(b).astype(np.float64)
    x, L, U = execute(A_copy, b_copy)
    print("A * x:", A @ x.T)
    print("-----END-----")


if __name__ == "__main__":
    A = np.array(
        [
            [10.0, 1.0, 4.0, 0.0],
            [1.0, 10.0, 5.0, -1.0],
            [4.0, 5.0, 10.0, 7.0],
            [0.0, -1.0, 7.0, 9.0],
        ],
    )
    b = np.array([15.0, 15.0, 26.0, 15.0])
    c = np.array([16.0, 16.0, 25.0, 16.0])

    single(A, b)
    double(A, b)
    single(A, c)
    double(A, c)
```

ソースコード 2　スクリプトファイル名

```
```

参考文献

[1] 石原卓水島二郎. 理工学のための数値計算法. 2002.