4. Получение решения линейной модели (построение матричной экспоненты и интеграла от неё)

Андрей Бареков Ярослав Пылаев
По лекциям Устинова С.М.

February 28, 2020

1 Получение решения линейной модели

Рассмотрим линейную динамическую модель

$$\frac{dx}{dt} = Ax + b \tag{1}$$

Для решения системы (1) можно было использовать стандартные программы решения дифференциальных уравнений (например, `RKF45`), однако для линейных систем можно предложить специальный алгоритм, который эффективно работает в т.ч. для жёстких систем.
Точное решение системы (1) имеет вид[1]:

$$x(t) = e^{At}x_0 + \int_0^t e^{A\tau}\,d\tau \times b \tag{2}$$

Воспользоваться разложением в ряд для построения e^{At} затруднительно, т.к. нужно изменять t. Использование формулы Лагранжа-Сильвестра даже для матрицы средней размерности требует расчёта собственных значений и векторов и использования громоздких формул.
Поэтому на практике используют следующий подход:
Пусть H - желаемый шаг визуализации решения (шаг печати)[2]. Запишем решение (2) в точке $t + H$:

$$x(t+H) = e^{A(t+H)}x_0 + \int_0^{t+H} a^{A\tau}\,d\tau \times b \tag{3}$$

Умножим 2 на e^{AH} и вычтем из уравнения 3: $\tau + H = \tau^*$

$$\begin{aligned}
x(t+H) - e^{AH}x(t) &= \int_0^{t+H} e^{A\tau}\,d\tau \times b - \int_0^t e^{A(\tau+H)}\,d\tau \times b \\
&= \int_0^{t+H} e^{A\tau}\,d\tau \times b - \int_H^{t+H} e^{A\tau^*}\,d\tau^* \times b \\
&= \int_0^H e^{A\tau}\,d\tau \times b
\end{aligned}$$

$$x(t+H) = e^{AH}x(t) + \int_0^H e^{A\tau}\,d\tau \times b \tag{4}$$

Теперь необходимо **однократно** построить матричную экспоненту e^{AH} и её интеграл, а затем решить уравнение (4) пошаговым методом.
Матрицу e^{AH} можно было бы построить разложением в ряд, однако, по

[1]Из курса вычислительной математики, №18
[2]В.м., h_{print} из RKF45, №26

второй теореме о матричных функциях[3]:

$$A = U\Lambda U^{-1}$$
$$f(A) = Uf(\Lambda)U^{-1}$$
$$e^{AH} = U\begin{pmatrix} f(\lambda_1) & 0 & \cdots & 0 \\ 0 & f(\lambda_2) & \cdots & 0 \\ \cdots & \cdots & \cdots & \cdots \\ 0 & 0 & \cdots & f(\lambda_n) \end{pmatrix} U^{-1} = U\begin{pmatrix} e^{\lambda_1 H} & 0 & \cdots & 0 \\ 0 & e^{\lambda_2 H} & \cdots & 0 \\ \cdots & \cdots & \cdots & \cdots \\ 0 & 0 & \cdots & e^{\lambda_n H} \end{pmatrix} U^{-1}$$

Использование разложения в ряд e^{AH} сводится к разложению в ряд скалярных функций $f(\lambda_k) = e^{\lambda_k H}$

Пример:

$$e^{-0.1} = 1 - 0.1 + \frac{0.01}{2} - \frac{0.001}{6} + \frac{0.0001}{24} + \ldots$$
$$e^{-10} = 1 - 10 + \frac{100}{2} - \frac{1000}{6} + \frac{10^4}{24} + \ldots$$

При разложении в ряд малое число слагаемых будет только при $|\lambda_k H \approx 1|$, а если система жёсткая, то это требует очень маленького шага

Проблема:

Умею строить разложение в ряд e^{Ah} при малых h с небольшим кол-вом слагаемых. Как построить e^{AH} при большом H?
Получить e^{AH} можно, используя процедуру удвоения шага.

$$x(t+H) = \varphi(AH)x(t) + g(H), \quad g(H) = \int_0^H e^{A\tau}\, d\tau \times b \tag{4*}$$
$$\varphi(2h) = \varphi(h) \times \varphi(h) \tag{5}$$

Используя формулу (5) S раз, получаем $\varphi(AH)$, $H = 2^S \times h$
Для вектора $g(H)$ также существует процедура удвоения шага: $\tau = \tau^* + h$

$$\begin{aligned} g(2h) = \int_0^{2h} e^{A\tau}\, d\tau \times b &= \int_0^h e^{A\tau}\, d\tau \times b + \int_h^{2h} e^{A\tau}\, d\tau \times b \\ &= g(h) + e^{Ah}\int_0^h e^{A\tau^*}\, d\tau^* \times b = (E + \varphi(Ah))g(h) \end{aligned}$$
$$g(2h) = (E + \varphi(Ah))g(h) \tag{6}$$

$\varphi(Ah)$ и $g(h)$ находим разложением в ряд с небольшим количеством слагаемых:

$$\varphi(Ah) = E + Ah + \frac{A^2h^2}{2!} + \frac{A^3h^3}{3!} + \ldots^{[4]} \tag{7}$$

[3] В.м., №17
[4] ряд для экспоненты

$$\varphi(Ah) = hE + \frac{Ah^2}{2!} + \frac{A^2h^3}{3!} + \dots^{[5]} \qquad (8)$$

Вместо λ_k можно использовать норму - $h\|A\| \approx 1$

Детализируем алгоритм по шагам:

1. Задаёмся желаемым значением H, выбираем минимальное целое значение S, такое, что $h = \frac{H}{2^S} < \frac{1}{\|A\|}$
2. Для h строим $\varphi(Ah)$ и $g(h)$ по формулам (7) и (8) с небольшим количеством слагаемых
3. S раз используем формулы (5) и (6) удвоения шага и получаем матрицу $\varphi(AH)$ и $g(H)$
4. Решаем уравнение (4*) пошаговым методом.

Входные параметры программы следующие:

- `N` - размер матрицы
- `A` - сама матрица
- `B` - вектор b
- `X` - начальное приближение x
- `H` - желаемый шаг визуализации решения

В списке параметров отсутствуют ε_A и ε_R. В отсутствие ошибок округления погрешность возникает только в формулах (7) и (8), которые могут быть реализованы с любой степенью точности. Степень жёсткости системы проявляется только в величине S.

2 Некоторые свойства собственных векторов матриц A и A^T

$$A \to \lambda_k, U_k$$
$$A^T \to \lambda_k, V_k$$

$$AU_k = \lambda_k U_k \qquad (1)$$
$$A^T V_i = \lambda_i V_i$$

[5]получается интегрированием ряда для экспоненты

$$V_i^T A = \lambda_i V_i^T \tag{2}$$

Умножим уравнение (1) слева на V_i^T, а уравнение (2) справа на U_k. Вычитаем результаты:

$$0 = (\lambda_k - \lambda_i) V_i^T U_k$$

Если $i \neq k$, то:

$$V_i^T \times U_k = 0 \tag{*!}$$

Если V_i и U_k вещественные, то собственные векторы для A^T и A, относящиеся к различным λ_k, ортогональные.

2.1 Формула Лагранжа-Сильвестра

Формула (*!) позволяет записать формулу Лагранжа-Сильвестра в более компактном виде.

$$f(A) = \sum_{k=1}^{N} T_k f(\lambda_k), T_k = \frac{(A - \lambda_1 E) \ldots (A - \lambda_{k-1} E)(A - \lambda_{k+1} E) \ldots (A - \lambda_n E)}{(\lambda_k - \lambda_1) \ldots (\lambda_k - \lambda_{k-1})(\lambda_k - \lambda_{k+1}) \ldots (\lambda_k - \lambda_n)}.$$

Умножим $T_k \times U_i \, (k \neq i)$. Скобку $(A - \lambda_i E)$ в числителе поставим последней.

$$(A - \lambda_i E) U_i = 0 \Rightarrow T_k U_i = 0,\, k \neq i$$

Умножим $T_k \times U_k$. Последовательным умножением скобок на U_k убеждаемся в том, что $T_k U_k = U_k$.

Пусть z - первая строчка матрицы T_k. Разложим этот вектор по векторам V_i^T:

$$z = \alpha_1 V_1^T + \alpha_2 V_2^T + \cdots + \alpha_N V_N^T$$

Умножаем $z \times U_i \, (k \neq i)$. $\alpha_i V_i^T U_i = 0,\, i \neq k$ Таким образом, первая строчка T_k содержит только одно слагаемое - $\alpha_k V_k^T$. Аналогичный вид будут иметь все остальные строки матрицы T_k. Матрица T_k имеет ранг 1, и её можно записать в виде:

$$T_k = C_k \times V_k^T$$

, где вектор C_k содержит множители каждой строки. Нормируем векторы V_k и U_k так, чтобы $V_k^T U_k = 1$.

Тогда $T_k U_k = C_k \underbrace{V_k^T U_k}_{1} = C_k = U_k$.

Таким образом матрица T_k имеет вид $T_k = U_k V_k^T$, и формула Лагранжа-Сильвестра приобретает следующий вид:

$$f(A) = \sum_{k=1}^{N} U_k V_k^T f(\lambda_k)$$