

Kap. 4 Direkte numer. Verfahren zur Lsg. von lin. Glde. Systemen

Sehr vielfältige Anwendungen:

z.B. Diskretisierung von DGL

lin. Ausgleichsrechnung

Lsg. nicht lin. Glde. Systeme

...

Betrachte $Ax = b$, $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$, $x \in \mathbb{R}^n$
 $b \in \mathbb{R}^n$

hat für alle $b \in \mathbb{R}^n$ eindeutige Lsg.

\Leftrightarrow A injektiv, d.h. $Ax = 0$ (homogenes System) nur trivial ($x=0$) lösbar

\Leftrightarrow $\text{rang}(A) = n$ (Vollrangbed.)

\Leftrightarrow $\det A \neq 0$ (A regulär)

§ 4.1 Kondition von LGS

Betrachte Norm $\|x\|$ auf \mathbb{R}^n und zugeordnete Matrixnorm $\|A\|$ (Operatornorm), reguläre Matrix A .

Betrachte zunächst "Störungen" der rechten Seite $b + \Delta b$ von $Ax = b$.

Satz 4.1 (Störungen in b)

Sei $x + \Delta x$ die Lsg. von $A(x + \Delta x) = b + \Delta b$.

Dann gilt

$$\frac{\|\Delta x\|}{\|x\|} \leq \|A\| \cdot \|A^{-1}\| \cdot \frac{\|\Delta b\|}{\|b\|}$$

für Lsg. x von $Ax = b$

Bew. :

$$A(x + \Delta x) = b + \Delta b \Leftrightarrow A \Delta x = \Delta b \Leftrightarrow \Delta x = A^{-1} \Delta b$$

$$\text{also } \|\Delta x\| = \|A^{-1} \Delta b\| \leq \|A^{-1}\| \cdot \|\Delta b\|.$$

$$\text{Wg. } \|b\| = \|Ax\| \leq \|A\| \cdot \|x\|$$

$$\text{gilt } \frac{1}{\|x\|} \leq \frac{\|A\|}{\|b\|}.$$

$$\begin{aligned} \text{Insgesamt } \frac{\|\Delta x\|}{\|x\|} &= \|\Delta x\| \cdot \frac{1}{\|x\|} \\ &\leq \|A^{-1}\| \cdot \|\Delta b\| \cdot \frac{\|A\|}{\|b\|} \\ &= \|A\| \cdot \|A^{-1}\| \cdot \frac{\|\Delta b\|}{\|b\|} \end{aligned}$$

Def. 4.2 (Kl. Konditionszahl LGS)

$$\kappa(A) := \|A\| \cdot \|A^{-1}\|$$

Satz 4.3

$$\text{Sei } \kappa(A) \cdot \frac{\|\Delta A\|}{\|A\|} < 1. \quad x \text{ Lsg. von } Ax = b$$

$x + \Delta x$ Lsg. von $(A + \Delta A)(x + \Delta x) = (b + \Delta b)$

Dann gilt:

$$\frac{\|\Delta x\|}{\|x\|} \leq \frac{\kappa(A)}{(1 - \kappa(A) \frac{\|\Delta A\|}{\|A\|})} \cdot \left(\frac{\|\Delta A\|}{\|A\|} + \frac{\|\Delta b\|}{\|b\|} \right)$$

Bem. 4.4 : Im Rechner wg. Rundungsfehler

$$\frac{\|\Delta x\|}{\|x\|} \frac{\|\Delta A\|}{\|A\|} \leq \epsilon \text{ PS} \quad \rightarrow \text{ Fehler bei}$$

nimmgr. LGS-Lsg. in n -ten Ordnung

$$\kappa(A) \cdot \epsilon \text{ PS}$$

Präkonditionierung:

Verbesserung der Matrixkondition durch

z. B. Zeilen skalierung $A = (a_{ij})_{\substack{1 \leq i \leq n \\ 1 \leq j \leq n}}$

$$D_z := \text{diag}(d_1, \dots, d_n)^{-1}$$

$$d_i := \left(\sum_{j=1}^n |a_{ij}| \right)^{-1}$$

$$\| \mathbb{R}_\infty(D_z A) \| \leq \| \mathbb{R}_\infty(DA) \|$$

+ Diagonalmatrix D

(Konditionsminimierung bzgl.

$\| \cdot \|_\infty$ -Norm)

§ 4.2 Nümer. Lsg. von LGS:

Größ-Verfahren und LR-Zerlegung
(Faktorisierung)

Naheliegende Variante „Cramersche Regel“

$$x_j = \frac{\det A_j}{\det A} \text{ ungeeignet, da kombinatorische Komplexität (n! Operationen)}$$

Bei Anwendung Laplace'scher Entwicklungssatz/.

- Beurteilung der Verfahren nach Effizienz (Rechenaufwand, Speicherbedarf) und Stabilität (Konditionsverfälschung) sowie Stabilitätsauswertung (bei großen Problemen)

Konzept aller nümer. Verfahren zur Lsg. von LGS:

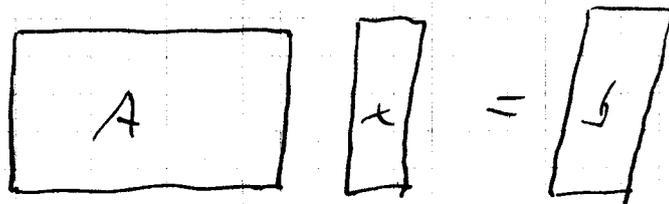
$$Ax = b \Leftrightarrow CAx = Cb$$

falls C regulär

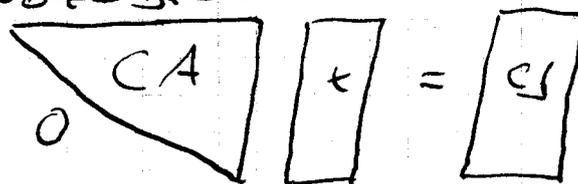
$CAx = Cb$ „leicht lösbar“

Ziel der LR-Zerlegung: Dreiecksmatrizen

$$Ax = b$$


$$A \cdot x = b$$

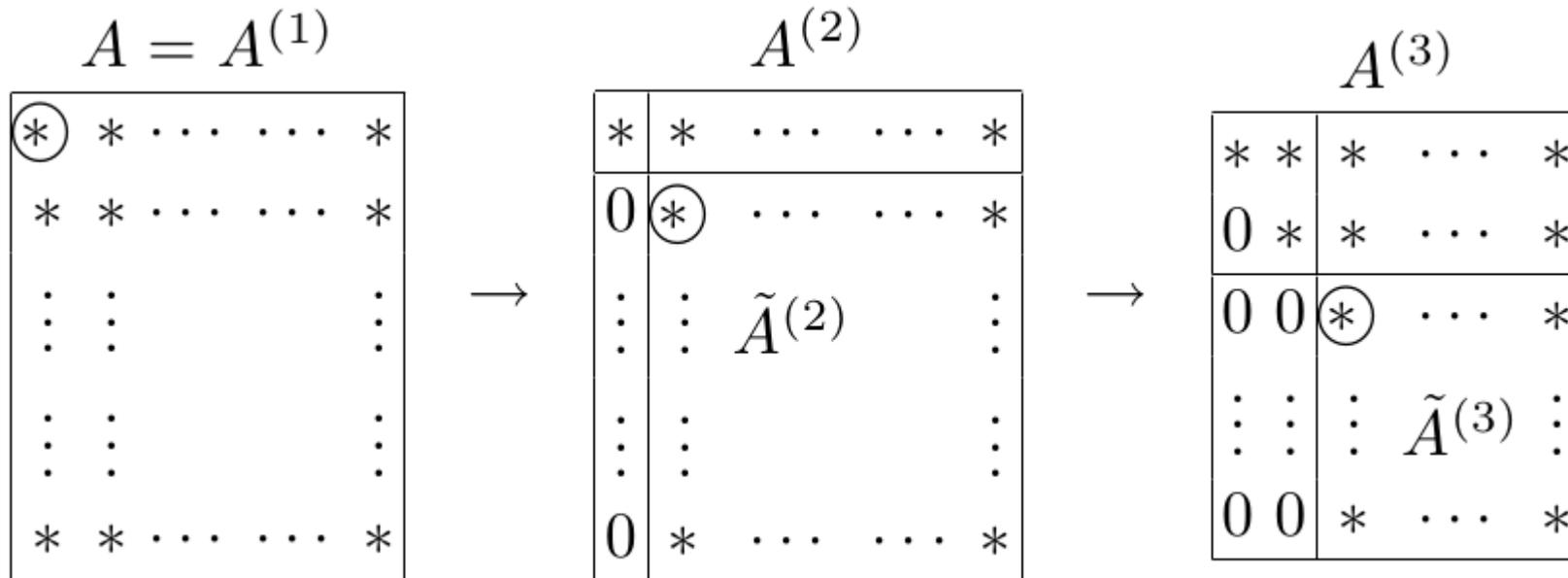
obere Dreiecksmatrix


$$CA \cdot x = cb$$

→ Lsg. durch Rückwärts einsetzen

Gauss'sches Eliminationsverfahren und LR -Zerlegung

$$Ax = b \quad (\det A \neq 0)$$



$a(j,j)$: Pivotelement, Annahme: $a(j,j)$ ungleich 0 !

Beispiel:

$$\begin{pmatrix} 2 & -1 & -3 & 3 \\ 4 & 0 & -3 & 1 \\ 6 & 1 & -1 & 6 \\ -2 & -5 & 4 & 1 \end{pmatrix} x = \begin{pmatrix} 1 \\ -8 \\ -16 \\ -12 \end{pmatrix}.$$

Zusammenfassen:

$$(A \ b) = \begin{pmatrix} 2 & -1 & -3 & 3 & 1 \\ 4 & 0 & -3 & 1 & -8 \\ 6 & 1 & -1 & 6 & -16 \\ -2 & -5 & 4 & 1 & -12 \end{pmatrix}.$$

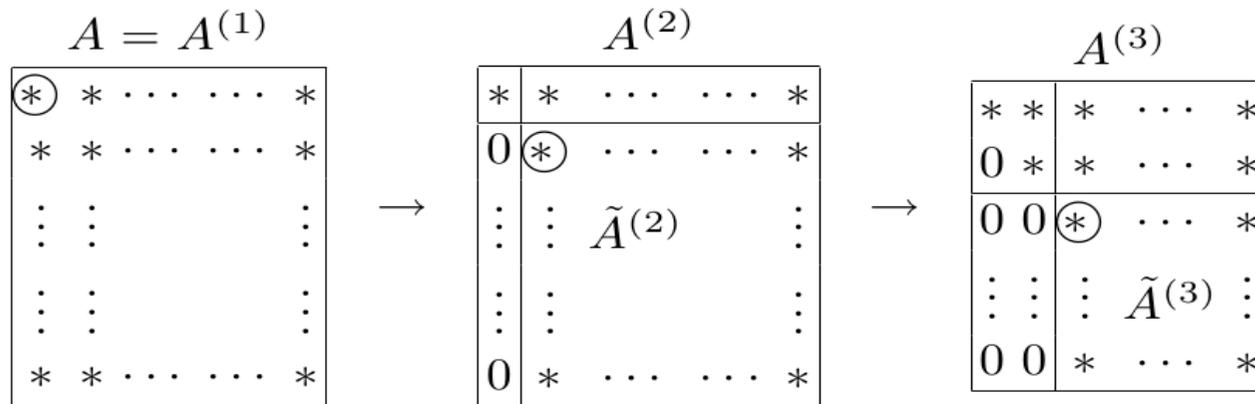
Durch die Gauß-Elimination ohne Pivotisierung wird dieses System überführt in

$$\begin{array}{l} j = 1 \\ \longrightarrow \\ l_{2,1} = \frac{4}{2} \\ l_{3,1} = \frac{6}{2} \\ l_{4,1} = \frac{-2}{2} \end{array} \begin{pmatrix} 2 & -1 & -3 & 3 & 1 \\ 0 & 2 & 3 & -5 & -10 \\ 0 & 4 & 8 & -3 & -19 \\ 0 & -6 & 1 & 4 & -11 \end{pmatrix} \begin{array}{l} j = 2 \\ \longrightarrow \\ l_{3,2} = \frac{4}{2} \\ l_{4,2} = \frac{-6}{2} \end{array} \begin{pmatrix} 2 & -1 & -3 & 3 & 1 \\ 0 & 2 & 3 & -5 & -10 \\ 0 & 0 & 2 & 7 & 1 \\ 0 & 0 & 10 & -11 & -41 \end{pmatrix}$$

$$\begin{array}{l} j = 3 \\ \longrightarrow \\ l_{4,3} = \frac{10}{2} \end{array} \begin{pmatrix} 2 & -1 & -3 & 3 & 1 \\ 0 & 2 & 3 & -5 & -10 \\ 0 & 0 & 2 & 7 & 1 \\ 0 & 0 & 0 & -46 & -46 \end{pmatrix} = (R \ c).$$

Frobenius-Matrix

$$L_k = \begin{pmatrix} 1 & & & & & \\ & \ddots & & & & \\ & & 1 & & & \\ & & -\ell_{k+1,k} & 1 & & \\ & \emptyset & \vdots & & \ddots & \\ & & -\ell_{n,k} & \emptyset & & 1 \end{pmatrix}$$



$$L_j A^{(j)} = A^{(j+1)}$$

$$\underbrace{L_{n-1} L_{n-2} \cdots L_1 A}_{=A^{(n)}=:R} x = \underbrace{L_{n-1} L_{n-2} \cdots L_1 b}_{=:c}$$

LR-Zerlegung

$$A = L_1^{-1} L_2^{-1} \cdots L_{n-1}^{-1} R =: LR$$

R: obere Dreiecksmatrix

$$L_1^{-1} L_2^{-1} \cdots L_{n-1}^{-1} = \begin{pmatrix} 1 & & & \\ \ell_{2,1} & \ddots & & \\ \vdots & \ddots & \ddots & \\ \ell_{n,1} & \cdots & \ell_{n,n-1} & 1 \end{pmatrix}$$

L: untere Dreiecksmatrix

Achtung!

$$\begin{pmatrix} 0.00031 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -3 \\ -7 \end{pmatrix}$$

Mit $\ell_{2,1} = 1/0.00031$ ergibt Gauß-Elimination

$$(R \ c) = \left(\begin{array}{cc|c} 0.00031 & 1 & -3 \\ 0 & 1 - \frac{1}{0.00031} & -7 - \frac{-3}{0.00031} \end{array} \right).$$

Bei 4-stelliger Rechnung würde sich daraus

$$\left(\begin{array}{cc|c} 0.00031 & 1 & -3 \\ 0 & -3225 & 9670 \end{array} \right)$$

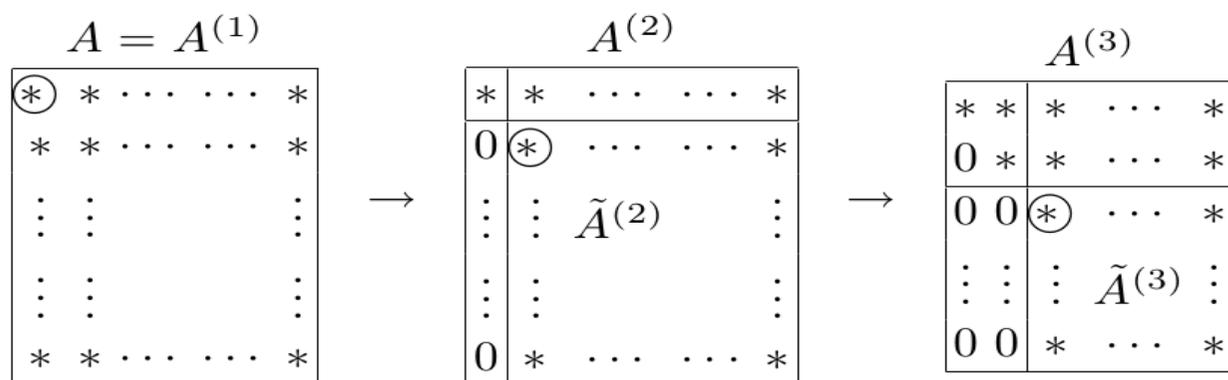
ergeben. Rückwärtseinsetzen liefert dann

$$\tilde{x}_1 \approx -6.452, \quad \tilde{x}_2 \approx -2.998.$$

Exakte Rechnung ergibt allerdings

$$x_1 = -4.00124\dots, \quad x_2 = -2.998759\dots,$$

Nach obigen Überlegungen ist es also nicht sinnvoll, nur dann Gleichungen (Zeilen in der Matrix) zu vertauschen, wenn ein Nulleintrag dies erzwingt. Stattdessen setzt man *stets* bei der Berechnung der Matrix $A^{(j+1)}$ aus $A^{(j)}$ ein *betragsgrößtes* Element in der ersten Spalte der verbleibenden $(n - j + 1) \times (n - j + 1)$ -Untermatrix an die (j, j) -Pivotposition. Da man das j -te Pivotelement in der j -ten Spalte sucht, nennt man diesen Vertauschungsvorgang *Spaltenpivotisierung*. Die Matrix sollte zuvor äquilibriert werden.



Spaltenpivotisierung

Permutationsmatrix

$$P_{i,k}$$

$$P_{2,4} = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 \end{pmatrix}$$

$$\hat{A}^{(j)} := P_{\tau_j} A^{(j)}$$

$$|\hat{a}_{j,j}^{(j)}| \geq \max_{i>j} |\hat{a}_{i,j}^{(j)}|$$

Satz 4.5 Zu jeder nichtsingulären Matrix A existiert eine Permutationsmatrix P , eine (dazu) eindeutige untere normierte Dreiecksmatrix L , deren Einträge sämtlich betragsmäßig durch eins beschränkt sind, und eine eindeutige obere Dreiecksmatrix R , so daß

$$PA = LR.$$

Die Matrizen P, L und R ergeben sich aus der Gauß-Elimination mit Spaltenpivotisierung.

Der Rechenaufwand für die LR -Zerlegung über Gauß-Elimination mit Spaltenpivotisierung beträgt ca.

$$\frac{1}{3}n^3 \text{ Operationen.}$$



Die Skalierung (falls nötig) kostet nur $\mathcal{O}(n^2)$ Operationen.

$$PA = LR$$

Die Lösung von

$$Ax = b$$

ergibt sich über die Lösung zweier Dreieckssysteme

$$\begin{aligned} Ax = b &\iff PAx = Pb \iff LRx = Pb \\ &\iff Ly = Pb \text{ und } Rx = y. \end{aligned}$$



Obere Dreiecksmatrix ergibt man durch
Gauß'sches Elem.-Verfahren

→ Folien Gauss + LR-Zerlegung

§ 4.3 Cholesky-Zerlegung

Satz 4.6 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ symmetrisch pos. definit
(s.p.d.), falls

$$A^T = A$$

$$\text{und } x^T A x > 0 \quad \forall x \in \mathbb{R}^n, x \neq 0$$

Satz 4.7 Sei $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ s.p.d., dann

- A invertierbar und A^{-1} s.p.d.
- A hat n strikt pos. reelle Eigenwerte
- A hat n " " Diagonaleinträge
und betragsgrößte Einträge auf
Diagonalen

→ Gauss-Elem. ohne Pivoting möglich
und "Symmetrieerhaltung":

wenn $L_1 A = \begin{pmatrix} a_{11} & \dots & a_{1n} \\ 0 & \boxed{A^{(2)}} \\ \vdots & & \\ 0 & & \end{pmatrix}$, dann

$$L_1 A L_1^T = \begin{pmatrix} a_{11} & 0 & \dots & 0 \\ 0 & \boxed{A^{(2)}} \\ \vdots & & & \\ 0 & & & \end{pmatrix} = J\text{-Matr}$$

Satz 4.8 Jede s.p.d. Matrix $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ besitzt
eindeutige Zerlegung

$$A = L D L^T$$

mit Diagonalmatrix $J = \text{diag}(d_i) \quad i=1, \dots, n$
 $d_i > 0, \quad i=1, \dots, n$

§ 4.3 Cholesky-Zerlegung

Def. 4.6 $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ symmetrisch
positiv definit (s.p.d.), falls

$$A^T = A$$

und $x^T A x > 0$ für alle
 $x \in \mathbb{R}^n, x \neq 0$

Satz 4.7 Sei $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ s.p.d., dann

a) A regulär und A^{-1} s.p.d.

b) A hat nur strikt pos. Eigenwerte
(keine)

c) A hat mit strikt pos. Diagonaleinträge und der betragsgrößte Eintrag steht auf der Diagonalen

→ Gauß-Elimination (LR-Zerlegung) ist ohne Pivotisierung möglich und erlaubt Symmetrieausnutzung

$$\text{wenn } L_n A = \begin{pmatrix} a_{11} & \dots & a_{1n} \\ 0 & \boxed{A^{(2)}} \\ \vdots & & \\ 0 & & \end{pmatrix}, \text{ dann}$$

$$L_n A L_n^T = \begin{pmatrix} a_{11} & 0 & \dots & 0 \\ 0 & \boxed{\tilde{A}^{(2)}} \\ \vdots & & & \\ 0 & & & \end{pmatrix}. \text{ daher}$$

Satz 4.8 : Jede s.p.d. Matrix $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$

besitzt eine eindeutige Zerlegung

$$A = L \cdot D \cdot L^T$$

mit Diagonalmatrix $D = \text{diag}(d_i)$

$$i = 1, \dots, n \quad d_i > 0, \quad i = 1, \dots, n$$

Cholesky-Verfahren

$$A = \begin{pmatrix} 2 & 6 & -2 \\ 6 & 21 & 0 \\ -2 & 0 & 16 \end{pmatrix}, L = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ \ell_{2,1} & 1 & 0 \\ \ell_{3,1} & \ell_{3,2} & 1 \end{pmatrix}, D = \begin{pmatrix} d_{1,1} & 0 & 0 \\ 0 & d_{2,2} & 0 \\ 0 & 0 & d_{3,3} \end{pmatrix}.$$

Es gilt

$$\begin{aligned} LDL^T &= \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ \ell_{2,1} & 1 & 0 \\ \ell_{3,1} & \ell_{3,2} & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} d_{1,1} & 0 & 0 \\ 0 & d_{2,2} & 0 \\ 0 & 0 & d_{3,3} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & \ell_{2,1} & \ell_{3,1} \\ 0 & 1 & \ell_{3,2} \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} d_{1,1} & 0 & 0 \\ \ell_{2,1}d_{1,1} & d_{2,2} & 0 \\ \ell_{3,1}d_{1,1} & \ell_{3,2}d_{2,2} & d_{3,3} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & \ell_{2,1} & \ell_{3,1} \\ 0 & 1 & \ell_{3,2} \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}. \end{aligned}$$

Die elementweise Auswertung der Gleichung $LDL^T = A$, die man aufgrund der Symmetrie auf den unteren Dreiecksteil beschränken kann, ergibt

$$j = 1: (1,1)\text{-Element: } d_{1,1} = a_{1,1} = 2 \quad \Longrightarrow \quad \boxed{d_{1,1} = 2}$$

$$(2,1)\text{-Element: } \ell_{2,1}d_{1,1} = a_{2,1} = 6 \quad \Longrightarrow \quad \ell_{2,1} = 6/2 \quad \Longrightarrow \quad \boxed{\ell_{2,1} = 3}$$

$$(3,1)\text{-Element: } \ell_{3,1}d_{1,1} = a_{3,1} = -2 \quad \Longrightarrow \quad \ell_{3,1} = -2/2 \\ \Longrightarrow \quad \boxed{\ell_{3,1} = -1}$$

$$\begin{aligned}
 A = \begin{pmatrix} 2 & 6 & -2 \\ 6 & 21 & 0 \\ -2 & 0 & 16 \end{pmatrix} \quad LDL^T &= \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ \ell_{2,1} & 1 & 0 \\ \ell_{3,1} & \ell_{3,2} & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} d_{1,1} & 0 & 0 \\ 0 & d_{2,2} & 0 \\ 0 & 0 & d_{3,3} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & \ell_{2,1} & \ell_{3,1} \\ 0 & 1 & \ell_{3,2} \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \\
 &= \begin{pmatrix} d_{1,1} & 0 & 0 \\ \ell_{2,1}d_{1,1} & d_{2,2} & 0 \\ \ell_{3,1}d_{1,1} & \ell_{3,2}d_{2,2} & d_{3,3} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & \ell_{2,1} & \ell_{3,1} \\ 0 & 1 & \ell_{3,2} \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}.
 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned}
 j = 2: (2,2)\text{-Element: } \ell_{2,1}^2 d_{1,1} + \boxed{\phantom{d_{2,2}}} &= a_{2,2} = 21 \quad \implies \quad d_{2,2} = 21 - 3^2 * 2 \\
 &\implies \quad \boxed{d_{2,2} = 3}
 \end{aligned}$$

$$(3,2)\text{-Element: } \ell_{3,1}d_{1,1}\ell_{2,1} + \ell_{3,2}d_{2,2} = a_{3,2} = 0$$

$$\implies \ell_{3,2} = -(-1) * 2 * 3/3 \quad \implies \quad \boxed{\ell_{3,2} = 2}$$

$$j = 3: (3,3)\text{-Element: } \ell_{3,1}^2 d_{1,1} + \ell_{3,2}^2 d_{2,2} + d_{3,3} = a_{3,3} = 16$$

$$\implies d_{3,3} = 16 - (-1)^2 * 2 - 2^2 * 3 \implies \quad \boxed{d_{3,3} = 2}$$

$$\implies L = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 3 & 1 & 0 \\ -1 & 2 & 1 \end{pmatrix}, \quad D = \begin{pmatrix} 2 & 0 & 0 \\ 0 & 3 & 0 \\ 0 & 0 & 2 \end{pmatrix}.$$

Man kann das Cholesky-Verfahren mit ca. $\frac{1}{6}n^3$ Multiplikationen und etwa ebenso vielen Additionen realisieren. Der Rechenaufwand beträgt also etwa die Hälfte des Aufwands der Standard- LR -Zerlegung.

Die Lösung des Problems $Ax = b$ reduziert sich

$$Ly = b, \quad DL^T x = y, \quad \text{d. h. } L^T x = D^{-1}y.$$

§ 4.4 Stabilität von LR-Zerlegung und Cholesky

Cholesky-Verfahren: Realisierung auf
einem Rechner, man kann zeigen:
berechnete Lsg. \bar{x} ist Lsg. eines
(numerisch)

gestörten Systems $(A + \Delta A) \bar{x} = b$

$$\text{mit } \frac{\|\Delta A\|_{\infty}}{\|A\|_{\infty}} \leq c_n \cdot \epsilon_{PS}$$

(n. Matrixdimension)

Wg. Satz (4.3) gilt

$$\frac{\|x - \bar{x}\|_{\infty}}{\|x\|_{\infty}} \leq \underbrace{\kappa_{\infty}(A)}_{\text{Konditionszahl}} \cdot c_u \cdot \text{EPS}$$

→ Cholesky ist stabil (da c_u "klein")

– LR-Zerlegung mit Pivottisierung

ist für moderat großen ebenfalls

stabil, jedoch nicht ohne Pivottisierung