

Numerisches Programmieren, Übungen

10. Übungsblatt: Iterative Verfahren

1) Iterative Verfahren für lineare Gleichungssysteme

Für große lineare Gleichungssysteme kann es unter Effizienzgesichtspunkten interessant sein, anstelle der direkten Gauss-Elimination, ein iteratives Verfahren zur Lösung des Gleichungssystems zu verwenden. Die vielleicht einfachsten Varianten iterativer Löser werden u.a. als *Splitting-Verfahren* bezeichnet.

- a) Seien $n \in \mathbb{N}$, $A, M \in \mathbb{R}^{n,n}$ und $b \in \mathbb{R}^n$. Zeigen Sie, dass der Fixpunkt $x_* \in \mathbb{R}^n$, der den Splitting-Verfahren zugrundeliegenden Iterationsfunktion

$$\Phi(x) := x + M^{-1}(b - Ax) , \quad (1)$$

auch die Lösung des Gleichungssystems $Ax = b$ ist!

- b) Durch Festlegung der Matrix M in Formel (1) erhält man unterschiedliche Splitting-Verfahren. Bei der Auswahl von M sollten folgende Kriterien berücksichtigt werden:
- (i) M sollte möglichst schnell invertierbar sein und
 - (ii) M sollte die Matrix A möglichst gut approximieren!

Ordnen Sie die Vorschläge $M_1 = I_n$, $M_2 = A$ und $M_3 = \text{diag}(A)$ nach dem Grad der Erfüllung der beiden obigen Kriterien.

- c) Entwickeln Sie einen Pseudo-Code für die Durchführung einer Iteration nach Formel (1) unter Verwendung von $M_3 = \text{diag}(A)$!
- d) Das in Teilaufgabe c) entwickelte Verfahren wird Jacobi-Verfahren genannt. Es lässt sich hinsichtlich Konvergenzgeschwindigkeit und Speicherbedarf noch deutlich verbessern. Machen Sie einen Vorschlag zur Verbesserung des Verfahrens! Wie ändert sich dadurch die Iterationsvorschrift in Matrixnotation?

2) Jacobi- und Gauß-Seidel-Verfahren

Gegeben sei das lineare Gleichungssystem $Ax = b$ mit

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

- a) Bestimmen Sie die exakte Lösung des linearen Gleichungssystems mittels Gauß-Elimination.
- b) Führen Sie drei Schritte des Jacobi-Verfahrens durch um eine näherungsweise Lösung des linearen Gleichungssystems $Ax = b$ zu erhalten. Verwenden Sie als Startwert $x^{(0)}$ den Nullvektor $x^{(0)} = (0, 0, 0)^T$.

Vergleichen Sie ihr Endergebnis $x^{(3)}$ mit der exakten Lösung aus Teilaufgabe a).

- c) Führen Sie zwei Schritte des Gauß-Seidel-Verfahrens durch um eine näherungsweise Lösung des linearen Gleichungssystems $Ax = b$ zu erhalten. Verwenden Sie als Startwert $x^{(0)}$ wieder den Nullvektor.

Vergleichen Sie abschließend ihr Endergebnis $x^{(2)}$ mit der exakten Lösung aus Teilaufgabe a) und mit dem Ergebnis aus Teilaufgabe b).

3) Optimale Schrittweite des Verfahrens des steilsten Abstiegs

Betrachten Sie die quadratische Funktion

$$f(x) = \frac{1}{2}x^T Ax - b^T x + c, \quad (2)$$

wobei die Matrix $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ positiv symmetrisch definit sei.

Finden Sie die optimale Schrittweite α_k eines Iterationsschrittes

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

der Methode des steilsten Abstiegs. Dabei bezeichnet $d^{(k)} := -\nabla f(x^{(k)})$ die Suchrichtung.

4) Newton-Verfahren

- a) Gegeben sei die Funktion $f : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ definiert durch $f(x) = mx + b$.

(i) Bestimmen Sie die Nullstelle von f auf direktem Weg!

(ii) Formulieren Sie für die Funktion f das Newton-Verfahren! Nach wievielen Iterationen hat das Verfahren die Nullstelle gefunden?

- b) (i) Formulieren Sie das Newton-Verfahren für die Funktion $f(x) = x^2 - 2x - 3$ (alternativ: $f(x) = x^2 - 8x + 15$)!

(ii) Berechnen Sie die ersten 4 Iterierten sowohl für den Startwert $x_0 = 2$ als auch für den Startwert $\tilde{x}_0 = -2$ (alternativ: $x_0 = 2$ und $\tilde{x}_0 = 6$)! Gegen welche Werte konvergieren die beiden Folgen der Iterierten?

Zum Abschluss dieses Übungsblattes folgt eine Aufgabe zum tieferen Verständnis der Konvergenz des Verfahrens des steilsten Abstiegs. Sie wird weder im Tutorium besprochen noch ist sie klausurrelevant. Jedoch stellt sie einen interessanten Zusammenhang zwischen der Konvergenzgeschwindigkeit und der Kondition der betrachteten Systemmatrix her.

Vertiefung: Konvergenz des Verfahrens des steilsten Abstiegs

a) Zeigen Sie die Ungleichung

$$\|x^* - x^{(k+1)}\|_A \leq \left(\frac{\lambda_{\max}(A) - \lambda_{\min}(A)}{\lambda_{\max}(A) + \lambda_{\min}(A)} \right) \|x^* - x^{(k)}\|_A,$$

wobei $\|x\|_A := \sqrt{x^T A x}$ gilt. x^* bezeichnet das Minimum von (2).

Hinweise:

- Betrachten Sie den Ausdruck

$$\frac{\|x^* - x^{(k+1)}\|_A^2}{\|x^* - x^{(k)}\|_A^2}$$

und setzen Sie die Iterationsvorschrift ein.

- Um den Ausdruck zu vereinfachen, beachten Sie die Beziehung zwischen dem Fehler $e^{(k)} := x^{(k)} - x^*$ und dem Residuum $r^{(k)} = b - A x^{(k)}$:

$$r^{(k)} = -A e^{(k)}.$$

- Verwenden Sie abschließend die *Ungleichung von Kantorovic* für symmetrisch positiv definite Matrizen A :

$$\frac{x^T A x \cdot x^T A^{-1} x}{(x^T x)^2} \leq \frac{(\lambda_{\max}(A) + \lambda_{\min}(A))^2}{4\lambda_{\max}(A)\lambda_{\min}(A)}.$$

Ein Beweis der Ungleichung ist nicht notwendig.

b) Für symmetrisch positiv definite Matrizen gilt

$$\kappa_2(A) = \|A\|_2 \cdot \|A^{-1}\|_2 = \frac{\lambda_{\max}}{\lambda_{\min}}.$$

Zeigen Sie mit Hilfe des Ergebnisses aus Teilaufgabe a) die folgende Fehlerabschätzung für die Methode des steilsten Abstiegs:

$$\|x^* - x^{(k)}\|_A \leq \left(\frac{\kappa_2(A) - 1}{\kappa_2(A) + 1} \right)^k \|x^* - x^{(0)}\|_A.$$

Was bedeutet dies für die Konvergenz des Verfahrens im Fall von Matrizen A mit sehr großen Konditionszahlen $\kappa_2(A)$?