

Metodi iterativi per la soluzione di sistemi lineari

Alvise Sommariva

Università degli Studi di Padova
Dipartimento di Matematica

23 aprile 2018

Metodo di Jacobi

Definizione (Metodo di Jacobi, 1846)

Sia $A = D - E - F \in \mathbb{R}^{n \times n}$ dove

- D è una matrice diagonale, non singolare
- E è triangolare inferiore con elementi diagonali nulli,
- F è triangolare superiore con elementi diagonali nulli.

Sia fissato $x^{(0)} \in \mathbb{R}^n$. Il **metodo di Jacobi** genera $\{x^{(k)}\}_k$ con

$$x^{(k+1)} = \phi(x^{(k)}) = M^{-1}Nx^{(k)} + M^{-1}b$$

dove

$$M = D, \quad N = E + F.$$

Si vede che la matrice di iterazione $P = M^{-1}N$ è in questo caso

$$P = I - D^{-1}A. \quad (1)$$

Metodo di Jacobi in Matlab

Un codice gratuito del metodo di Jacobi, è [jacobi.m](#):

```
function [x,error,iter,flag]=jacobi(A,x,b,max_it,tol)
% input
% A, REAL matrix
% x, REAL initial guess vector
% b, REAL right hand side vector
% max_it, INTEGER maximum number of iterations
% tol, REAL error tolerance
% output
% x, REAL solution vector
% error, REAL error norm
% iter, INTEGER number of iterations performed
% flag, INTEGER: 0 = solution found to tolerance
%   1 = no convergence given max_it
iter = 0; flag = 0; % initialization
bnrm2 = norm( b );
if ( bnrm2 == 0.0 ), bnrm2 = 1.0; end
r = b - A*x;
error = norm( r ) / bnrm2;
if ( error < tol ) return, end
[m,n]=size(A);
[ M, N ] = split( A , b, 1.0, 1 ); % matrix splitting
for iter = 1:max_it, % begin iteration
    x_1 = x;
    x = M \ ( N*x + b ); % update approximation
    error = norm( x - x_1 ) / norm( x ); % compute error
    if ( error <= tol ), break, end % check convergence
end
if ( error > tol ) flag = 1; end % no convergence
```

Nota.

- *il comando `break` interrompe esclusivamente il ciclo `for`, mentre il comando `return` non è equivalente in quanto non farebbe uscire solo dal ciclo ma anche dalla routine;*
- *la funzione `split` determina lo splitting di alcuni metodi iterativi; in particolare*

`[ M, N ] = split( A , b, 1.0, 1 )`

esegue lo splitting di Jacobi.

Definizione (Successive over relaxation, (SOR), 1884-1950)

Sia $A = D - E - F \in \mathbb{R}^{n \times n}$ dove

- D è una matrice diagonale, non singolare
- E è triangolare inferiore con elementi diagonali nulli,
- F è triangolare superiore con elementi diagonali nulli.

Sia fissato $x^{(0)} \in \mathbb{R}^n$ e $\omega \in \mathbb{R} \setminus 0$. Il **metodo SOR** genera $\{x^{(k)}\}_k$ con

$$x^{(k+1)} = \phi(x^{(k)}) = M^{-1}Nx^{(k)} + M^{-1}b$$

dove

$$M = \frac{D}{\omega} - E, \quad N = \left(\frac{1}{\omega} - 1\right)D + F$$

Nota.

Gauss-Seidel è SOR in cui si è scelto $\omega = 1$.

Metodo di SOR in Matlab

Una implementazione in Matlab/Octave è [sor.m](#)

```
function [x, error, iter, flag] = sor(A, x, b, w, max_it, tol)
% sor.m solves the linear system Ax=b using the
% Successive Over-Relaxation Method (Gauss-Seidel method when omega = 1 ).
% input
% A, REAL matrix
% x REAL initial guess vector
% b REAL right hand side vector
% w REAL relaxation scalar
% max_it INTEGER maximum number of iterations
% tol REAL error tolerance
% output
% x REAL solution vector
% error REAL error norm
% iter INTEGER number of iterations performed
% flag INTEGER: 0 = solution found to tolerance, 1 = no convergence given max_it
flag = 0; iter = 0;% initialization
bnrm2 = norm( b );
if ( bnrm2 == 0.0 ), bnrm2 = 1.0; end
r = b - A*x;
error = norm( r ) / bnrm2;
if ( error < tol ) return, end
[ M, N, b ] = split( A, b, w, 2 ); % matrix splitting
for iter = 1:max_it % begin iteration
    x_1 = x; x = M \ ( N*x + b ); % update approximation
    error = norm( x - x_1 ) / norm( x ); % compute error
    if ( error <= tol ) break, end % check convergence
end
b = b / w; % restore rhs
if ( error > tol ) flag = 1; end; % no convergence
```

Routine split

La routine `split` chiamata da `jacobi` e `sor`, tratta da Netlib

```
function [ M, N, b ] = split( A, b, w, flag )
% split.m sets up the matrix splitting for the stat.
% iterative methods:jacobi and sor (gauss-seidel, w=1)
% input
% A DOUBLE PRECISION matrix
% b DOUBLE PRECISION right hand side vector (for SOR)
% w DOUBLE PRECISION relaxation scalar
% flag INTEGER flag for method: 1 = jacobi 2 = sor.
% output
% M DOUBLE PRECISION matrix
% N DOUBLE PRECISION matrix such that A = M - N
% b DOUBLE PRECISION rhs vector ( altered for SOR )
[m,n] = size( A );
if ( flag == 1 ), % jacobi splitting
    M = diag(diag(A)); N = diag(diag(A)) - A;
elseif ( flag == 2 ), % sor/gauss-seidel splitting
    b = w * b;
    M = w * tril( A, -1 ) + diag(diag( A ));
    N = -w * triu( A, 1 ) + ( 1.0 - w ) * diag(diag(A));
end;
```

Esercizio in Matlab I

- Si calcoli la matrice simmetrica e definita positiva minij_{20} di ordine 20 aiutandosi con

```
>> help gallery
```

- Sia b il vettore composto di componenti uguali a 1, avente lo stesso numero di righe di P_{20} .
 - Si risolva col metodo di Jacobi il problema $\text{minij}_{20}x = b$, con tolleranza di $10^{(-6)}$, partendo da $x^0 = [0 \dots 0]$. Converge?
 - Si risolva col metodo di SOR con $\omega = 0.01 : 0.01 : 1.99$ il problema $\text{minij}_{20}x = b$, con tolleranza di $10^{(-6)}$, partendo da $x^0 = [0 \dots 0]$.
 - Converge?
 - Eseguire il plot in scala semilogaritmica, avendo in ascisse ω e in ordinate il numero di iterazioni eseguite. Quale sembra un buon parametro da utilizzare?
 - Calcolare il parametro ω che minimizza il numero di iterazioni svolte da SOR.

Il metodo del gradiente coniugato.

Definizione (Gradiente coniugato, Hestenes-Stiefel, 1952)

Il metodo del **gradiente coniugato** è un metodo di discesa

$$x^{(k+1)} = x^{(k)} + \alpha_k p^{(k)}$$

con

- $\alpha_k = \frac{(r^{(k)})^T r^{(k)}}{(p^{(k)})^T A p^{(k)}},$
- $p^{(0)} = r^{(0)},$
- $p^{(k)} = r^{(k)} + \beta_k p^{(k-1)}, \quad k = 1, 2, \dots$
- $\beta_k = \frac{(r^{(k)})^T r^{(k)}}{(r^{(k-1)})^T r^{(k-1)}} = \frac{\|r^{(k)}\|_2^2}{\|r^{(k-1)}\|_2^2}.$

Con questa scelta si prova che $p^{(k)}$ e $p^{(k-1)}$ sono *A-coniugati*.

$$(p^{(k)})^T A p^{(k-1)} = 0.$$

Gradiente coniugato in Matlab

Un codice gratuito del Grad. Coniugato, è [cg.m](#) tratto da Netlib:

```
function [x,error,iter,flag]=cg(A,x,b,M,max_it,tol)
flag = 0; iter = 0; bnorm2 = norm( b );
if ( bnorm2 == 0.0 ), bnorm2 = 1.0; end
r = b - A*x; error = norm( r ) / bnorm2;
if ( error < tol ) return, end
for iter = 1:max_it
    z = M \ r; rho = (r'*z);
    if ( iter > 1 )
        beta = rho / rho_1; p = z + beta*p;
    else
        p = z;
    end
    q = A*p; alpha = rho / (p'*q ); x = x + alpha * p;
    r = r - alpha*q; error = norm( r ) / bnorm2;
    if ( error <= tol ), break, end
    rho_1 = rho;
end
if ( error > tol ) flag = 1; end
```

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

Consideriamo il sistema lineare $Ax = b$ dove A è la matrice tridiagonale a blocchi (di Poisson)

$$A = \begin{pmatrix} B & -I & 0 & \dots & 0 \\ -I & B & -I & \dots & 0 \\ 0 & -I & B & \dots & \dots \\ 0 & \dots & \dots & \dots & -I \\ 0 & 0 & \dots & -I & B \end{pmatrix}$$

con

$$B = \begin{pmatrix} 4 & -1 & 0 & \dots & 0 \\ -1 & 4 & -1 & \dots & 0 \\ 0 & -1 & 4 & \dots & \dots \\ 0 & \dots & \dots & \dots & -1 \\ 0 & 0 & \dots & -1 & 4 \end{pmatrix}$$

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

La matrice A è facilmente disponibile, con il comando `gallery` di Matlab. Vediamo un esempio:

```
>> A=gallery('poisson',3); % A sparse.  
>> A=full(A); % A piena.  
>> A  
A =  
     4     -1      0     -1      0      0      0      0      0  
    -1      4     -1      0     -1      0      0      0      0  
     0     -1      4      0      0     -1      0      0      0  
    -1      0      0      4     -1      0     -1      0      0  
     0     -1      0     -1      4     -1      0     -1      0  
     0      0     -1      0     -1      4      0      0     -1  
     0      0      0     -1      0      0      4     -1      0  
     0      0      0      0     -1      0     -1      4     -1  
     0      0      0      0      0     -1      0     -1      4  
>>
```

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

Evidentemente A è una matrice di Poisson con B matrice quadrata di ordine 3, dove

$$A = \begin{pmatrix} B & -I & 0 & \dots & 0 \\ -I & B & -I & \dots & 0 \\ 0 & -I & B & \dots & \dots \\ 0 & \dots & \dots & \dots & -I \\ 0 & 0 & \dots & -I & B \end{pmatrix}$$

in cui

$$B = \begin{pmatrix} 4 & -1 & 0 \\ -1 & 4 & -1 \\ 0 & -1 & 4 \end{pmatrix}$$

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

Per ulteriori dettagli sulle origini della matrice di Poisson, si considerino ad esempio [1, p. 557], [2, p. 283], [3, p. 334].

Le matrici di Poisson sono

- simmetriche;
- tridiagonali a blocchi;
- diagonalmente dominanti;
- non singolari (deriva dal primo e dal secondo teorema di Gerschgorin [2, p. 76-80], [3, p. 955]);
- definite positive.

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

Per accertarsene, calcoliamo il minimo autovalore della matrice di Poisson con $B \in \mathcal{M}_5$, semplicemente digitando sulla shell di Matlab-Octave

```
>> A=makefish(5);  
>> m=min(eig(A))  
m =  
    0.5359  
>>
```

Tale matrice di Poisson non è malcondizionata essendo

```
>> A=makefish(5);  
>> cond(A)  
ans =  
    13.9282  
>>
```

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

Ora

- poniamo $b = (1, 1, \dots, 1, 1)$ cioè

```
b=ones(size(A,1),1);
```

- risolviamo il sistema $Ax = b$ digitando

```
x_sol=A\b;
```

- nota la soluzione esatta confrontiamo i vari metodi risolvendo il sistema lineare con
 - un numero massimo di iterazioni maxit pari a 200,
 - una tolleranza tol di 10^{-8}

cioè

```
maxit=200; tol=10^(-8);
```

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

A tal proposito consideriamo l'm-file [demo_algebra_lineare](#)

```
maxit=200; tol=10^(-8); siz=5;
A = makefish(siz);      % MATRICE DI POISSON.
b=ones( size(A,1) ,1);  % TERMINE NOTO.
x_sol=A\b;              % SOLUZIONE ESATTA. METODO LU.
norm_x_sol=norm(x_sol);
if norm(x_sol) == 0
    norm_x_sol=1;
end
x=zeros( size(b));      % VALORE INIZIALE.
% JACOBI.
[x_j,error_j,iter_j,flag_j]=jacobi(A,x,b,maxit,tol);
fprintf( '\t \n [JACOBI ][STEP REL., NORMA 2]:%2.2e [REL.ERR.]:%2.2e',error_j,
        norm(x_j-x_sol)/norm_x_sol);
fprintf( '\t \n [ITER.]:%3.0f [FLAG]:%1.0f \n',iter_j,flag_j);
% GAUSS-SEIDEL.
w=1;
[x_gs,error_gs,iter_gs,flag_gs]=sor(A,x,b,w,maxit,tol);
fprintf( '\t \n [GS ][STEP REL., NORMA 2]:%2.2e [REL.ERR.]:%2.2e',error_gs,norm(
        x_gs-x_sol)/norm_x_sol);
fprintf( '\t \n [ITER.]:%3.0f [FLAG]:%1.0f \n',iter_gs,flag_gs);
```

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

```
% SOR.
w_vett=0.8:0.025:2;
for index=1:length(w_vett)
    w=w_vett(index);
    [x_sor,error_sor(index),iter_sor(index),flag_sor(index)] = sor(A,x,b,w,maxit
        ,tol);
    relerr(index)=norm(x_sor-x_sol)/norm_x_sol;
end
[min_iter_sor, min_index]=min(iter_sor);
fprintf('\t \n [SOR OTT.] [STEP REL., NORMA 2]:%2.2e [REL.ERR.]:%2.2e',error_sor(
    min_index),relerr(min_index));
fprintf('\t \n [ITER.]:%3.0f [FLAG]:%1.0f [w]:%2.3f \n',min_iter_sor,flag_sor(
    min_index),w_vett(min_index));
plot(w_vett,iter_sor,'r-');
% GRADIENTE CONIUGATO.
M=eye(size(A));
[x_gc,error_gc,iter_gc,flag_gc]=cg(A,x,b,M,maxit,tol);
fprintf('\t \n [GC][STEP REL., NORMA 2]:%2.2e [REL.ERR.]:%2.2e',error_gc,norm(
    x_gc-x_sol)/norm_x_sol);
fprintf('\t \n [ITER.]:%3.0f [FLAG]:%1.0f \n',iter_gc,flag_gc);
```

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

Lanciamo la demo nella shell di Matlab-Octave e otteniamo

```
>> demo_algebra_lineare

[JACOBI ] [STEP REL., NORMA 2]: 8.73e-009 [REL.ERR.]: 5.65e-008
[ITER.]: 116 [FLAG]: 0

[GAU.SEI.] [STEP REL., NORMA 2]: 9.22e-009 [REL.ERR.]: 2.76e-008
[ITER.]: 61 [FLAG]: 0

[SOR OTT.] [STEP REL., NORMA 2]: 2.31e-009 [REL.ERR.]: 1.10e-009
[ITER.]: 21 [FLAG]: 0 [w]: 1.350

[GC] [STEP REL., NORMA 2]: 4.41e-017 [REL.ERR.]: 2.21e-016
[ITER.]: 5 [FLAG]: 0

>>
```

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

Una breve analisi ci dice che

- Come previsto dalla teoria, il metodo di Gauss-Seidel converge in approssimativamente metà iterazioni di Jacobi;
- Il metodo SOR ha quale costante quasi ottimale $w = 1.350$;
- Il metodo del gradiente coniugato converge in meno iterazioni rispetto agli altri metodi (solo 5 iterazioni, ma si osservi il test d'arresto differente). Essendo la matrice di Poisson di ordine 25, in effetti ciò accade in meno di 25 iterazioni come previsto. Vediamo cosa succede dopo 25 iterazioni:

```
>>> A=gallery('poisson',5);  
>>> A=full(A); b=ones(size(A,1),1);  
>>> maxit=25;tol=0;  
>>> x=zeros(size(b)); M=eye(size(A));  
>>> [x_gc,error_gc,iter_gc,flag_gc]=cg(A,x,b,M,maxit,tol);  
>>> error_gc  
error_gc =  
8.3759e-39
```

Il residuo relativo, seppur non nullo è molto piccolo.

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

Un punto delicato riguarda la **scelta del parametro ω ottimale** ω^* (cioè minimizzante il raggio spettrale di SOR).

Nel nostro codice abbiamo calcolato per forza bruta ω^+ , tra i numeri reali $\omega^+ \leq 2$ del tipo $w_j = 0.8 + j \cdot 0.025$ quello per cui venivano compiute meno iterazioni.

E' possibile **determinare ω^* esplicitamente** nel caso della matrice di Poisson la risposta è affermativa. Da [3, Teor.5.10, p.333]

$$\omega^* = \frac{2}{1 + \sqrt{1 - \rho^2(B_J)}}$$

dove $\rho(B_J)$ è il massimo degli autovalori in modulo della matrice B_J la matrice di iterazione del metodo di Jacobi.

Il **raggio spettrale** della matrice di iterazione di SOR ott. vale $\omega^* - 1$.

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

Vediamo di calcolare questo valore nel caso della sopracitata matrice di Poisson. Dalla teoria, con ovvie notazioni,

$$B_J = I - D^{-1}A$$

e quindi

```
>> format long;
>> D=diag(diag(A));
>> BJ=eye(size(A))-inv(D)*A;
>> s=eig(BJ);
>> s_abs=abs(s);
>> rho=max(s_abs);
>> w=2/(1+sqrt(1-rho^2))
w =
    1.333333333333333
>> maxit=50; tol=10^(-8);
>> b=ones(size(A,1),1);
>> [x_sor, error_sor, iter_sor, flag_sor] = sor(A, x, b, w, maxit, tol);
>> iter_sor
iter_sor =
    22
>>
```

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

Nota.

Si rimane un po' sorpresi dal fatto che per $w = 1.350$ il numero di iterazioni fosse inferiore di quello fornito dal valore ottimale teorico $w^ = 1.333 \dots$*

Il fatto è che questo è ottenuto cercando di massimizzare la velocità asintotica di convergenza. Purtroppo questo minimizza una stima del numero di iterazioni k minime da compiere e non quello effettivo.

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

Abbiamo detto che un punto chiave è la grandezza del **raggio spettrale** delle matrici di iterazione e che è desiderabile che questo numero oltre ad essere strettamente minore di uno sia il **più piccolo possibile**. Vediamo i raggi spettrali dei metodi esposti.

Salviamo in [raggispettrali.m](#) il seguente programma principale

```
maxit=50; tol=0;

siz=5;
A = makefish(siz);      % MATRICE DI POISSON.
b=ones(size(A,1),1);    % TERMINE NOTO.

[ M, N ] = split( A , b, 1.0, 1 ); % JACOBI.
P=inv(M)*N;
rho_J=max(abs(eig(P)));
fprintf('\n \t [RAGGIO SPETTRALE][JACOBI]: %2.15f',rho_J);

[ M, N, b ] = split( A , b, 1, 2 ); % GS.
P=inv(M)*N;
rho_gs=max(abs(eig(P)));
fprintf('\n \t [RAGGIO SPETTRALE][GAUSS-SEIDEL]: %2.15f',rho_gs);
```

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

```
D=diag(diag(A)); E=-(tril(A)-D); F=-(triu(A)-D);  
w=1.350;  
M=D/w-E; N=(1/w-1)*D+F; P=inv(M)*N;  
rho_sor=max(abs(eig(P)));  
fprintf('\n \t [RAGGIO SPETTRALE][SOR BEST]:%2.15f',rho_sor);  
w=1.3333333333333333;  
[ M, N, b ] = split( A, b, w, 2 ); % SOR OPT.  
M=D/w-E; N=(1/w-1)*D+F; P=inv(M)*N;  
rho_sor_opt=max(abs(eig(P)));  
fprintf('\n \t [RAGGIO SPETTRALE][SOR OPT]: %2.15f',rho_sor_opt);
```

Di seguito:

```
>> raggispettrali  
[RAGGIO SPETTRALE][JACOBI]: 0.866025403784438  
[RAGGIO SPETTRALE][GAUSS-SEIDEL]: 0.750000000000000  
[RAGGIO SPETTRALE][SOR BEST]: 0.3500000000000001  
[RAGGIO SPETTRALE][SOR OPT]: 0.333333380707781  
>>
```

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

- Il valore del raggio spettrale della matrice di iterazione del metodo SOR per parametro ottimale, per quanto visto anticipatamente vale $\omega^* - 1$, e l'esperimento numerico lo conferma.
- Abbiamo osservato che in questo caso la velocità di convergenza del metodo di Gauss-Seidel è il doppio di quella di Jacobi. Poste B_{GS} , B_J le rispettive matrici di iterazione, e detta R la velocità di convergenza, osserviamo che da

$$R(B_J) := -\ln(\rho(B_J)) \quad (2)$$

$$R(B_{GS}) := -\ln(\rho(B_{GS})) \quad (3)$$

$$R(B_{GS}) := 2R(B_J) \quad (4)$$

si ha

$$-\ln(\rho(B_{GS})) = R(B_{GS}) = 2R(B_J) = -2\ln(\rho(B_J)) = -\ln(\rho(B_J))^2$$

da cui essendo il logaritmo una funzione invertibile

$$\rho(B_{GS}) = (\rho(B_J))^2.$$

Esercizio svolto: $Ax = b$ con A matrice di Poisson

Il raggio spettrale della matrice di iterazione di Gauss-Seidel coincide quindi col quadrato di quella di Jacobi ed infatti come è facile verificare

```
>> 0.866025403784438^2  
ans =  
0.750000000000000  
>>
```

Esercizio in Matlab II

- Si calcoli la matrice di Poisson P_{20} di ordine 20 aiutandosi con

```
>> help gallery
```

- Sia b il vettore composto di componenti uguali a 1, avente lo stesso numero di righe di P_{20} .
 - Si risolva col gradiente coniugato il problema $P_{20}x = b$, con tolleranza di $10^{(-12)}$, partendo da $x^0 = [0 \dots 0]$.
 - Quante iterazioni servono?
 - E migliore questo risultato di quello ottenuto con Jacobi e Gauss-Seidel?
 - (Facoltativo) Applicare il gradiente coniugato alla matrice minij di ordine 100 e paragonare i risultati con quelli ottenuti da Jacobi, Gauss-Seidel e SOR ottimale.

Bibliografia



K. Atkinson, *Introduction to Numerical Analysis*, Wiley, 1989.



D. Bini, M. Capovani e O. Menchi, *Metodi numerici per l'algebra lineare*, Zanichelli, 1988.



V. Comincioli, *Analisi Numerica, metodi modelli applicazioni*, Mc Graw-Hill, 1990.