

AUTOVALORI DI UNA MATRICE *

A. SOMMARIVA[†]

Conoscenze richieste. Matrici, vettori. Operazioni con matrici e vettori. Matrici simmetriche. Conoscenze di Matlab/Octave.

Conoscenze ottenute. Teoremi di Gershgorin. Metodo delle potenze e loro convergenza. Metodo delle potenze inverse e loro convergenza. Metodo QR e loro convergenza.

Ore necessarie. 2.5 teoria + 2 laboratorio.

1. Calcolo degli autovalori di una matrice. Il problema del calcolo degli autovalori [30] di una matrice quadrata A di ordine n consiste nel trovare gli n numeri (possibilmente complessi) λ tali che

$$Ax = \lambda x, \quad x \neq 0 \quad (1.1)$$

Si osservi che a seconda delle esigenze talvolta è richiesto solamente il calcolo di alcuni autovalori (ad esempio quelli di massimo modulo, per determinare lo spettro della matrice) mentre in altri casi si vogliono determinare tutti gli n autovalori in \mathbb{C} .

Per semplicità, dopo i teoremi di localizzazione di Gershgorin, mostreremo solo due metodi classici, uno per ognuna di queste classi, quello delle potenze e il metodo QR, rimandando per completezza alla monografia di Saad o a manuali di algebra lineare [3], [37].

Una interessante applicazione è l'algoritmo di PageRank [35], utilizzato da Google per fornire i risultati migliori tra i siti web relativamente a certe parole chiave ed in prima approssimazione basato sul calcolo di un autovettore relativo all'autovalore 1 (ad esempio via metodo delle potenze) di una matrice stocastica di dimensioni *enormi* (cf. [1], [4], [5]).

2. Teoremi di Gershgorin. In questo paragrafo mostriamo tre teoremi di localizzazione di autovalori dovuti a Gershgorin (cf. [3, p.76], [38]).

TEOREMA 2.1. (*Primo teorema di Gershgorin*). *Gli autovalori di una matrice A di ordine n sono tutti contenuti nell'unione dei cerchi di Gershgorin*

$$K_i = \{z \in \mathbb{C} : |z - a_{i,i}| \leq \sum_{j=1, j \neq i}^n |a_{i,j}|\}$$

Vediamo quale esempio la matrice

$$A = \begin{pmatrix} 15 & -2 & 2 \\ 1 & 10 & -3 \\ -2 & 1 & 0 \end{pmatrix} \quad (2.1)$$

*Ultima revisione: 19 aprile 2013

[†]Dipartimento di Matematica, Università degli Studi di Padova, stanza 419, via Trieste 63, 35121 Padova, Italia (alvise@euler.math.unipd.it). Telefono: +39-049-8271350.

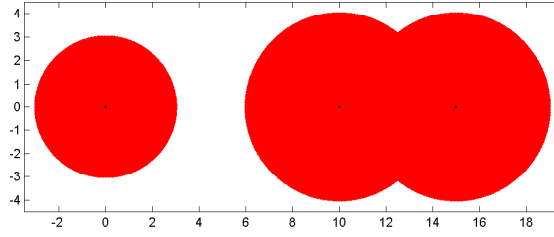


FIGURA 2.1. Cerchi di Gershgorin della matrice A definita in (3.2)

Il primo teorema di Gershgorin stabilisce che gli autovalori stanno nell'unione dei cerchi di Gershgorin

$$K_1 = \{z \in \mathbb{C} : |z - 15| \leq |-2| + |2| = 4\}$$

$$K_2 = \{z \in \mathbb{C} : |z - 10| \leq |1| + |-3| = 4\}$$

$$K_3 = \{z \in \mathbb{C} : |z - 0| \leq |-2| + |1| = 3\}$$

TEOREMA 2.2. (Secondo teorema di Gershgorin). *Se l'unione M_1 di k cerchi di Gershgorin è disgiunta dall'unione M_2 dei rimanenti $n - k$, allora k autovalori appartengono a M_1 e $n - k$ appartengono a M_2 .*

Applicando il secondo teorema di Gershgorin, dal confronto con la figura 2 abbiamo che 1 autovalore sta nel cerchio K_3 mentre 2 stanno nell'unione dei cerchi K_1, K_2 .

TEOREMA 2.3. (Terzo teorema di Gershgorin). *Se la matrice di ordine n è irriducibile e un autovalore λ sta sulla frontiera dell'unione dei cerchi di Gershgorin, allora sta sulla frontiera di ogni cerchio di Gershgorin.*

Questo teorema sarà utile in seguito per dimostrare che una matrice, detta di Poisson, è non singolare. Ricordiamo che una matrice si dice *irriducibile* se non è *riducibile* e che una matrice di ordine $n \geq 2$ è *riducibile* se esiste una matrice di permutazione Π e un intero k , $0 < k < n$, tale che

$$B = \Pi A \Pi^T = \begin{pmatrix} A_{1,1} & A_{1,2} \\ 0 & A_{2,2} \end{pmatrix}$$

in cui $A_{1,1} \in \mathbb{C}^{k \times k}$, $A_{2,2} \in \mathbb{C}^{(n-k) \times (n-k)}$.

NOTA 2.4. *Per verificare se una matrice $A = (a_{i,j})$ sia irriducibile (cf. [28]), ricordiamo che data una qualsiasi matrice, è possibile costruire un grafo avente come nodi gli indici della matrice. In particolare, il nodo i -esimo è connesso al nodo j -esimo se l'elemento $a_{i,j}$ è diverso da 0. Il grafo associato si dice fortemente connesso se per ogni coppia (i, j) posso raggiungere j a partire da i . Una matrice irriducibile se e solo se il grafo di adiacenza ad esso associato è fortemente connesso. In altre parole, una matrice riducibile se e solo se il grafo di adiacenza ad esso associato non è fortemente connesso.*

Vediamo ora in Matlab quali sono effettivamente gli autovalori. si ha

```
>> A=[15 -2 2; 1 10 -3; -2 1 0]
A =
    15    -2     2
     1    10    -3
    -2     1     0
```



FIGURA 2.2. Semyon Aranovich Gershgorin (1901-1933) e Herman Müntz (1884-1956)

```
>> eig(A)
ans =
    0.5121
   14.1026
   10.3854
>>
```

a conferma di quanto stabilito dai primi due teoremi di Gershgorin.

NOTA 2.5. Ricordiamo che A è una matrice a coefficienti reali, allora A e A^T hanno gli stessi autovalori (cf. [3, p.47]) e quindi applicando i teoremi di Gershgorin alla matrice trasposta possiamo ottenere nuove localizzazioni degli autovalori. Nel caso A sia a coefficienti complessi, se λ è un autovalore di A allora il suo coniugato $\bar{\lambda}$ è autovalore della sua trasposta coniugata \bar{A} . Da qui si possono fare nuove stime degli autovalori di A . Cosa possiamo dire relativamente agli autovalori di A se applichiamo i teoremi di Gershgorin ad A^T invece che ad A ?

3. Il metodo delle potenze. Il metodo delle potenze è stato suggerito nel 1913 da Muntz ed è particolarmente indicato per il calcolo dell'autovalore di massimo modulo di una matrice.

Sia A una matrice quadrata di ordine n con n autovettori x_1, \dots, x_n linearmente indipendenti e autovalori $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ tali che

$$|\lambda_1| > |\lambda_2| \geq \dots \geq |\lambda_n|. \quad (3.1)$$

A tal proposito ricordiamo (cf. [7], p. 951) i seguenti risultati.

1. Una matrice A è diagonalizzabile se e solo se possiede n autovettori linearmente indipendenti.
2. Se tutti gli autovalori di A sono distinti la matrice è diagonalizzabile; l'opposto è ovviamente falso (si pensi alla matrice identica).
3. Una matrice simmetrica (hermitiana) è diagonalizzabile. L'opposto è ovviamente falso, visto che la matrice

$$A = \begin{pmatrix} 15 & 0 \\ 1 & 10 \end{pmatrix} \quad (3.2)$$

è diagonalizzabile visto che ha tutti gli autovalori distinti ma non è simmetrica.

Il metodo delle potenze è definito come segue. Sia $t_0 \in \mathbb{R}^n$ definito da

$$t_0 = \sum_{i=1}^n \alpha_i x_i, \quad \alpha_1 \neq 0,$$

e si generi la successione

$$y_0 = t_0 \tag{3.3}$$

$$y_k = Ay_{k-1}, \quad k = 1, 2, \dots \tag{3.4}$$

TEOREMA 3.1. *Sia A è una matrice quadrata diagonalizzabile avente autovalori λ_k tali che*

$$|\lambda_1| > |\lambda_2| \geq \dots \geq |\lambda_n|.$$

Siano $u_k \neq 0$ autovettori relativi all'autovalore λ_k , cioè

$$Au_k = \lambda_k u_k.$$

Sia

$$y_0 = \sum_k \alpha_k u_k, \quad \alpha_1 \neq 0.$$

La successione $\{y_s\}$ definita da $y_{s+1} = Ay_s$ converge ad un vettore parallelo a x_1 e che il coefficiente di Rayleigh (relativo al prodotto scalare euclideo)

$$\rho(y_s, A) := \frac{(y_s, Ay_s)}{(y_s, y_s)} \tag{3.5}$$

converge a λ_1 .

DIMOSTRAZIONE. Per la dimostrazione si confronti [15, p.171]. Essendo la matrice A diagonalizzabile, esistono n autovettori u_k (relativi rispettivamente agli autovalori λ_k) che sono linearmente indipendenti e quindi formano una base di \mathbb{R}^n . Sia

$$y_0 = \sum_k \alpha_k u_k, \quad \alpha_1 \neq 0.$$

Essendo $Au_k = \lambda_k u_k$ abbiamo

$$y_1 = Ay_0 = A\left(\sum_k \alpha_k u_k\right) = \sum_k \alpha_k Au_k = \sum_k \alpha_k \lambda_k u_k$$

$$y_2 = Ay_1 = A\left(\sum_k \alpha_k \lambda_k u_k\right) = \sum_k \alpha_k \lambda_k Au_k = \sum_k \alpha_k \lambda_k^2 u_k$$

e più in generale

$$y_{s+1} = Ay_s = A\left(\sum_k \alpha_k \lambda_k^s u_k\right) = \sum_k \alpha_k \lambda_k^s Au_k = \sum_k \alpha_k \lambda_k^{s+1} u_k$$

Osserviamo ora che

$$\frac{y_{s+1}}{\lambda_1^{s+1}} = \sum_k \alpha_k \frac{\lambda_k^{s+1}}{\lambda_1^{s+1}} u_k \quad (3.6)$$

per cui essendo per $k > 1$

$$\left| \frac{\lambda_k^{s+1}}{\lambda_1^{s+1}} \right| < 1,$$

si ha

$$\lim_{s \rightarrow +\infty} \left(\frac{\lambda_k}{\lambda_1} \right)^s = 0$$

e quindi la direzione di $\frac{y_s}{\lambda_1^s}$, che è la stessa di y_s , tende a quella dell'autovettore u_1 . Si osservi che il coefficiente di Rayleigh $\rho(\cdot, A)$ è continuo in ogni $x \neq 0$, $x \in \mathbb{R}^n$ in quanto tanto il numeratore quanto il denominatore sono funzioni polinomiali (quadratiche) delle componenti x_k di $x = (x_k)_k \in \mathbb{R}^n$, che sono appunto continue. Per continuità, se $y_s/\lambda_1^s \rightarrow \alpha_1 u_1$ allora, essendo $\lambda_1 \neq 0$, da

$$\begin{aligned} \lim_s \rho(y_s, A) &:= \lim_s \frac{(y_s, A y_s)}{(y_s, y_s)} = \lim_s \frac{(y_s/\lambda_1^s, A(y_s/\lambda_1^s))}{(y_s/\lambda_1^s, y_s/\lambda_1^s)} \\ &= \frac{(\alpha_1 u_1, A(\alpha_1 u_1))}{(\alpha_1 u_1, \alpha_1 u_1)} = \frac{(u_1, A u_1)}{(u_1, u_1)} = \lambda_1, \end{aligned} \quad (3.7)$$

ricaviamo che il coefficiente di Rayleigh $\rho(y_s, A)$ converge a λ_1 . \square

NOTA 3.2. *Il metodo converge anche nel caso in cui*

$$\lambda_1 = \dots = \lambda_r$$

per $r > 1$, tuttavia non è da applicarsi quando l'autovalore di modulo massimo non è unico.

NOTA 3.3. *In virtù di alcune possibili problemi di underflow e underflow si preferisce normalizzare passo passo il vettore y_k definito in (3.3). Conseguentemente l'algoritmo del metodo delle potenze risulta*

$$u_k = A t_{k-1} \quad (3.8)$$

$$t_k = \frac{u_k}{\beta_k}, \quad \beta_k = \|u_k\|_2 \quad (3.9)$$

$$l_k = \rho(t_k, A) \quad (3.10)$$

dove $\rho(t_k, A)$ è il coefficiente di Rayleigh definito in (3.5).

4. Il metodo delle potenze inverse. Una variante particolarmente interessante del metodo delle potenze è stata scoperta da Wielandt nel 1944 [31] ed è particolarmente utile nel caso in cui A sia una matrice quadrata con n autovettori linearmente indipendenti,

$$|\lambda_1| \geq |\lambda_2| \geq \dots > |\lambda_n| > 0. \quad (4.1)$$

e si desideri calcolare il più piccolo autovalore in modulo, cioè λ_n , applicando il metodo delle potenze ad A^{-1} . Si ottiene così la successione $\{t_k\}$ definita da

$$A u_k = t_{k-1} \quad (4.2)$$

$$t_k = \frac{u_k}{\beta_k}, \quad \beta_k = \|u_k\|_2 \quad (4.3)$$

e convergente ad un vettore parallelo a x_n . La successione di coefficienti di Rayleigh

$$\rho(t_k, A^{-1}) := \frac{(t_k, A^{-1}t_k)}{(t_k, t_k)} = \frac{(t_k, u_{k+1})}{(t_k, t_k)} \rightarrow 1/\lambda_n. \quad (4.4)$$

da cui è immediato calcolare λ_n .

Vediamo in dettaglio questo punto. Se $\{\xi_i\}$ sono gli autovalori di A^{-1} con

$$|\xi_1| > |\xi_2| \geq |\xi_3| \geq \dots \geq |\xi_n|$$

allora il metodo delle potenze inverse calcola un'approssimazione di ξ_1 e di un suo autovettore x . Si osserva subito che se $A^{-1}x = \xi_i x$ (con $\xi_i \neq 0$) allora moltiplicando ambo membri per $\xi_i^{-1}A$ si ottiene leggendo da destra a sinistra $Ax = \xi_i^{-1}x$ cioè ξ_i^{-1} è un autovalore di A e x è non solo autovettore di A^{-1} relativo all'autovalore ξ_i , ma pure autovettore di A relativo all'autovalore ξ_i^{-1} . Conseguentemente se ξ_1 è l'autovalore di massimo modulo di A^{-1} e λ_n è l'autovalore di minimo modulo di A si ha $\lambda_n = \xi_1^{-1}$ e che

$$A^{-1}x = \xi_1 x \Rightarrow Ax = \xi_1^{-1}x = \lambda_n x$$

Notiamo che il metodo delle potenze inverse, calcola $\xi_1 = \lambda_n^{-1}$ e il relativo autovettore x . Per ottenere λ_n viene naturale calcolare ξ_1^{-1} , ma usualmente essendo x autovettore di A relativo a λ_n si preferisce per questioni numeriche calcolare λ_n via coefficiente di Rayleigh

$$\rho(x, A) := \frac{(x, Ax)}{(x, x)}.$$

In generale, fissato $\mu \in \mathbb{C}$ è possibile calcolare, se esiste unico, l'autovalore λ più vicino a μ considerando il seguente pseudocodice [14, p.181]:

$$(A - \mu I)z_k = q_{k-1} \quad (4.5)$$

$$q_k = z_k / \|z_k\|_2 \quad (4.6)$$

$$\sigma_k = (q_k)^H A q_k \quad (4.7)$$

Ricordiamo che se λ è autovalore di A allora

$$Ax = \lambda x \Rightarrow (A - \mu I)x = \lambda x - \mu x = (\lambda - \mu)x$$

e quindi $\lambda - \mu$ è autovalore di $A - \mu I$. Il metodo delle potenze inverse applicato a $A - \mu I$ calcola il minimo autovalore $\sigma = \lambda - \mu$ in modulo di $A - \mu I$ cioè il σ che rende minimo il valore di $|\sigma| = |\lambda_i - \mu|$, dove λ_i sono gli autovalori di A . Quindi essendo $\lambda_i = \sigma_i - \mu$ si ottiene pure il λ_i più vicino a μ .

Per versioni più sofisticate di questa tecnica detta di *shift* (o in norma infinito invece che in norma 2) si confronti [3, p.379].

Problema. Si può applicare il metodo delle potenze inverse con shift μ nel caso μ sia proprio un autovalore di A ?

5. Il metodo QR. Il metodo QR, considerato tra i 10 algoritmi più rilevanti del ventesimo secolo [9], cerca di calcolare tutti gli autovalori di una matrice A .

Sia A una matrice quadrata di ordine n . Utilizzando il metodo di Householder è possibile fattorizzare la matrice A come prodotto di due matrici Q ed R con Q unitaria (cioè $Q^T * Q = Q * Q^T = I$) ed R triangolare superiore.

Citiamo alcune cose:



FIGURA 5.1. Helmut Wielandt (1910-2001) e Vera N. Kublanovskaya (1920)

1. La matrice A ha quale sola particolarità di essere quadrata. Nel caso generale però la sua fattorizzazione QR in generale non è unica bensì determinata a meno di una matrice di fase (cf. [3, p.149]) .
2. Come osservato in [2] p. 614, tale fattorizzazione non è unica (per una opportuna Q unitaria, i segni delle componenti sulla diagonale della matrice R possono essere scelti arbitrariamente). Nel caso sia non singolare, allora tale fattorizzazione è unica qualora si chieda che i coefficienti diagonali di R siano positivi.
3. La routine Matlab `qr` effettua tale fattorizzazione. Si consiglia di consultare l'`help` di Matlab, per consultare le particolarità di tale routine.
4. Se la matrice H è simile a K (cioè esiste una matrice non singolare S tale che $H = S^{-1}KS$) allora H e K hanno gli stessi autovalori. Si può vedere facilmente che la relazione di similitudine è transitiva, cioè se H_1 è simile ad H_2 e H_2 è simile ad H_3 allora H_1 è simile ad H_3 .

Il metodo QR venne pubblicato indipendentemente nel 1961 da Francis e da Kublanovskaya e successivamente implementato in EISPACK. Ci limiteremo a considerare versioni di base del metodo.

Sia

$$A_0 = A = Q_0 R_0$$

e si ponga

$$A_1 := R_0 Q_0.$$

Poichè

$$Q_0 A_1 Q_0^T = Q_0 A_1 Q_0^T = Q_0 R_0 Q_0 Q_0^T = A_0$$

la matrice A_1 è simile ad A_0 (si ponga $S = Q_0^{-1} = Q_0^T$) e quindi ha gli stessi autovalori. Sia quindi in generale

$$A_k = Q_k R_k$$

$$A_{k+1} = R_k Q_k.$$

Per le stesse motivazioni A_{k+1} è simile ad A_k , e per transitività ad A_0 . Quindi A_{k+1} ha gli stessi autovalori di A_0 .

Per la convergenza del metodo esistono vari risultati (cf. [7, p.393], [10, p.352], [15, p.180], [13, p.21, Thm. 5.3]). Ricordiamo principalmente [14, p.169]

TEOREMA 5.1. *Se la matrice $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ è con autovalori tutti distinti in modulo, con*

$$|\lambda_1| > \dots > |\lambda_n| \quad (5.1)$$

allora l'algoritmo QR converge ad una matrice $A_\infty = (a_{i,j}^\infty)$ triangolare superiore, cioè

$$\lim_k A_k = \begin{pmatrix} a_{1,1}^\infty & a_{1,2}^\infty & \dots & \dots & a_{1,n}^\infty \\ 0 & a_{2,2}^\infty & a_{2,3}^\infty & \dots & a_{2,n}^\infty \\ 0 & 0 & a_{3,3}^\infty & \dots & a_{3,n}^\infty \\ 0 & 0 & \dots & \dots & \dots \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & a_{n-1,n-1}^\infty & a_{n-1,n}^\infty \\ 0 & 0 & 0 & 0 & a_{n,n}^\infty \end{pmatrix} \quad (5.2)$$

con $\lambda_k = a_{k,k}^\infty$.

Inoltre,

1. Se la condizione (5.1) non è verificata si può dimostrare che la successione $\{A_k\}$ tende a una forma triangolare a blocchi.
2. se $A_k = (a_{i,j}^{(k)})$, e $\lambda_{i-1} \neq 0$

$$|a_{i,i-1}^{(k)}| = \mathcal{O} \left(\frac{|\lambda_i|}{|\lambda_{i-1}|} \right)^k, \quad i = 2, \dots, n, \quad k \rightarrow \infty. \quad (5.3)$$

3. se la matrice è simmetrica, allora

$$A_\infty = \text{diag}(\lambda_1, \dots, \lambda_1).$$

4. se A è una matrice Hessenberg superiore allora l'algoritmo QR converge ad una matrice A_∞ triangolare a blocchi, simile ad A e con gli autovalori di ogni blocco diagonale tutti uguali in modulo.

5.1. Implementazione di base di QR. Nelle implementazioni si calcola con un metodo scoperto da Householder (ma esiste un metodo alternativo dovuto a Givens) una matrice di Hessenberg T

$$T = \begin{pmatrix} a_{1,1} & a_{1,2} & a_{1,3} & \dots & a_{1,n} \\ a_{2,1} & a_{2,2} & a_{2,3} & \dots & a_{2,n} \\ 0 & a_{3,2} & a_{3,3} & \dots & a_{3,n} \\ 0 & 0 & a_{4,3} & \dots & a_{4,n} \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & 0 & a_{n,n-1} & a_{n,n} \end{pmatrix}$$

simile ad A ed in seguito si applica il metodo QR relativamente alla matrice T . Se A è simmetrica la matrice T risulta tridiagonale simmetrica.



FIGURA 5.2. James Wallace Givens (1910-1993), Karl Hessenberg (1904-1959) e Alston Scott Householder (1904-1993)

Si può mostrare che se A è una matrice di Hessenberg superiore, allora $A = QR$ con Q di Hessenberg superiore. Inoltre, se A è tridiagonale allora $A = QR$ con Q di Hessenberg e R triangolare superiore con $r_{i,j} = 0$ qualora $j - i \geq 2$.

In entrambi i casi le iterazioni mantengono la struttura, cioè se $A_0 = T$ è di Hessenberg, allora A_k è di Hessenberg, se $A_0 = T$ è tridiagonale allora A_k è tridiagonale.

Il numero di moltiplicazioni necessarie all'algoritmo di Givens per calcolare tale matrice T a partire da A è approssimativamente $10n^3/3$ mentre per quanto riguarda l'algoritmo di Householder è $5n^3/3$ [16, p.252]. Il metodo QR applicato ad una matrice A in forma di Hessenberg superiore ha ad ogni passo un costo di $2n^2$ operazioni moltiplicative.

Per versioni più sofisticate come il metodo QR con shift, si veda [7], p. 394.

5.2. Facoltativo: Metodo QR con shift. la velocità di convergenza dipende dal rapporto ρ in (5.3). Se è vicino a 1 la convergenza può essere lenta o perfino non sussistere (si vedano gli esempi della sezione precedente). Per risolvere questi problemi si utilizza una tecnica detta dello shift. Sia μ un numero (anche complesso!) che approssima meglio degli altri un autovalore e si consideri la successione $\{A_k\}$ generata da

$$\begin{cases} A_k - \mu I = Q_k R_k \\ A_{k+1} = R_k Q_k + \mu I_n \end{cases} \quad (5.4)$$

dove al solito I_n è la matrice identica di ordine n , e $A_0 := A$.

Osserviamo che essendo Q_k matrici unitarie cioè $Q_k^H Q_k = Q_k Q_k^H = I_n$ si ha

$$Q_k A_{k+1} Q_k^H = Q_k (R_k Q_k + \mu I_n) Q_k^H = Q_k R_k + \mu I_n = A_k$$

per cui si evince che A_{k+1} ed A_k sono simili. Conseguentemente A_k è simile ad $A_0 = A - \mu I_n$ e i suoi autovalori sono $\{\lambda_i - \mu\}_{i=1, \dots, n}$ da cui si ottengono facilmente $\{\lambda_i\}_{i=1, \dots, n}$. Esistono diverse varianti di questa tecnica.

5.2.1. Facoltativo. Variante 1. In una prima variante di QR, (cf. [3], p. 363), detta $(a_k)_{n,n}$ la componente (n, n) della matrice A_k , si pone

$$\mu_k = (a_k)_{n,n}, \quad k = 1, 2, \dots \quad (5.5)$$

e si considera il metodo

$$\begin{cases} A_k - \mu_k I = Q_k R_k \\ A_{k+1} = R_k Q_k + \mu_k I_n \\ A_0 = A \end{cases} \quad (5.6)$$

Nel caso di matrici hermitiane (cioé $A = A^H$) la convergenza a zero di $(a_k)_{n,n-1}$ é del terzo ordine. Una volta che $|(a_k)_{n,n-1}| < \epsilon$, dove ϵ é una tolleranza prefissata, si procede riapplicando lo stesso metodo alla sottomatrice \hat{A} composta dalle prime $n-1$ righe e colonne di A_k . Poiché $|(a_k)_{n,n-1}| \approx 0$, e gli autovalori di una matrice diagonale a blocchi sono l'unione degli autovalori di ogni blocco, gli autovalori di A sono l'unione di quelli di \hat{A} con $(a_k)_{n,n}$.

5.2.2. Facoltativo. Variante 2 (di Wilkinson). Nel caso in cui $|\lambda_{n-1}| = |\lambda_n|$ si procede come in precedenza scegliendo μ_k l'autovalore della sottomatrice

$$\begin{pmatrix} a_{n-1,n-1} & a_{n,n} \\ a_{n,n-1} & a_{n,n} \end{pmatrix} \quad (5.7)$$

che é piú vicino ad $(a_k)_{n,n}$. Si noti che in questo caso, anche se la matrice A ha coefficienti reali, l'utilizzazione dello shift può portare ad una matrice ad elementi complessi, con un aumento del costo computazionale.

6. Facoltativo: Metodo QR: alcune considerazioni. Sia A una matrice quadrata di ordine n e siano da calcolare tutti i suoi autovalori $\{\lambda_i\}$. In precedenza abbiamo visto che é possibile trasformare per similitudine la matrice A in una matrice di Hessenberg T

$$T = \begin{pmatrix} a_{1,1} & a_{2,1} & a_{3,1} & \dots & a_{n,1} \\ a_{1,2} & a_{2,2} & a_{3,2} & \dots & a_{n,2} \\ 0 & a_{2,3} & a_{3,3} & \dots & a_{n,3} \\ 0 & 0 & a_{3,4} & \dots & a_{n,4} \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ 0 & 0 & 0 & a_{n,n-1} & a_{n,n} \end{pmatrix}$$

Essendo T simile ad A , gli autovalori di T sono gli stessi di A . Si é osservato che una versione di base del metodo QR può incontrare problemi nel convergere qualora esistano 2 autovalori distinti di uguale metodo.

Questo é ad esempio il caso della matrice

$$\begin{pmatrix} 3 & 17 & -37 & 18 & 40 \\ 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}$$

che ha due valori complessi coniugati

$$\lambda \approx 1.27437503036000 \pm 1.03039271164378 i.$$

Affrontiamo il caso della matrice di Hessenberg di ordine 3 (cf. [7], p. 393)

$$A = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 1 \end{pmatrix}$$

Si vede facilmente che alla 25-sima iterazione del metodo QR (in una sua versione di base) corrisponde la matrice

$$A_{25} = \begin{pmatrix} 2.000 & 1.069 & 0.926 \\ 0.000 & -0.500 & 0.866 \\ 0 & -0.866 & -0.500 \end{pmatrix}$$

(abbiamo scritto per semplicità 3 cifre decimali delle componenti di A_{25}). Risulta chiaro che quindi il metodo QR non fornisce gli autovalori di A , in quanto non tende a una matrice triangolare superiore. Il problema come in precedenza è dovuto alla presenza di 2 autovalori complessi coniugati $\lambda \approx -0.5 \pm 0.8660i$.

7. Esperimenti numerici in Matlab.

7.1. Il metodo delle potenze. Partiamo con una versione semplice `power_basic` del metodo delle potenze

```
function [lambda1, x1, niter, err]=power_basic(A,z0,toll,nmax)

% INPUT:
% A : MATRICE DI CUI VOGLIAMO CALCOLARE L'AUTOVALORE DI MASSIMO MODULO.
% z0 : VETTORE INIZIALE (NON NULO).
% toll: TOLLERANZA.
% nmax: NUMERO MASSIMO DI ITERAZIONI.
%
% OUTPUT:
% lambda1 : VETTORE DELLE APPROSSIMAZIONI DELL'AUTOVALORE DI MASSIMO MODULO.
% x1 : AUTOVETTORE RELATIVO ALL'AUTOVALORE DI MASSIMO MODULO.
% niter : NUMERO DI ITERAZIONI.
% err : VETTORE DEI RESIDUI PESATI RELATIVI A "lambda1".
%
% TRATTO DA QUARTERONI-SALERI, "MATEMATICA NUMERICA", p. 184.
%

q=z0/norm(z0); q2=q; err=[]; lambda1=[];
res=toll+1; niter=0; z=A*q;
while (res >= toll & niter <= nmax)
    q=z/norm(z); z=A*q; lam=q'*z; x1=q;
    z2=q2'*A; q2=z2/norm(z2); q2=q2'; y1=q2; costheta=abs(y1'*x1);
    niter=niter+1; res=norm(z-lam*q)/costheta;
    err=[err; res]; lambda1=[lambda1; lam];
end
```

Qualche nota

1. il vettore iniziale z_0 e' normalizzato ed in `err`, `lambda1` vengono memorizzati rispettivamente i valori dell'errore compiuto e dell'autovalore di massimo modulo λ_{\max} ;
2. l'assegnazione `res=toll+1`; forza l'algoritmo ad entrare nel ciclo `while`, mentre `z=A*q`; è una quantità da utilizzarsi per il calcolo dell'autovalore λ_{\max} ;
3. nel ciclo `while`, q è un'approssimazione di un autovettore relativo a λ_{\max} , mentre `lam` di λ_{\max} ;
4. il ciclo si interrompe se un numero massimo di iterazioni `niter` è raggiunto oppure

$$\frac{\|Aq^k - \lambda^k\|_2}{|\cos(\theta_{\lambda_k})|} < \text{tol}$$

dove θ_{λ_k} è l'angolo formato tra (un'approssimazione del)l'autovalore destro x_1 e sinistro y_1 associati a `lam` (cf. [14, p.180])

7.2. Esempio 1. Testiamo il codice relativamente al calcolo dell'autovalore di massimo modulo di

$$A = \begin{pmatrix} -15.5 & 7.5 & 1.5 \\ -51 & 25 & 3 \\ -25.5 & 7.5 & 11.5 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 2 & 5 & 6 \\ 7 & 9 & 3 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 10 & 0 & 0 \\ 0 & 10 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 2 & 5 & 6 \\ 7 & 9 & 3 \end{pmatrix}^{-1} \quad (7.1)$$

La matrice A è diagonalizzabile e ha autovalori 10, 10, 1. Si può vedere che una base di autovettori relativa agli autovalori 10, 10, 1 è composta da $(1, 2, 7)$, $(2, 5, 9)$, $(3, 6, 3)$. Quale vettore iniziale del metodo delle potenze consideriamo

$$z_0 = (1, 1, 1) = (7/6) \cdot (1, 2, 7) - 1 \cdot (2, 5, 9) + (11/18) \cdot (3, 6, 3)$$

e quindi il metodo delle potenze applicato ad A , e avente quale punto iniziale z_0 può essere utilizzato per il calcolo dell'autovalore di massimo modulo di A , poichè $\alpha_1 = 7/6 \neq 0$. Dalla shell di Matlab/Octave:

```
>> S=[1 2 3; 2 5 6; 7 9 3];
>> D=diag([10 10 1]);
>> A=S*D*inv(S)
A =
   -15.5000    7.5000    1.5000
   -51.0000   25.0000    3.0000
   -25.5000    7.5000   11.5000
>> z0=[1 1 1]';
>> toll=10^(-8);
>> nmax=10;
>> format short e;
>> [lambda1, x1, niter, err]=power_basic(A,z0,toll,nmax)
lambda1 =
   1.1587e+001
   1.0138e+001
   1.0014e+001
   1.0001e+001
   1.0000e+001
   1.0000e+001
   1.0000e+001
   1.0000e+001
   1.0000e+001
   1.0000e+001
x1 =
  -2.8583e-001
  -9.1466e-001
  -2.8583e-001
niter =
    10
err =
   2.2466e+000
   2.1028e-001
   2.0934e-002
   2.0925e-003
   2.0924e-004
   2.0924e-005
   2.0924e-006
   2.0924e-007
   2.0924e-008
```

```
2.0924e-009
>>
```

La convergenza è abbastanza veloce come si vede dalla quantità `err`, che consiste in un particolare residuo pesato.

Una questione sorge spontanea. Cosa sarebbe successo se avessimo utilizzato l'algoritmo senza normalizzazione come ad esempio `power_method` definito da

```
function [lambda,v]=power_method(A,x0,maxit)

v=x0;

for index=1:maxit
    v_old=v;
    v=A*v_old;
    lambda=(v_old'*v)/(v_old'*v_old);
end
```

Proviamo il test, facendo iterare il metodo prima 5, poi 100 volte e alla fine 1000 volte (si noti il settaggio della variabile `maxit` relativa al numero di iterazioni da compiere):

```
>> x0=[1 1 1]'
x0 =
     1
     1
     1
>> A=[-15.5 7.5 1.5; -51 25 3; -25.5 7.5 11.5]
A =
    -15.5000     7.5000     1.5000
    -51.0000    25.0000     3.0000
    -25.5000     7.5000    11.5000
>> [lambda,v]=power_method(A,x0,5)
lambda =
    10.0014
v =
    1.0e+005 *
    -0.8333
    -2.6666
    -0.8333
>> [lambda,v]=power_method(A,x0,100)
lambda =
    10.0000
v =
    1.0e+100 *
    -0.8333
    -2.6667
    -0.8333
>> [lambda,v]=power_method(A,x0,1000)
lambda =
    NaN
v =
    NaN
    NaN
    NaN
>>
```

La ragione è semplice. Per k relativamente piccolo si ha $A \cdot t_k \approx 10 \cdot t_k$ e quindi per $s \geq k$

$$t_s \approx A^{s-k} \cdot t_k \approx 10 \cdot A^{s-k-1} \cdot t_k \approx \dots \approx 10^{s-k} \cdot t_k$$

da cui

$$\|t_s\|_2 \approx 10^{s-k} \cdot \|t_k\|_2$$

spiegando quindi perchè si possano avere problemi di overflow applicando l'algoritmo di base.

7.3. Esempio 2. Proviamo un test diverso, questa volta con la matrice (diagonalizzabile)

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 0 & -1 \end{pmatrix},$$

avente autovalori $\lambda_1 = 1$ e $\lambda_2 = -1$ e autovettori linearmente indipendenti $(1, 0)$, $(-1, 1)$.
Quale vettore iniziale poniamo

$$x_0 = (1, 3) = 4 \cdot (1, 0) + 3 \cdot (-1, 1)$$

e quindi il metodo delle potenze applicato ad A , partendo da x_0 può essere sicuramente applicato. D'altra parte dubitiamo converga in quanto $|\lambda_1| = |\lambda_2| = 1$ pur essendo $\lambda_1 \neq \lambda_2$.
Dalla shell di Matlab/Octave:

```
>>> A=[1 2; 0 -1]
A =
     1     2
     0    -1
>>> [lambda1, x1, niter, err]=power_basic(A,[1; 3],10^(-8),15)
lambda1 =
-3.4483e-002
-2.0000e-001
-3.4483e-002
-2.0000e-001
-3.4483e-002
...
-3.4483e-002
-2.0000e-001
-3.4483e-002
-2.0000e-001
x1 =
 3.1623e-001
 9.4868e-001
niter =
    16
err =
 4.4567e-001
 2.4000e+000
 4.4567e-001
 2.4000e+000
 4.4567e-001
...
 4.4567e-001
 2.4000e+000
 4.4567e-001
 2.4000e+000
>>>
```

Dal residuo pesato è chiaro che il metodo non converge, e come anticipato il motivo è la presenza di autovalori distinti aventi modulo massimo.

7.4. Esempio 3. Per terminare, vediamo il caso della matrice diagonalizzabile (avendo autovalori distinti)

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 2 \\ 0 & 10 \end{pmatrix},$$

in cui il metodo funziona rapidamente, in quanto esiste un solo autovalore di modulo massimo, uguale a 10.

```
>>> A=[1 2; 0 10]
A =
     1     2
     0    10
>>> [lambdal, x1, niter, err]=power_basic(A,[1; 3],10^(-8),15)
lambdal =
  9.9779e+000
  9.9979e+000
  9.9998e+000
  1.0000e+001
  1.0000e+001
  1.0000e+001
  1.0000e+001
  1.0000e+001
  1.0000e+001
x1 =
  2.1693e-001
  9.7619e-001
niter =
     8
err =
  9.6726e-002
  9.7529e-003
  9.7610e-004
  9.7618e-005
  9.7619e-006
  9.7619e-007
  9.7619e-008
  9.7619e-009
```

Si osservi che il metodo termina in quanto l'errore pesato `err` è minore della tolleranza $toll = 10^{-8}$.

7.5. Il metodo delle potenze inverse. Una versione di base `invpower` del metodo delle potenze inverse [14, p.184] è

```
function [lambda, x, niter, err]=invpower(A,z0,mu,toll,nmax)

% DATO UN VALORE mu, SI CALCOLA L'AUTOVALORE "lambda_mu" PIU' VICINO A mu.

% INPUT:
% A   : MATRICE DI CUI VOGLIAMO CALCOLARE L'AUTOVALORE "lambda_mu".
% z0  : VETTORE INIZIALE (NON NULO).
% mu  : VALORE DI CUI VOGLIAMO CALCOLARE L'AUTOVALORE PIU' VICINO.
% toll: TOLLERANZA.
% nmax: NUMERO MASSIMO DI ITERAZIONI.
%
% OUTPUT:
% lambda : VETTORE DELLE APPROSSIMAZIONI DELL'AUTOVALORE DI MINIMO MODULO.
% x      : AUTOVETTORE RELATIVO ALL'AUTOVALORE DI MINIMO MODULO.
% niter  : NUMERO DI ITERAZIONI.
% err    : VETTORE DEI RESIDUI PESATI RELATIVI A "lambda".
%
% TRATTO DA QUARTERONI-SALERI, "MATEMATICA NUMERICA", p. 184.
%

n=max(size(A)); M=A-mu*eye(n); [L,U,P]=lu(M);
q=z0/norm(z0); q2=q'; err=[]; lambda=[];
res=toll+1; niter=0;
while (res >= toll & niter <= nmax)
```

```

niter=niter+1; b=P*q; y=L\b; z=U\y;
q=z/norm(z); z=A*q; lam=q'*z;
b=q2'; y=U'\b; w=L'\y;
q2=(P'*w)'; q2=q2/norm(q2); costheta=abs(q2*q);
if (costheta > 5e-2)
    res=norm(z-lam*q)/costheta; err=[err; res]; lambda=[lambda; lam];
else
    disp(' \n_\t_\[ATTENZIONE]:_AUTOVALORE_MULTIPLO'); break;
end
x=q;
end

```

Forniamo ora alcune spiegazioni del codice in `invpower`.

1. Per risolvere il sistema lineare in 4.5, si effettua una fattorizzazione $PM = LU$ della matrice $M = A - \mu I$;
2. All'interno del ciclo while, nella prima riga si calcola z_k , mentre nella successiva un suo versore q_k , e σ_k è immagazzinato in `lam`;
3. Similmente al metodo diretto si effettua il prodotto scalare di un'autovalore sinistro con uno destro.

7.6. Esempio 1. Appliciamo il metodo delle potenze inverse per il calcolo dell'autovalore più piccolo in modulo della matrice

$$\begin{aligned}
 A &= \begin{pmatrix} -15.5 & 7.5 & 1.5 \\ -51 & 25 & 3 \\ -25.5 & 7.5 & 11.5 \end{pmatrix} \\
 &= \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 2 & 5 & 6 \\ 7 & 9 & 3 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 10 & 0 & 0 \\ 0 & 10 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 2 & 5 & 6 \\ 7 & 9 & 3 \end{pmatrix}^{-1} \quad (7.2)
 \end{aligned}$$

Come visto la matrice A è quindi diagonalizzabile, ha autovalori 10, 10, 1 e relativi autovettori è (1, 2, 7), (2, 5, 9), (3, 6, 3) formanti una base di \mathbb{R}^3 . Quale vettore iniziale del metodo delle potenze consideriamo

$$z_0 = (1, 1, 1) = (7/6) \cdot (1, 2, 7) - 1 \cdot (2, 5, 9) + (11/18) \cdot (3, 6, 3)$$

e quindi il metodo delle potenze inverse applicato ad A , e avente quale punto iniziale z_0 può essere utilizzato per il calcolo dell'autovalore di minimo modulo di A .

```

>>> z0=[1;1;1]; mu=0; toll=10^(-8); nmax=10;
>>> A=[-15.5 7.5 1.5; -51 25 3; -25.5 7.5 11.5]
A =
-15.500000000000000    7.500000000000000    1.500000000000000
-51.000000000000000   25.000000000000000    3.000000000000000
-25.500000000000000    7.500000000000000   11.500000000000000
>>> [lambda, x, niter, err]=invpower(A,z0,mu,toll,nmax)
lambda =
0.39016115351993
0.94237563941268
0.99426922936854
0.99942723776656
0.99994272692315
0.99999427272378
0.99999942727270
0.99999994272728

```

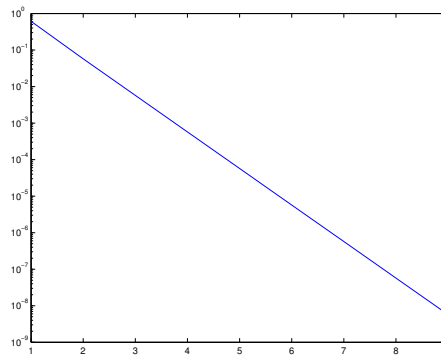



FIGURA 7.1. Grafico che illustra la convergenza lineare del metodo delle potenze inverse nell'esempio 1.

```

    0.99999999427273
x =
    0.40824829053809
    0.81649658085350
    0.40824829053809
niter =
     9
err =
    0.81535216507377
    0.08358101289062
    0.00838126258396
    0.00083836078891
    0.00008383842712
    0.00000838386620
    0.00000083838685
    0.00000008383868
    0.00000000838387
>>

```

La convergenza è lineare (come si intuisce dalle approssimazioni contenute nel vettore `lambda`).

Per vederlo, dalla shell di Matlab/Octave calcoliamo l'errore assoluto/relativo relativo all'autovalore 1:

```

>> s=1-lambda
s =
    0.60983884648007
    0.05762436058732
    0.00573077063146
    0.00057276223344
    0.00005727307685
    0.00000572727622
    0.00000057272730
    0.00000005727272
    0.00000000572727
>> semilogy(1:length(s),s)

```

generando il grafico in scala semi-logaritmica in figura che evidentemente sottolinea la convergenza lineare.

7.7. Il metodo QR. Una versione di base del metodo QR è la seguente. Si salvi il file `houshess.m` che implementa la trasformazione per similitudine di A in una matrice di Hessenberg

```

function [H,Q]=houshess(A)

% REDUCTION OF A MATRIX TO A SIMILAR HESSENBERG ONE.
% SEE QUARTERONI, SACCO, SALERI P. 192.

n=max(size(A)); Q=eye(n); H=A;

for k=1:(n-2)
    [v,beta]=vhouse(H(k+1:n,k)); I=eye(k); N=zeros(k,n-k);
    m=length(v); R=eye(m)-beta*v*v'; H(k+1:n,k:n)=R*H(k+1:n,k:n);
    H(1:n,k+1:n)=H(1:n,k+1:n)*R; P=[I,N; N',R]; Q=Q*P;
end

```

ove `vhouse.m` è definito da

```

function [v,beta]=vhouse(x)

% BUILDING HOUSEHOLDER VECTOR.
% SEE QUARTERONI, SACCO, SALERI P. 197.

n=length(x); x=x/norm(x); s=x(2:n)'*x(2:n); v=[1; x(2:n)];
if (s==0)
    beta=0;
else
    mu=sqrt(x(1)^2+s);
    if (x(1) <= 0)
        v(1)=x(1)-mu;
    else
        v(1)=-s/(x(1)+mu);
    end
    beta=2*v(1)^2/(s+v(1)^2);
    v=v/v(1);
end

```

quindi `QRbasicmethod.m` che calcola la matrice triangolare T relativa a QR:

```

function [T,hist]=QRbasicmethod(T_input,maxit)

% QR METHOD FOR A SYMMETRIC TRIDIAGONAL MATRIX "T_input".

T=T_input;
hist=sort(diag(T));

for index=1:maxit
    [Q,R]=qr(T);
    T=R*Q; % NEW SIMILAR MATRIX.
    hist=[hist sort(diag(T))]; % IT STORES THE DIAGONAL ELEMENTS
                                % OF THE "index" ITERATION.
end

```

8. Esercizio. Data la matrice di Hilbert di ordine 5, ottenibile in Matlab col comando `hilb(5)` si calcolino col metodo delle potenze i suoi minimi e massimi autovalori in modulo. Da questi si calcoli il condizionamento della matrice in norma 2 e lo si confronti con `cond(hilb(5),2)`. Eseguire lo stesso esercizio utilizzando il metodo QR.

9. Esercizi facoltativi.

9.1. Facoltativo. Sugli autovalori della matrice di Poisson. In questa sezione desideriamo calcolare gli autovalori della matrice (simmetrica e a banda) 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

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

che si ottiene dal comando `makefish`. Più precisamente in `demoQR.m` scriviamo il seguente codice per il calcolo degli autovalori della matrice di Poisson `makefish(2)`, mostrando come la matrice di partenza A viene trasformata in una matrice di Hessenberg H da cui si calcola la matrice T triangolare superiore prodotta dalle iterazioni di QR:

```
format short

maxit=100;
siz=2;

A = makefish(siz);
eigs=eig(A);

[H,Q]=houshess(A);

[T,hist]=QRbasicmethod(H,maxit);

A
H
T
eig(A)
```

Otteniamo come risultato

```
>> demoQR
A =

    4    -1    -1     0
   -1     4     0    -1
   -1     0     4    -1
    0    -1    -1     4

H =

    4.0000    1.4142    0.0000   -0.0000
    1.4142    4.0000    1.4142   -0.0000
   -0.0000    1.4142    4.0000   -0.0000
         0   -0.0000   -0.0000    4.0000

T =

    6.0000    0.0000   -0.0000   -0.0000
    0.0000    4.0000    0.0000   -0.0000
   -0.0000   -0.0000    4.0000    0.0000
```

```

0    -0.0000    0.0000    2.0000

ans =

    2.0000
    4.0000
    4.0000
    6.0000

>>

```

In cui si vede che gli autovalori, come affermato dalla teoria, sono le componenti diagonali della matrice T .

Vogliamo ora applicare il metodo delle potenze e delle potenze inverse per il calcolo di alcuni autovalori di una matrice di Poisson (ottenuta come `makefish(5)`) i cui blocchi sono matrici 5×5 .

Salviamo nel file `demoautovalori1.m` il seguente codice Matlab/Octave:

```

siz=5;
A = makefish(siz);
eigs=eig(A);
abs_eigs=abs(eigs);
min_eig=min(abs(eigs));
max_eig=max(abs(eigs));
mu=0;

x0=ones(size(A,1),1); nmax=50; toll=10^(-11);

% METODO DELLE POTENZE.
[lambdal, x1, niter, hist_dp]=powerm(A,x0,toll,nmax);
lambdamax=lambdal(length(lambdal));
fprintf('\n\n\t\t[MAGGIOR_AUTOVALORE_(IN_MODULO)]');
fprintf('\n\n\t\t[CALCOLATO]:_%.15f_[ESATTO]:_%.15f',lambdamax,max_eig);
res=norm(A*x1-lambdamax*x1);
fprintf('\n\n\t\t[ABS.ERR.]:_%.2e_[RES]:_%.2e',
abs(lambdamax-max_eig),res);

% METODO DELLE POTENZE INVERSE.
[lambda, x, niter, hist_ip]=invpower(A,x0,mu,toll,nmax);
lambdamin=lambda(length(lambda));
fprintf('\n\n\n\t\t[MINOR_AUTOVALORE_(IN_MODULO)]');
fprintf('\n\n\t\t[CALCOLATO]:_%.15f_[ESATTO]:_%.15f',lambdamin,min_eig);
res=norm(A*x-lambdamin*x);
fprintf('\n\n\t\t[ABS.ERR.]:_%.2e_[RES]:_%.2e',
abs(lambdamin-min_eig),res);

% METODO DELLE POTENZE INVERSE PER "MU" NON NULO.
mu=5.9;
[minval, minindex]=min(abs(eigs-mu));
minmu_eig=eigs(minindex);
[lambdamu, x, niter, hist_ipmu]=invpower(A,x0,mu,toll,nmax);
lambdamumin=lambdamu(length(lambdamu));
fprintf('\n\n\n\t\t[MINOR_AUTOVALORE_(IN_MODULO)]');
fprintf('\n\n\t\t[CALCOLATO]:_%.15f_[ESATTO]:_%.15f',lambdamumin,minmu_eig);
res=norm(A*x-lambdamumin*x);
fprintf('\n\n\t\t[MU]:_%.5f_[ABS.ERR.]:_%.2e_[RES]:_%.2e',mu,abs(lambdamumin-minmu_eig),res);

% METODO DELLE POTENZE INVERSE PER "MU" NON NULO.

```

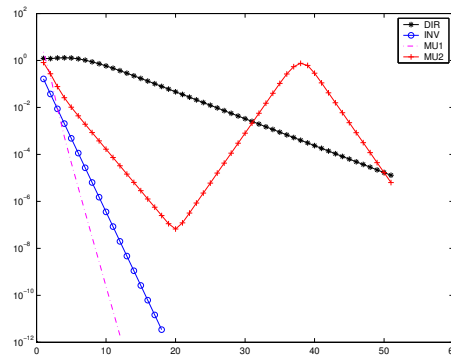


FIGURA 9.1. Grafico che illustra il residuo per iterazione del metodo delle potenze diretto e nelle versioni di Wielandt.

```
mu2=2.8;
[ minval, minindex ]=min( abs( eig( A ) - mu2 ) );
minmu2_eig=eig( A )( minindex );
[ lambda_mu2, x, niter, hist_ipmu2 ]=invpower( A, x0, mu2, tol1, nmax );
lambda_mu2min=lambda_mu2( length( lambda_mu2 ) );
fprintf( '\n \t \t \t [MINOR_AUTOVALORE_ (IN_MODULO) ] \t \t \t ');
fprintf( '\n \t \t \t [CALCOLATO] : \t \t \t %5.15f \t \t \t [ESATTO] : \t \t \t %5.15f \t \t \t ', lambda_mu2min, minmu2_eig );
res=norm( A*x - lambda_mu2min*x );
fprintf( '\n \t \t \t [MU] : \t \t \t %5.5f \t \t \t [ABS_ERR.] : \t \t \t %2.2e \t \t \t [RES] : \t \t \t %2.2e \t \t \t ', mu2, abs( lambda_mu2min - minmu2_eig ), res );

hold off;
semilogy( 1:length( hist_dp ), hist_dp, 'k-*' ); hold on;
semilogy( 1:length( hist_ip ), hist_ip, 'b-o' ); hold on;
semilogy( 1:length( hist_ipmu ), hist_ipmu, 'm-d' ); hold on;
semilogy( 1:length( hist_ipmu2 ), hist_ipmu2, 'r-v' );

% legend( 'DIR', 'INV', 'MU1', 'MU2' );
```

La demo effettua quanto segue.

1. Definita la matrice A , i suoi autovalori vengono calcolati con `eig`, così da poter vedere il comportamento dei vari metodi.
2. Successivamente testiamo il metodo delle potenze per il calcolo dell'autovalore di massimo modulo.
3. In seguito calcoliamo l'autovalore di minimo modulo e quelli più vicini a $\mu = 5.9$ e $\mu = 2.8$.
4. Alla fine plottiamo in scala semilogaritmica, iterazione per iterazione, il residuo (pesato).
5. La parte relativa a

```
% legend( 'DIR', 'INV', 'MU1', 'MU2' );
```

è commentata, in quanto il comando `legend` non è implementato nelle vecchie versioni di Octave. Per usare la legenda, basta togliere il commento.

Lanciato il programma `demoautovalori1`, otteniamo

```
>> demoautovaloril

[MAGGIOR AUTOVALORE (IN MODULO)]
[CALCOLATO]: 7.464101615040614 [ESATTO]: 7.464101615137755
[ABS.ERR.]: 9.71e-011 [RES]: 1.30e-005

[MINOR AUTOVALORE (IN MODULO) ]
[CALCOLATO]: 0.535898384862246 [ESATTO]: 0.535898384862247
[ABS.ERR.]: 1.67e-015 [RES]: 3.46e-012

[MINOR AUTOVALORE (IN MODULO) ]
[CALCOLATO]: 5.732050807568878 [ESATTO]: 6.000000000000000
[MU]: 5.90000 [ABS.ERR.]: 2.68e-001 [RES]: 1.96e-012

[MINOR AUTOVALORE (IN MODULO) ]
[CALCOLATO]: 2.999999999999130 [ESATTO]: 3.000000000000000
[MU]: 2.80000 [ABS.ERR.]: 8.71e-013 [RES]: 7.98e-007

>>
```

Come errore assoluto abbiamo calcolato $e_a := |\lambda - \lambda_c|$ dove λ è l'autovalore esatto mentre λ_c è quello calcolato. Quindi abbiamo calcolato la norma 2 del residuo $r_2 := \|Ax_c - \lambda_c x_c\|$ dove x_c è l'autovettore calcolato dal metodo delle potenze (diretto o inverso) relativo all'autovalore $\lambda \approx \lambda_c$.

Osserviamo che può esserci molta differenza tra e_a e r_2 . Nel metodo delle potenze dirette, e nel calcolo dell'autovalore più vicino a $\mu = 2.8$ si ha infatti $e_a \ll r_2$, mentre nel calcolo dell'autovalore più vicino a $\mu = 5.9$ accade il contrario. In quest'ultimo caso il metodo prima si avvicina all'autovalore 6 e poi diverge verso l'altro autovalore che vale approssimativamente $5.732050807568878e + 00$. Quindi il residuo è giusto sia piccolo, ma non si ha la convergenza verso l'autovalore sperato.

9.2. Facoltativo. Calcolo degli zeri di un polinomio, via autovalori della matrice compagna. Si può dimostrare (cf. [32]) che gli zeri del polinomio monico di grado n

$$p(t) = c_0 + c_1 t + \dots + c_{n-1} t^{n-1} + t^n$$

sono gli autovalori della matrice compagna (o equivalentemente della sua trasposta visto che $\text{eig}(A) = \text{eig}(A^T)$)

$$C = \begin{bmatrix} 0 & 0 & \dots & 0 & -c_0 \\ 1 & 0 & \dots & 0 & -c_1 \\ 0 & 1 & \dots & 0 & -c_2 \\ \vdots & \vdots & \dots & \vdots & \vdots \\ 0 & 0 & \dots & 1 & -c_{n-1} \end{bmatrix}.$$

Sfruttando il comando `eig`, e osservando che

```
>> A=[1 2; 3 4]

A =

     1     2
     3     4

>> B=[5 6; 7 8]

B =
```

```

      5      6
      7      8
>> C=[A B]
C =
      1      2      5      6
      3      4      7      8
>> D=[A; B]
D =
      1      2
      3      4
      5      6
      7      8
>>

```

scrivere un codice Matlab che risolva un'equazione algebrica calcolando gli autovalori della matrice compagna associata. Effettuare quindi un test su un polinomio di cui si conoscono gli zeri e valutare la bontà del proprio codice. Di seguito si calcolino gli zeri di modulo massimo e minimo usando il metodo delle potenze e la sua variante inversa.

9.3. Facoltativo: altri esempi ed esercizi. Di seguito citiamo alcuni esercizi ed esempi.

1. Lanciare il codice `demoQR` relativamente alla matrice definita da `makefish(3)` (e non come scritto nel file, alla matrice ottenuta con il comando `makefish(2)`). A tal proposito modificare la variabile `siz`.
2. Calcolare con il metodo QR gli autovalori della matrice di Hilbert di ordine 5 (ricordare il comando `eig(hilb(5))`) e confrontarli con quelli prodotti dal metodo QR. Applicare il metodo delle potenze per il calcolo dell'autovalore di modulo massimo e il metodo di Wielandt per quelle di modulo minimo.
3. Applicare il metodo QR per il calcolo degli autovalori di

$$A = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 1 \end{pmatrix}$$

E' a blocchi la matrice generata dal metodo QR? E se così non fosse come ovviare al problema? (cf. [7], p. 393). Suggerimento: ricordarsi come calcolare gli autovalori di una matrice di ordine 2 via equazioni di secondo grado.

4. Applicare il metodo QR per il calcolo degli autovalori di

$$A = \begin{pmatrix} 3 & 17 & -37 & 18 & 40 \\ 1 & 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}$$

E' la matrice generata dal metodo QR a blocchi? E se cosí non fosse come ovviare al problema? (cf. [14], p. 195).

5. Applicare il metodo delle potenze per il calcolo dell'autovalore di massimo modulo di

$$A(\alpha) = \begin{pmatrix} \alpha & 2 & 3 & 13 \\ 5 & 11 & 10 & 8 \\ 9 & 7 & 6 & 12 \\ 4 & 14 & 15 & 1 \end{pmatrix}$$

Confrontare i risultati ottenuti con quelli di $\text{eig}(A)$ per $\alpha = 30, -30$ plottando il grafico dell'errore tra l'approssimazione della soluzione fornita iterazione per iterazione dal metodo delle potenze con quella di $\max(\text{abs}(\text{eig}(A)))$ (cf. [15], p.133).

6. Si dica se è possibile applicare (sperimentarlo!) il metodo delle potenze per il calcolo dell'autovalore di massimo modulo di

$$A = \begin{pmatrix} 1/3 & 2/3 & 2 & 3 \\ 1 & 0 & -1 & 2 \\ 0 & 0 & -5/3 & -2/3 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}$$

Dare una spiegazione di tale fenomeno (cf. [15], p. 141, esercizio 6.5).

10. Online. Sul calcolo degli autovalori di una matrice è possibile trovare online e gratuitamente del software per Matlab.

1. Dal sito

`http://mox.polimi.it/~fausal/matlab.html`

si possono scaricare i files `eigpower.m` e `invshift.m` che implementano i metodi delle potenze, e `qrbasis.m` una versione di base del metodo QR.

2. Vario software di algebra lineare è presente al sito

`http://www.math.sc.edu/~meade/math706/MATLAB-files/index.html`

in particolare le versioni con shift di QR citate poco sopra.

3. Estremamente interessante la homepage di Y. Saad

`http://www-users.cs.umn.edu/~saad/books.html`

in cui si trovano gratuitamente manuali sul calcolo di autovalori e risoluzione di sistemi lineari.

RIFERIMENTI BIBLIOGRAFICI

- [1] E. Andersson e P.A. Ekström, *Investigating Google's PageRank algorithm*, <http://www.it.uu.se/edu/course/homepage/projektTDB/vt04/projekt5/website/report.pdf>.
- [2] K. Atkinson, *Introduction to Numerical Analysis*, Wiley, 1989.
- [3] D. Bini, M. Capovani e O. Menchi, *Metodi numerici per l'algebra lineare*, Zanichelli, 1988.
- [4] C. Brezinski e M. Redivo Zaglia, *Some numerical analysis problems behind web search*, Transgressive Computing 2006.

- [5] C. Brezinski e M. Redivo Zaglia, *The PageRank vector: properties, computation, approximation and acceleration*, SIAM J. Matr. Anal. Appl., Vol.28, N.2, p. 551-575.
- [6] C. Brezinski e M. Redivo Zaglia, *Méthodes numériques itératives*, Ellipses, 2006.
- [7] V. Comincioli, *Analisi Numerica, metodi modelli applicazioni*, Mc Graw-Hill, 1990.
- [8] S.D. Conte e C. de Boor, *Elementary Numerical Analysis, 3rd Edition*, Mc Graw-Hill, 1980.
- [9] J. Dongarra, *The Top 10 Algorithms*
<http://web.ist.utl.pt/mcasquilho/acad/or/aux/Top10Algorithms.pdf>
- [10] G.H. Golub e C.F. Van Loan, *Matrix Computation, 3rd Edition*, The John Hopkins University Press 1996.
- [11] The MathWorks Inc., *Numerical Computing with Matlab*,
<http://www.mathworks.com/moler>
- [12] Netlib,
<http://www.netlib.org/templates/matlab/>
- [13] P. Olver, *Notes on orthogonal bases and the workings of the QR algorithm*
http://www.math.umn.edu/olver/aims/q_r.pdf
- [14] A. Quarteroni, R. Sacco, F. Saleri, *Matematica numerica*, 2001.
- [15] A. Quarteroni e F. Saleri, *Introduzione al calcolo scientifico*, Springer Verlag, 2006.
- [16] M. Redivo Zaglia, *Calcolo numerico. Metodi e algoritmi*, quarta edizione., L. Progetto, 2009.
- [17] A. Suli e D. Mayers, *An Introduction to Numerical Analysis*, Cambridge University Press, 2003.
- [18] Mac Tutor (Semyon Aranovich Gershgorin)
<http://www-history.mcs.st-andrews.ac.uk/Biographies/Gershgorin.html>.
- [19] Mac Tutor (Alston Scott Householder)
<http://www-gap.dcs.st-and.ac.uk/history/Mathematicians/Householder.html>.
- [20] Mac Tutor (Helmut Wielandt)
<http://www-gap.dcs.st-and.ac.uk/history/Biographies/Wielandt.html> .
- [21] NA Digest, *John Francis, Co-Inventor of QR*
<http://www.netlib.org/na-digest-html/07/v07n34.html>.
- [22] Wikipedia (John G.F. Francis)
http://en.wikipedia.org/wiki/John_G.F._Francis.
- [23] Wikipedia (Semyon Aranovich Gershgorin)
http://en.wikipedia.org/wiki/Semyon_Aranovich_Gershgorin.
- [24] Wikipedia (James Wallace Givens)
http://en.wikipedia.org/wiki/Wallace_Givens.
- [25] Wikipedia (Karl Hessenberg)
http://en.wikipedia.org/wiki/Karl_Hessenberg.
- [26] Wikipedia (Alston Scott Householder)
http://it.wikipedia.org/wiki/Alston_Scott_Householder.
- [27] Wikipedia (Vera N. Kublanovskaya)
http://en.wikipedia.org/wiki/Vera_N._Kublanovskaya,
<http://www.pdmi.ras.ru/eng/perso/kublanovskaya.php>.
- [28] Wikipedia (Matrice irriducibile)
http://it.wikipedia.org/wiki/Matrice_irriducibile
- [29] Wikipedia (Herman Müntz)
http://en.wikipedia.org/wiki/Herman_Müntz.
- [30] Wikipedia (Eigenvalue)
<http://en.wikipedia.org/wiki/Eigenvalue>.
- [31] Wikipedia (Inverse iteration)
http://en.wikipedia.org/wiki/Inverse_iteration.
- [32] Wikipedia (Matrice Compagna)
http://it.wikipedia.org/wiki/Matrice_compagna.
- [33] Wikipedia (Metodo delle potenze)
http://it.wikipedia.org/wiki/Metodo_delle_potenze.
- [34] Wikipedia (PageRank)
http://it.wikipedia.org/wiki/Page_rank.
- [35] Wikipedia (Rayleigh quotient)
http://en.wikipedia.org/wiki/Rayleigh_quotient.
- [36] Wikipedia (QR algorithm)
http://en.wikipedia.org/wiki/QR_algorithm.
- [37] Wikipedia (QR decomposition)
http://en.wikipedia.org/wiki/QR_decomposition.
- [38] Wikipedia (Teoremi di Gershgorin)
http://it.wikipedia.org/wiki/Teoremi_di_Gershgorin.