

Układy równań liniowych.

0.1 Metoda eliminacji Gaussa

Uniwersalna metoda eliminacji Gaussa stosuje się z powodzeniem¹ do rozwiązywania układów n równań liniowych z n niewiadomymi w skończonej ilości operacji arytmetycznych, jeżeli operacje arytmetyczne wykonywane są zmałymi błędami zaokrążeń. Ilość operacji arytmetycznych potrzebna do znalezienia rozwiązania n równań z n niewiadomymi jest proporcjonalna do n^3 .

Na przykład, jeżeli rozwiązujemy 1000 równań z 1000 niewiadomymi to ilość operacji arytmetycznych potrzebna do rozwiązania tego układu dla $n = 1000$ is równa około $k * 1000^3 \approx 1000000$, dla pewnej stałej k .

Zacznijmy opis metody eliminacji Gaussa od układu dwóch równań z dwiema niewiadomymi w postaci ogólnej

$$\begin{aligned} a_{11}x_1 + a_{12}x_2 &= a_{13} \\ a_{21}x_1 + a_{22}x_2 &= a_{23} \end{aligned} \quad (1)$$

Układ równań (1) piszemy również w postaci wektorowej

$$A\vec{x} = \vec{a},$$

w której wektor-kolumna niewiadomych \vec{x} i wektor-kolumna prawych stron \vec{a}

$$\vec{x} = \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix}, \quad \vec{a} = \begin{bmatrix} a_{13} \\ a_{23} \end{bmatrix}$$

oraz macierz:

$$A = \begin{bmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} \end{bmatrix}_{(2 \times 3)}$$

Example 0.1 *Rozwiąż układ dwóch równań liniowych z dwiema niewiadomymi x_1 i x_2*

$$\begin{aligned} 3x_1 + 2x_2 &= 12 & | * 3 \\ 6x_1 + 5x_2 &= 27. \end{aligned} \quad (2)$$

Rozwiązanie.

Pierwszy krok eliminacji. W pierwszym kroku eliminacji eliminujemy niewiadomą x_1 z drugiego równania.

¹Dla układów stabilnych

Żeby wyeliminować niewiadomą x_1 z drugiego równania, mnożymy pierwsze równanie w układzie (2) przez współczynnik

$$m_{21} = \frac{a_{21}}{a_{11}} = \frac{6}{2} = 3,$$

i dejmujemy stronami od drugiego równania.

Wten sposób otrzymamy zredukowany układ dwóch równań Gaussa eliminacj

$$\begin{aligned} 3x_1 + 2x_2 &= 12 \\ x_2 &= 3, \end{aligned} \tag{3}$$

Skąd obliczamy

$$x_2 = 3,$$

$$3x_1 + 2 * 3 = 12, \quad 3x_1 = 12 - 6 = 6,$$

$$x_1 = \frac{6}{3} = 2.$$

Sprawdzenie metodą starożytnych przez podstawienie rozwiązania $x_1 = 2$ i $x_2 = 3$ do układu równań (2)²

$$3 * 2 + 2 * 3 = 12$$

$$6 * 2 + 5 * 3 = 27$$

Example 0.2 *Rozwiąż układ trzech równań liniowych z trzema niewiadomymi x_1 i x_2*

$$2x_1 + 3x_2 + 4x_3 = 20$$

$$3x_1 - 4x_2 + 2x_3 = 1 \tag{4}$$

$$6x_1 + 4x_2 + 5x_3 = 29$$

Rozwiązanie.

Pierwszy krok eliminacji. W pierwszym kroku eliminacji eliminujemy niewiadomą x_1 z drugiego równania i z równania trzeciego układu (4).

Żeby wyeliminować niewiadomą x_1 z drugiego równania, mnożymy pierwsze równanie układu (4) przez współczynnik

$$m_{21} = \frac{a_{21}}{a_{11}} = \frac{3}{2} = \frac{3}{2},$$

²Metoda starożytnych polega na podstawieniu rozwiązania do oryginalnego układu równań, niezależnie od sposobu rozwiązania.

i dejmujemy stronami od drugiego równania. Wtedy otrzymamy układ równań

$$\begin{aligned} 2x_1 + 3x_2 + 4x_3 &= 20 \mid * \frac{3}{2} \\ -\frac{17}{2}x_2 - 4x_3 &= -29 \\ 6x_1 + 4x_2 + 5x_3 &= 29 \end{aligned} \quad (5)$$

Podobnie dejmujemy stronami od trzeciego równania równanie pierwsze pomnożone przez współczynnik

$$m_{31} = \frac{a_{31}}{a_{11}} = \frac{6}{2} = 3,$$

Po eliminacji niewiadomej x_1 z drugiego i z trzeciego równania otrzymamy pierwszy zredukowany układ równań liniowych

$$\begin{aligned} 2x_1 + 3x_2 + 4x_3 &= 20 \mid * \frac{6}{2} = 3 \\ -\frac{17}{2}x_2 - 7x_3 &= -38 \\ -5x_2 - 7x_3 &= -31 \end{aligned} \quad (6)$$

Drugi krok eliminacji. W drugim kroku eliminacji eliminujemy niewiadomą x_2 z trzeciego równania układu (6).

Żeby wyeliminować niewiadomą x_2 z trzeciego równania układu (6), mnożymy drugie równanie przez współczynnik

$$m_{32} = \frac{a_{32}^{(1)}}{a_{22}^{(1)}} = \frac{-5}{-\frac{17}{2}} = \frac{10}{17},$$

i dejmujemy stronami od trzeciego równania układu (6).

W ten sposób otrzymamy zredukowany system trzech równań Gaussa eliminacji

$$\begin{aligned} 2x_1 + 3x_2 + 4x_3 &= 20 \mid * \frac{6}{2} = 3 \\ -\frac{17}{2}x_2 - 7x_3 &= -29 \mid * \frac{10}{17} \\ -\frac{49}{17}x_3 &= -\frac{147}{17} \end{aligned}$$

Skąd obliczamy

$$\begin{aligned}
 49x_3 &= 147, & x_3 &= \frac{147}{49} = 3 \\
 -\frac{17}{2}x_2 - 7 * 3 &= -38, & -17x_2 &= -38 * 2 + 7 * 3 * 2 = -76 + 42 = -34, \\
 x_2 &= \frac{-34}{-17} = 2, \\
 2x_1 + 3 * 2 + 4 * 3 &= 20, & 2x_1 &= 20 - 6 - 12 = 2, \quad x_1 = \frac{2}{2} = 1.
 \end{aligned}$$

Sprawdzenie metodą starożytnych przez podstawienie rozwiązania $x_1 = 1$, $x_2 = 2$ i $x_3 = 3$ do układu równań (4)³

$$2 * 1 + 3 * 2 + 4 * 3 = 20$$

$$3 * 1 - 4 * 2 + 2 * 3 = 1$$

$$6 * 1 + 4 * 2 + 5 * 3 = 29$$

Example 0.3 Rozwiąż układ czterech równań liniowych z czterema niewiadomymi x_1 , x_2 , x_3 i x_4

$$\begin{aligned}
 2x_1 + x_2 + 4x_3 - 3x_4 &= 4 & | \quad m_{21} = 2 \quad | \quad m_{31} = 3 \quad | \quad m_{41} = 4 \\
 4x_1 - 3x_2 + x_3 - 2x_4 &= -7 \\
 6x_1 + 4x_2 - 3x_3 - x_4 &= 1 \\
 8x_1 + 2x_2 + x_3 - 2x_4 &= 7
 \end{aligned} \tag{7}$$

Pierwszy krok eliminacji. W pierwszym kroku eliminacji Gaussa eliminujemy niewiadomą x_1 z drugiego, trzeciego i z czwartego równania układu (7). Żeby wyeliminować niewiadomą x_1 z drugiego równania układu (7), mnożymy pierwsze równanie przez współczynnik

$$m_{21} = \frac{a_{21}}{a_{11}} = \frac{4}{2} = 2$$

i dejmujemy stronami od drugiego równania.

W ten sposób otrzymamy drugie zredukowane równanie

$$-5x_2 - 7x_3 + 4x_4 = -15.$$

Żeby wyeliminować niewiadomą x_1 z trzeciego równania, mnożymy pierwsze równanie przez współczynnik

$$m_{31} = \frac{a_{31}}{a_{11}} = \frac{6}{2} = 3$$

³Metoda starożytnych polega na podstawieniu rozwiązania do oryginalnego układu równań, nie zależnie od sposobu rozwiązania.

i odejmujemy stronami równania.

W ten sposób otrzymamy trzecie zredukowane równanie

$$x_2 - 15x_3 + 8x_4 = -11.$$

Żeby wyeliminować niewiadomą x_1 z czwartego równania, mnożymy pierwsze równanie przez współczynnik

$$m_{41} = \frac{a_{41}}{a_{11}} = \frac{8}{2} = 4$$

i odejmujemy stronami równania.

W ten sposób otrzymamy czwarte zredukowane równanie

$$-2x_2 - 15x_3 + 10x_4 = -9.$$

Po wykonaniu pierwszego kroku eliminacji niewiadomej x_1 otrzymamy

Pierwszy zredukowany układ równań liniowych

$$\begin{array}{rcccc} 2x_1 & +x_2 & +4x_3 & -3x_4 & = & 4 \\ -5x_2 & -7x_3 & +4x_4 & & = & -15 \\ & x_2 & -15x_3 & +8x_4 & = & -11 \\ -2x_2 & -15x_3 & +10x_4 & & = & -9 \end{array} \quad | \quad m_{32} = -\frac{1}{5} \quad | \quad m_{42} = \frac{2}{5} \quad (8)$$

Drugi krok eliminacji. W drugim kroku eliminacji Gaussa eliminujemy niewiadomą x_2 z równania trzeciego i z równania czwartego układu (8).

Żeby wyeliminować niewiadomą x_2 z trzeciego równania, mnożymy drugie równanie w zredukowanym układzie równań (8) przez współczynnik

$$m_{32} = \frac{a_{32}^{(1)}}{a_{22}^{(1)}} = \frac{1}{-5}$$

i odejmujemy od równania trzeciego.

W ten sposób otrzymamy zredukowane równanie trzecie

$$-\frac{82}{5}x_3 + \frac{44}{5}x_4 = -14.$$

Żeby wyeliminować niewiadomą x_2 z czwartego równania, mnożymy drugie równanie w zredukowanym układzie równań (8) przez współczynnik

$$m_{42} = \frac{a_{42}^{(1)}}{a_{22}^{(1)}} = \frac{-2}{-5}$$

i odejmujemy od równania czwartego.

W ten sposób otrzymamy zredukowane równanie czwarte

$$-\frac{61}{5}x_3 + \frac{42}{5}x_4 = -3.$$

Po wykonaniu drugiego kroku eliminacji otrzymamy następujący zredukowany układ równań liniowych

$$\begin{array}{rcl}
 2x_1 + x_2 + 4x_3 - 3x_4 & = & 4 \\
 -5x_2 - 7x_3 + 4x_4 & = & -15 \\
 -\frac{82}{5}x_3 + \frac{44}{5}x_4 & = & -14 \quad | \quad m_{43} = \frac{61}{82} \\
 -\frac{61}{5}x_3 + \frac{42}{5}x_4 & = & -3
 \end{array} \quad (9)$$

Trzeci krok eliminacji. W trzecim kroku eliminacji eliminujemy niewiadomą x_3 z czwartego równania.

Żeby wyeliminować niewiadomą x_3 z czwartego równania, mnożymy trzecie równanie przez współczynnik

$$m_{43} = \frac{a_{43}^{(2)}}{a_{33}^{(2)}} = \frac{61}{82}$$

i dejmujemy stronami od czwartego równania.

W ten sposób otrzymamy zredukowane czwarte równanie

$$\frac{76}{41}x_4 = \frac{304}{41}.$$

W rezultacie eliminacji kolejnych niewiadomych x_1 , x_2 i x_3 dojszliśmy do trzeciego zredukowanego układu równań liniowych.

Trzeci układ zredukowany

$$\begin{array}{rcl}
 2x_1 + x_2 + 4x_3 - 3x_4 & = & 4 \\
 -5x_2 - 7x_3 + 4x_4 & = & -15 \\
 -\frac{82}{5}x_3 + \frac{44}{5}x_4 & = & -14 \\
 \frac{76}{41}x_4 & = & \frac{304}{41}
 \end{array} \quad (10)$$

Zauważmy, że trzeci zredukowany układ równań liniowych ma postać trójkątną górną i jego rozwiązanie łatwo znajdujemy przez podstawienie zaczynając od końca.

Istotnie, z czwartego równania znajdujemy

$$x_4 = \frac{\frac{304}{41}}{\frac{76}{41}} = 4,$$

z trzeciego równania znajdujemy

$$x_3 = -\frac{5}{82}\left(-14 - \frac{44}{5}4\right) = 3,$$

lub w formie wektorowej

$$A\vec{x} = \vec{a},$$

gdzie wektor niewiadomych \vec{x} i wektor danych prawych stron \vec{a} :

$$\vec{x} = \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ \vdots \\ x_n \end{bmatrix}, \quad a = \begin{bmatrix} a_{1n+1} \\ a_{2n+1} \\ a_{3n+1} \\ \vdots \\ a_{nn+1} \end{bmatrix}$$

oraz macierz:

$$A = \begin{bmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} & \cdots & a_{1n-1} & a_{1n} \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} & \cdots & a_{2n-1} & a_{2n} \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} & \cdots & a_{3n-1} & a_{3n} \\ \cdots & \cdots & \cdots & \cdots & \cdots & \cdots \\ a_{n1} & a_{n2} & a_{n3} & \cdots & a_{nn-1} & a_{nn} \end{bmatrix}$$

Zakładamy, że macierz A jest nieosobliwa, to znaczy jej wyróżnik $\Delta \neq 0$ jest różny od zera. Wtedy układ równań liniowych (11) ma dokładnie jedno rozwiązanie.

Teraz podamy ogólny schemat rozwiązania układu równań liniowych (11)

Pierwszy krok eliminacji. W pierwszym kroku eliminacji eliminujemy niewiadomą x_1 z drugiego, trzeciego, i z \dots , n -th równania, jeżeli $a_{11} \neq 0$.

Żeby wyeliminować niewiadomą x_1 z drugiego równania, trzeciego itd..., aż do równania n -tego mnożymy pierwsze równanie w układzie (11) przez współczynnik

$$m_{i1} = \frac{a_{i1}}{a_{11}}, \quad i = 2, 3, \dots, n$$

i odejmujemy stronami pierwsze równanie od drugiego, trzeciego i od i -tego równania dla $i = 2, 3, \dots, n$.

W ten sposób dojdziemy do pierwszego zredukowanego układu równań

Pierwszy zredukowany układ równań

$$\begin{aligned} a_{11}^{(0)} x_1 + a_{12}^{(0)} x_2 + a_{13}^{(0)} x_3 + \cdots + a_{1n}^{(0)} x_n &= a_{1n+1}^{(0)} \\ a_{22}^{(1)} x_2 + a_{23}^{(1)} x_3 + \cdots + a_{2n}^{(1)} x_n &= a_{2n+1}^{(1)} \\ a_{32}^{(1)} x_2 + a_{33}^{(1)} x_3 + \cdots + a_{3n}^{(1)} x_n &= a_{3n+1}^{(1)} \\ \dots & \\ a_{n2}^{(1)} x_2 + a_{n3}^{(1)} x_3 + \cdots + a_{nn}^{(1)} x_n &= a_{nn+1}^{(1)} \end{aligned} \tag{12}$$

gdzie

$$a_{ik}^{(0)} = a_{ik}, \quad i = 1, 2, \dots, n, \quad k = 1, 2, \dots, n+1,$$

$$a_{ik}^{(1)} = a_{ik}^{(0)} - m_{i1}a_{1k}^{(0)}, \quad i = 2, 3, \dots, n; \quad k = 2, 3, \dots, n+1.$$

Drugi zredukowany układ równań

Drugi krok eliminacji. W drugim kroku eliminacji eliminujemy niewiadomą x_2 z trzeciego, i z \dots , n -th równania, jeżeli $a_{22}^{(1)} \neq 0$.

Żeby wyeliminować niewiadomą x_1 z trzeciego, czwartego równania, itd..., aż do równania n -tego mnożymy drugie w układzie (12) przez współczynnik

$$m_{i2} = \frac{a_{i2}^{(1)}}{a_{22}^{(1)}}, \quad i = 3, 4, \dots, n$$

i odejmujemy stronami drugie równanie od trzeciego i od i -tego równania dla $i = 3, 4, \dots, n$.

W ten sposób dojdziemy do drugiego zredukowanego układu równań liniowych

Drugi zredukowany układ równań

$$\begin{aligned} a_{11}^{(0)}x_1 + a_{12}^{(0)}x_2 + a_{13}^{(0)}x_3 + \dots + a_{1n}^{(0)}x_n &= a_{1n+1}^{(0)} \\ a_{22}^{(1)}x_2 + a_{23}^{(1)}x_3 + \dots + a_{2n}^{(1)}x_n &= a_{2n+1}^{(1)} \\ a_{33}^{(2)}x_3 + \dots + a_{3n}^{(2)}x_n &= a_{3n+1}^{(2)} \\ a_{43}^{(2)}x_3 + \dots + a_{4n}^{(2)}x_n &= a_{4n+1}^{(2)} \\ \dots & \\ a_{n3}^{(2)}x_3 + \dots + a_{nn}^{(2)}x_n &= a_{nn+1}^{(2)} \end{aligned} \tag{13}$$

gdzie

$$a_{ik}^{(2)} = a_{ik}^{(1)} - m_{i2}a_{2k}^{(1)}, \quad i = 3, 4, \dots, n, \quad k = 3, 4, \dots, n+1.$$

Kontynuujemy eliminacje kolejnych niewiadomych x_3, x_4, \dots, x_{n-1} , jeżeli współczynniki that $a_{33}^{(2)} \neq 0, a_{44}^{(3)} \neq 0, a_{55}^{(4)} \neq 0, \dots, a_{n-1, n-1}^{(n-2)} \neq 0$.

W ostatnim kroku eliminacji dojdziemy do ostatniego układu równań liniowych

Ostatni zredukowany układ eliminacji Gaussa

$$\begin{aligned} a_{11}^{(0)}x_1 + a_{12}^{(0)}x_2 + a_{13}^{(0)}x_3 + \dots + a_{1n}^{(0)}x_n &= a_{1n+1}^{(0)} \\ a_{22}^{(1)}x_2 + a_{23}^{(1)}x_3 + \dots + a_{2n}^{(1)}x_n &= a_{2n+1}^{(1)} \\ a_{33}^{(2)}x_3 + \dots + a_{3n}^{(2)}x_n &= a_{3n+1}^{(2)} \\ \dots & \\ a_{nn}^{(n-1)}x_n &= a_{nn+1}^{(n-1)} \end{aligned} \tag{14}$$

gdzie

$$a_{ik}^{(s)} = a_{ik}^{(s-1)} - m_{is}a_{sk}^{(s-1)}, \quad m_{is} = \frac{a_{is}^{(s-1)}}{a_{ss}^{(s-1)}}.$$

$$s = 1, 2, \dots, n-1, \quad i = s+1, s+2, \dots, n, \quad k = s+1, s+2, \dots, n+1.$$

Zauważmy, że ostatni zredukowany układ równań liniowych (??) ma postać trójkątną górną i jego rozwiązanie łatwo znajdujemy przez podstawienie zaczynając od końca.

$$\begin{aligned} x_n &= \frac{a_{nn+1}^{(n-1)}}{a_{nn}^{(n-1)}} \\ x_i &= \frac{1}{a_{ii}^{(i-1)}} \left[a_{in+1}^{(i-1)} - \sum_{j=i+1}^n a_{ij}^{(i-1)} x_j \right], \end{aligned} \quad (15)$$

dla $i = n-1, n-2, \dots, 1$.

W systemie *Mathematica* rozwiązanie układu równań liniowych dostaniemy wykonując jedną instrukcję

`LinearSolve[A,b]`

gdzie dana macierz

$$A = \begin{bmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} & \cdots & a_{1n-1} & a_{1n} \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} & \cdots & a_{2n-1} & a_{2n} \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} & \cdots & a_{3n-1} & a_{3n} \\ \cdots & \cdots & \cdots & \cdots & \cdots & \cdots \\ a_{n1} & a_{n2} & a_{n3} & \cdots & a_{nn-1} & a_{nn} \end{bmatrix}_{(n \times n)}$$

i dana kolumna prawych stron

$$b = \begin{bmatrix} a_{1n+1} \\ a_{2n+1} \\ a_{3n+1} \\ \cdots \\ a_{nn+1} \end{bmatrix}$$

Na przykład, przy aktywnym systemie *Mathematica*, wprowadzamy macierz A wymiarów 4×4 jako listę w nawiasach klamrowych jak niżej

`n=4;`

`A={{2,1,4,-3,4},{4,-3,1,-2,-7},`
`{6,4,-3,-1,1},{8,2,1,-2,7}};`

oraz wektor prawych stron

`b={4,-7,1,7}`

Następnie wykonujemy *Mathematica* instrukcję

`LinearSolve[A, b]`

W rezultacie otrzymamy rozwiązanie w formie listy

`{1, 2, 3, 4}`

Zadanie 0.1 *Rozwiąż układ czterech równań liniowych z czterema niewiadomymi x_1, x_2, x_3 i x_4*

$$\begin{aligned} 2x_1 + 3x_2 + 3x_3 + 5x_4 &= 35 \\ 6x_1 - 5x_2 + 4x_3 - 2x_4 &= 22 \\ 8x_1 - 7x_2 + 5x_3 - 4x_4 &= 26 \\ 9x_1 - 3x_2 - 2x_3 - 4x_4 &= 34 \end{aligned} \tag{16}$$

Sprawdź rozwiązanie metodą starożytnych.

Prof. dr Tadeusz STYŠ

Warszawa, listopad 3, 2018