

Numerisches Programmieren, Übungen

12. Übungsblatt: Iterative Verfahren II

1) Kondition eines Eigenwertproblems

- i) Finden Sie alle Eigenwerte $\lambda_i(\varepsilon)$ und Eigenvektoren $v_i(\varepsilon)$ der Matrix

$$A(\varepsilon) = \begin{pmatrix} 1 + \varepsilon \cos(2/\varepsilon) & -\varepsilon \sin(2/\varepsilon) \\ -\varepsilon \sin(2/\varepsilon) & 1 - \varepsilon \cos(2/\varepsilon) \end{pmatrix}.$$

- ii) Wie verhalten sich $A(\varepsilon)$, $\lambda_i(\varepsilon)$, und $v_i(\varepsilon)$ für $\varepsilon \rightarrow 0$? Ist das Eigenwert- bzw. Eigenvektorproblem für kleine ε gut konditioniert?

2) Satz von Gerschgorin

- i) Beweisen Sie den *Satz von Gerschgorin*:

Sei $A \in \mathbb{C}^{n \times n}$ eine quadratische Matrix mit Einträgen a_{ij} . Dann liegt jeder Eigenwert λ von A in mindestens einer der Kreisscheiben K_j , die durch

$$K_j := \left\{ z \in \mathbb{C} : |z - a_{jj}| \leq \sum_{k=1, k \neq j}^n |a_{jk}| \right\}, \quad j = 1, \dots, n,$$

definiert sind.

Hinweis: Betrachten Sie die j te Komponente der Eigenwertgleichung $Ax = \lambda x$, wobei x_j der maximale Eintrag von x ist.

- ii) Zeichnen Sie für die Matrix

$$A = \begin{pmatrix} 7 & 2 & 1 & 1 \\ 2 & 5 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 4 & 0 \\ 1 & 0 & 0 & 3 \end{pmatrix}$$

die Gerschgorin-Kreise und finden Sie eine obere Schranke für die Kondition $\kappa_2(A)$. Hinweis: Benutzen Sie die Euklidische Norm.

3) Rayleigh Quotient

- i) Sei $x \in \mathbb{R}^n$ Eigenvektor einer Matrix $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$. Zeigen Sie, dass die zugehörigen Eigenwerte λ mit Hilfe des Rayleigh Quotienten berechnet werden können:

$$\lambda = \frac{x^T A x}{x^T x}.$$

- ii) Sei λ_{\min} und λ_{\max} der kleinste bzw. größte Eigenwert einer symmetrischen Matrix $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$. Zeigen Sie, dass folgende Zusammenhänge gelten:

$$\lambda_{\min} = \min_{x \neq 0} \frac{x^T A x}{x^T x}, \quad \lambda_{\max} = \max_{x \neq 0} \frac{x^T A x}{x^T x}.$$

Hinweis: Wegen

$$\lambda_{\min} = \min_{x \neq 0} \frac{x^T A x}{x^T x} = \min_{x \neq 0} \left(\frac{1}{\|x\|_2} x \right)^T A \left(\frac{1}{\|x\|_2} x \right) = \min_{\|y\|_2=1} y^T A y$$

ist es ausreichend, folgende Zusammenhänge zu zeigen:

$$\lambda_{\min} = \min_{\|x\|_2=1} x^T A x \quad \text{and} \quad \lambda_{\max} = \max_{\|x\|_2=1} x^T A x.$$

4) Iterationsverfahren

- i) Berechnen Sie analytisch alle Eigenwerte und Eigenvektoren der Matrix $A = \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & 3 \end{pmatrix}$.
- ii) Führen Sie zwei Iteration der direkten Vektoriteration (power iteration) für A
- ohne Shift,
 - mit Shift $\mu = 1.5$ und
 - mit Shift $\mu = 3.5$

durch und berechnen Sie die zugehörige Eigenwertapproximation. Benutzen Sie dazu $x_0 = (1, 0)^T$ als Startvektor. Gegen welchen Eigenwert konvergiert die Iteration? Wie ist die Konvergenzrate für den jeweiligen Fall?

- iii) Für welchen Shift μ konvergiert die direkte Vektoriteration (power iteration) gegen den ersten bzw. zweiten Eigenwert von A ? Was passiert, falls $\mu = 3$ gewählt wird?