

Preconditioned Diagonally Dominant Properties of H -Matrix

Xuezhong Wang, Xiaomei Li

School of Mathematics and Statistics, Hexi University, Zhangye

Email: xuezhongwang77@126.com

Received: Nov. 28th, 2011; revised: Dec. 27th, 2011; accepted: Dec. 30th, 2011

Abstract: It is well-known that most iterative methods converge for linear system whose coefficient matrix A is strictly diagonally dominant. When A is not diagonally dominant, preconditioned techniques can be employed. This paper presents a method to establish appropriate preconditioned matrices P and Q for transforming an H -matrix which is non-diagonally dominant matrix into the diagonally dominant matrix. Numerical examples also show the effectiveness of this method.

Keywords: Iterative Method; H -Matrix; Preconditioned Matrix; Diagonally Dominant Properties

H -矩阵的预条件对角占优性

王学忠, 李晓梅

河西学院, 数学与统计学院, 张掖

Email: xuezhongwang77@126.com

收稿日期: 2011年11月28日; 修回日期: 2011年12月27日; 录用日期: 2011年12月30日

摘要: 对于线性方程组 $Ax = b$, 当 A 是严格对角占优矩阵时大部分迭代法都收敛。当 A 不是对角占优矩阵时, 预条件技术常被采用。本文给出了一种选取预条件矩阵 P 和 Q 的方法, 把一个非对角占优的 H -矩阵转化为严格对角占优矩阵。数值例子也说明了该方法的有效性。

关键词: 迭代法; H -矩阵; 预条件矩阵; 对角占优性

1. 引言

对于给定的线性方程组

$$Ax = b \quad (1)$$

其中 $A \in R^{n \times n}$ 和 $b \in R^n$ 已知, $x \in R^n$ 未知。当用迭代法求解时迭代格式为

$$x^{(k)} = Gx^{(k-1)} + c, \quad k = 1, 2, \dots$$

其中 $G \in R^{n \times n}$ 称为迭代矩阵, $x^{(0)} \in R^n$ 称为初值^[1]。

$A = M - N$, M 非奇被称为矩阵 A 的一个分裂, 对 A 进行不同的分裂可得到经典的 Jacobi 迭代法, Gauss-Seidel 迭代法, SOR ($0 < \omega \leq 1$) 迭代法, AOR 迭代法以及它们的变形。当系数矩阵 A 为严格对角占优矩阵时, 这些迭代法都收敛, 而且系数矩阵的对角占优性越强时, 迭代法的收敛速度越快。但是, 在实际问题中

我们所遇到的系数矩阵 A 不一定是严格对角占优的。 H -矩阵作为实际应用中常见的一种矩阵，它不一定对角占优，因此，对原方程组进行预条件等价变形，把非对角占优矩阵转化为对角占优矩阵便显得十分重要。例如，我们可以找两个非奇异矩阵 P 和 Q 使得 PAQ 严格对角占优，这样便把解 $Ax = b$ 的问题转化为解其同解问题

$$PAQy = Pb \tag{2}$$

和

$$x = Qy \tag{3}$$

因此，找到好的 P 和 Q 便成为问题的关键，这里 P 和 Q 被称为预条件矩阵。

本文主要考虑了当系数矩阵 A 是 H -矩阵时，怎样建立适当的预条件矩阵 P 和 Q ，使得 PAQ 严格对角占优。

2. 预备知识

定义 1^[2,3]: 设 $A = (a_{ij}) \in Z^{n \times n}$ ，若 A 可以表示为 $A = sI - B$ ，其中 $B \geq 0$ ，则当 $s > \rho(B)$ 时，称 A 为非奇异的 M -矩阵，简称 M -矩阵，这里 $\rho(\cdot)$ 表示矩阵的谱半径， $Z^{n \times n}$ 表示 n 阶 Z 矩阵。

定义 2^[4]: $n \times n$ 矩阵 A 是 H -矩阵，如果它的比较矩阵 $\langle A \rangle = (m_{ij})$ 是一个 M -矩阵，这里 $m_{ii} = |a_{ii}|$ ， $m_{ij} = -|a_{ij}| (i \neq j)$ 。

定义 3^[3]: 设 $A = (a_{ij}) \in C^{n \times n}$ ，若 A 满足

$$|a_{ii}| \geq \sum_{j \neq i} |a_{ij}|, \quad i = 1, 2, \dots, n$$

且至少有一个 i 使上述不等式严格成立，则称 A 为弱严格对角占优矩阵；如果上述 n 个不等式都严格成立，则称 A 为严格对角占优矩阵。

定义 4^[3]: 设 $A = (a_{ij}) \in C^{n \times n}$ ，若存在正对角矩阵 Q ，使得 $AQ(QA)$ 为行(列)严格对角占优矩阵，则称 A 为行(列)广义对角占优矩阵。

引理 1^[4]: A 是 H -矩阵的充要条件是存在 $r > 0$ 使 $\langle A \rangle r > 0$ ，其中 $r = (r_1, r_2, \dots, r_n)^T$ 。

引理 2^[5]: A 是对角元全为 1 的 H -矩阵，若 $\langle A \rangle^{-1} = (m_{ij})$ ，则成立不等式

$$\sum_{j=1}^n m_{ij} \geq 1, \quad i = 1, 2, \dots, n$$

3. 主要结论

若 A 是对角元全为 1 的 H -矩阵，我们考虑如下预条件矩阵 $P_\alpha \in R^{n \times n}$ 和 $Q \in R^{n \times n}$ ，

$$P_\alpha = I + S(\alpha) = \begin{pmatrix} 1 & & & -\alpha_1 a_{1s} & & \\ & 1 & & & -\alpha_2 a_{2t} & \\ & & \ddots & & & \\ -\alpha_r a_{rm} & & & \ddots & & \\ & & & & \ddots & \\ -\alpha_n a_{nr} & & & & & 1 \end{pmatrix}, \quad Q = \text{diag}(r_1, r_2, \dots, r_n) > 0$$

其中 $\alpha = (\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_n)$ 是参数， $r = (r_1, r_2, \dots, r_n)^T$ 是使得 $\langle A \rangle r > 0$ 的正向量。

定理 1: 若 A 是对角元全为 1 的 H -矩阵，假设存在一个正的正向量 $r = (r_1, r_2, \dots, r_n)^T$ 使得 $\langle A \rangle r > 0$ 让

$$c = \frac{(\langle A \rangle r)_i + 2|a_{im}|r_m}{|a_{im}|[2r_m - (\langle A \rangle r)_m]}$$

那么 $c > 1$ 。

证明: 由 $\langle A \rangle \leq I$, 及 $r > 0$ 知, $r \geq \langle A \rangle r$, 因而

$$c = \frac{(\langle A \rangle r)_i + 2|a_{im}|r_m}{|a_{im}|[2r_m - (\langle A \rangle r)_m]} > \frac{(\langle A \rangle r)_i + 2|a_{im}|r_m}{2|a_{im}|r_m} > 1.$$

定理 2: A 是对角元全为 1 的 H -矩阵, 假设存在一个正向量 $r = (r_1, r_2, \dots, r_n)^T$, 使得 $\langle A \rangle r > 0$, 如果满足条件 $0 \leq \alpha_i \leq c$, 那么, $P_\alpha A$ 是 H -矩阵, 并且 $P_\alpha A Q$ 是严格对角占优矩阵, 其中 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_n$ 是常数.

证明: 让

$$(P_\alpha A)_{ij} = a_{ij} - \alpha_i a_{im} a_{mj}, \quad i, j = 1, 2, \dots, n, \quad m = r, s, \dots, t,$$

取 $r = (r_1, r_2, \dots, r_n)^T$, 则

$$\begin{aligned} (\langle P_\alpha A \rangle r)_i &= |1 - \alpha_i a_{im} a_{mi}| r_i - |a_{im} - \alpha_i a_{im}| r_m - \sum_{j \neq i, m} |a_{ij} - \alpha_i a_{im} a_{mj}| r_j \\ &\geq r_i - |\alpha_i a_{im} a_{mi}| r_i - |1 - \alpha_i| |a_{im}| r_m - \sum_{j \neq i, m} |a_{ij}| r_j - \sum_{j \neq i, m} |\alpha_i a_{im} a_{mj}| r_j \end{aligned}$$

1) 当 $\alpha_i \leq 1$ 时,

$$\begin{aligned} (\langle P_\alpha A \rangle r)_i &\geq r_i - \alpha_i |a_{im}| |a_{mi}| r_i - |a_{im}| r_m + \alpha_i |a_{im}| r_m - \sum_{j \neq i, m} |a_{ij}| r_j - \alpha_i |a_{im}| \sum_{j \neq i, m} |a_{mj}| r_j \\ &= r_i - \sum_{j \neq i} |a_{ij}| r_j + \alpha_i |a_{im}| \left(r_m - \sum_{j \neq i} |a_{mj}| r_j \right) = (\langle A \rangle r)_i + \alpha_i |a_{im}| (\langle A \rangle r)_m > 0 \end{aligned}$$

2) 当 $1 \leq \alpha_i \leq c$ 时,

$$\begin{aligned} (\langle P_\alpha A \rangle r)_i &\geq r_i - \alpha_i |a_{im}| |a_{mi}| r_i + |a_{im}| r_m - \alpha_i |a_{im}| r_m - \sum_{j \neq i, m} |a_{ij}| r_j - \alpha_i |a_{im}| \sum_{j \neq i, m} |a_{mj}| r_j \\ &= r_i - \sum_{j \neq i} |a_{ij}| r_j + 2|a_{im}| r_m - \alpha_i |a_{im}| \left(-r_m + \sum_{j \neq i} |a_{mj}| r_j + 2r_m \right) \\ &= (\langle A \rangle r)_i + 2|a_{im}| r_m - \alpha_i |a_{im}| [2r_m - (\langle A \rangle r)_m] > 0 \end{aligned}$$

因此, $P_\alpha A$ 是 H -矩阵, 并且 $P_\alpha A Q$ 是严格对角占优矩阵.

从上面的定理 2, 我们可以看出, 只要存在一个正向量 $r = (r_1, r_2, \dots, r_n)^T$, 使得 $0 < (\langle A \rangle r)_i \leq 2, i = 1, 2, \dots, n$, 那么结论就是成立的, 但在具体的应用过程中, 我们很难确定 r 数值, 从而给应用带来不便, 因此可考虑 r 取特殊值来避免此不便. 现对 r 取特殊值为

$$r = \langle A \rangle^{-1} e > 0, \quad e = (1, 1, \dots, 1)^T, \quad Q = \text{diag}(r)$$

可得下面的定理.

推论 1: A 是对角元全为 1 的 H -矩阵, 让 $r = \langle A \rangle^{-1} e > 0, e = (1, 1, \dots, 1)^T$ 和 $Q = \text{diag}(r)$, 如果

$$\alpha_i \leq \frac{1 + 2|a_{im}|r_m}{|a_{im}|(2r_m - 1)}, \quad i = 1, 2, \dots, n, \quad m = r, s, \dots, t$$

那么, $P_\alpha A$ 是 H -矩阵, 并且 $P_\alpha A Q$ 是严格对角占优矩阵, 其中 $\alpha_1, \alpha_2, \dots, \alpha_n$ 是常数.

定理 3: 如果 $0 < \alpha_i \leq \frac{2|a_{im}|r_m}{|a_{im}|(2r_m - 1)}$, 那么 $P_\alpha A Q$ 是比 $A Q$ 对角占优性更强的矩阵.

证明 显然 $\frac{2|a_{im}|r_m}{|a_{im}|(2r_m-1)} > 1$, 只需表明

$$(\langle P_\alpha A \rangle r)_i \geq (\langle A \rangle r)_i = 1, \quad i = 1, 2, \dots, n \text{ 即可,}$$

1) 当 $\alpha_i \leq 1$ 时,

$$\begin{aligned} (\langle P_\alpha A \rangle r)_i &\geq r_i - \alpha_i |a_{im}| |a_{mi}| r_i - |a_{im}| r_m + \alpha_i |a_{im}| r_m - \sum_{j \neq i, m} |a_{ij}| r_j - \alpha_i |a_{im}| \sum_{j \neq i, m} |a_{mj}| r_j \\ &= r_i - \sum_{j \neq i} |a_{ij}| r_j + \alpha_i |a_{im}| \left(r_m - \sum_{j \neq i} |a_{mj}| r_j \right) \\ &= 1 + \alpha_i |a_{im}| \geq 1 \end{aligned}$$

2) 当 $1 < \alpha_i \leq \frac{2|a_{im}|r_m}{|a_{im}|(2r_m-1)}$ 时,

$$\begin{aligned} (\langle P_\alpha A \rangle r)_i &\geq r_i - \alpha_i |a_{im}| |a_{mi}| r_i + |a_{im}| r_m - \alpha_i |a_{im}| r_m - \sum_{j \neq i, m} |a_{ij}| r_j - \alpha_i |a_{im}| \sum_{j \neq i, m} |a_{mj}| r_j \\ &= r_i - \sum_{j \neq i} |a_{ij}| r_j + 2|a_{im}| r_m - \alpha_i |a_{im}| \left(-r_m + \sum_{j \neq i} |a_{mj}| r_j + 2r_m \right) \\ &= 1 + 2|a_{im}| r_m - \alpha_i |a_{im}| [2r_m - 1] \geq 1 \end{aligned}$$

4. 数值例子

例 1: 特别地, 对 $r = s = m = t = 1$, 我们运用定理 2 的结论, 对下面的测试矩阵去建立对角占优矩阵。取 H -矩阵 A 为

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 0.1000 & -0.2000 & 0.1000 \\ -0.9000 & 1 & 0.7000 & -0.8000 \\ 0.1000 & -0.1000 & 1 & 0.3000 \\ 0.3000 & -0.5000 & 0.2000 & 1 \end{pmatrix}$$

运用预条件矩阵 P_α 和 Q , 其中

$$P_\alpha = \begin{pmatrix} 0.9700 & 0 & 0 & 0 \\ -0.0270 & 1 & 0 & 0 \\ -0.0300 & 0 & 1 & 0 \\ -0.0300 & 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

$Q = \text{diag}(r)$, $r = \langle A \rangle^{-1} e > 0$, $e = (1, 1, \dots, 1)^T$, 即

$$Q = \begin{pmatrix} 16.4275 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 66.1832 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 22.3053 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 43.4809 \end{pmatrix}$$

得到

$$P_\alpha A Q = \begin{pmatrix} 15.9347 & 6.4198 & -4.3272 & 4.2176 \\ -15.2283 & 66.0045 & 15.7342 & -34.9021 \\ 1.1499 & -6.8169 & 22.4391 & 12.9138 \\ 4.4354 & -33.2901 & 4.5949 & 43.3505 \end{pmatrix}$$

很明显 $P_\alpha A Q$ 是严格对角占优矩阵。

例 2: 对任意给定的 $m = r, s, \dots, t$, 给出定理 2 的数值例子。取 H -矩阵 A 为

$$A = \begin{pmatrix} 1 & -0.1000 & 0.2000 & -0.1000 \\ -0.9000 & 1 & -0.7000 & 0.8000 \\ 0.1000 & -0.1000 & 1 & -0.3000 \\ 0.3000 & -0.5000 & -0.2000 & 1 \end{pmatrix}$$

运用预条件矩阵 P_α 和 Q , 其中

$$P_\alpha = \begin{pmatrix} 1 & 0.0070 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & -0.0080 \\ -0.0300 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0.0200 & 1 \end{pmatrix}$$

Q 同例 1, 得到

$$P_\alpha A Q = \begin{pmatrix} 16.3240 & -6.1550 & 4.3518 & -4.1046 \\ -14.8242 & 66.4479 & -15.5780 & 34.4369 \\ 1.1499 & -6.4198 & 22.1715 & -12.9138 \\ 4.9611 & -33.2240 & -4.0150 & 43.2200 \end{pmatrix}$$

很明显 $P_\alpha A Q$ 是严格对角占优矩阵。

例 3: 考虑如下 H -矩阵 A , 下面对它测试了(2)的 Gauss-Seidel 迭代法, 为了比较, 同时也测试了(1)的 Gauss-Seidel 迭代法。取 H -矩阵 A 为

$$A = \begin{pmatrix} 1 & c_1 & c_2 & c_3 & \cdots & \cdots & c_1 & c_2 & c_3 \\ c_3 & 1 & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & c_1 & c_2 \\ c_2 & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & c_1 \\ c_1 & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \vdots \\ \vdots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \vdots \\ \vdots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & c_3 \\ c_3 & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & c_2 \\ c_2 & c_3 & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & \ddots & c_1 \\ c_1 & c_2 & c_3 & \cdots & \cdots & c_1 & c_2 & c_3 & 1 \end{pmatrix}$$

其中, $c_1 = -\frac{2}{n}$, $c_2 = \frac{1}{(n+1)}$, $c_3 = -\frac{1}{(n+1)}$, n 表示矩阵 A 的阶数。我们选择 b 使得(1)的解为 $x = (1, 2, \dots, n)^T$,

让收敛准则为 $\frac{x^{k+1} - x^k}{x^{k+1}} \leq 10^{-6}$, 取初始迭代向量为 $x_0 = (0, 0, \dots, 0)^T$, 对 $n = 4, 10, 16, 25, 49$ 分别进行测试。我们在

下面的表格中表明了系数矩阵 A 和 $P_\alpha A Q$ 的 Gauss-Seidel 迭代的谱半径和迭代次数。在测试中, 我们取预条件矩阵 Q 为推论 1 中的矩阵, 取

$$P_\alpha = \begin{pmatrix} 1 & -c_1 & 0 & \cdots & 0 \\ 0 & 1 & \ddots & \ddots & \vdots \\ \vdots & \ddots & \ddots & \ddots & 0 \\ \vdots & \ddots & \ddots & \ddots & -c_1 \\ -c_1 & 0 & \cdots & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

让 $GS(A)$ 表示系数矩阵 A 的 Gauss-Seidel 迭代, $GS(P_\alpha A Q)$ 表示系数矩阵 $P_\alpha A Q$ 的 Gauss-Seidel 迭代。如下表 1:

Table 1. The spectral radius and iterative number
表 1. 谱半径和迭代次数

n	GS(A)		GS($P_\alpha A Q$)	
	谱半径	迭代次数	谱半径	迭代次数
4	0.4293	17	0.0055	4
10	0.5235	20	0.2543	11
16	0.5659	22	0.4012	14
25	0.5990	23	0.4968	17
49	0.6339	24	0.5838	21

从表 1, 我们可以看出系数矩阵为 $P_\alpha A Q$ 的 Gauss-Seidel 迭代要好于系数矩阵为 A 的 Gauss-Seidel 迭代。这也说明了我们方法的有效性。

5. 总结

选取预条件矩阵 P 和 Q , 使得 PAQ 是严格对角占优矩阵的方式有很多种, 本文给出了一种建立预条件矩阵 P 和 Q 的方法, 并给出了相应的结论, 数值例子也说明结论是正确的。

6. 致谢

作者由衷地感谢匿名的审稿人对本文提出的修改意见, 这大大提高了原稿的质量。

参考文献 (References)

- [1] 刑志栋, 曹建荣. 矩阵数值分析[M]. 西安: 陕西科学技术出版社, 2005.
- [2] 张凯院, 徐仲. 数值代数[M]. 北京: 科学出版社, 2006.
- [3] 陈公宁. 矩阵理论与应用[M]. 北京: 科学出版社, 2007.
- [4] 黄廷祝, 杨传胜. 特殊矩阵分析及应用[M]. 北京: 科学出版社, 2007.
- [5] 王学忠, 黄廷祝, 李良等. H -矩阵方程组的预条件迭代法[J]. 计算数学, 2007, 29(1): 89-96.