

УДК 519.615.5

О. В. Белякова

**ВАРИАНТ МНОГОСЕТОЧНОГО МЕТОДА
С ПОЛУУКРУПНЕНИЕМ**

Для решения систем линейных уравнений с блочно-трехдиагональной матрицей предложен вариант многосеточного метода с полукрупнением. Представлены результаты численных экспериментов, исследующих эффективность предложенного алгоритма.

Вестник Балтийского федерального университета им. И. Канта. 2011. Вып. 10. С. 102 – 109.



For solving systems of linear equations with block tridiagonal matrices there is presenting a variant of multi-grid method with semi-coarse. There are giving the results of numerical experiments, that show high efficiency of presented method.

Ключевые слова: многосеточный метод, сетки с полукрупнением, системы линейных уравнений, блочно-трехдиагональные матрицы.

Key words: multi-grid method, semi-coarse grids, systems of linear equation, block tridiagonal matrices.

Введение

При численном решении краевых задач для эллиптических уравнений методом сеток или Галёркина решаются системы линейных алгебраических уравнений с блочно-трехдиагональной матрицей

$$\mathbf{A}\mathbf{u} = \mathbf{f}, \quad (1)$$

$$\mathbf{A} = \text{blocktridiag}(\mathbf{L}_i, \mathbf{D}_i, \mathbf{R}_i), \mathbf{L}_i, \mathbf{D}_i, \mathbf{R}_i \in \mathfrak{R}^{m \times m}, i = 1, \dots, n. \quad (2)$$

Одним из эффективных итерационных методов решения задачи (1–2) является многосеточный метод (MGM, MultiGrid Method). Главное его преимущество — независимая от числа узлов сетки скорость сходимости, что обеспечивает получение решения системы за время, пропорциональное числу неизвестных.

Основная идея MGM состоит в уменьшении низкочастотной части невязки с помощью решения вспомогательных систем, соответствующих грубым сеткам. Для этого вводится последовательность сеток с убывающим количеством узлов, с каждой из которых связана своя система. В большинстве работ [1–4] для построения матриц вспомогательных систем используется метод Галеркина, в двумерном случае при этом число узлов на каждой более крупной сетке уменьшается примерно в четыре раза, а в качестве сглаживающих итераций применяются простые итерации или вариант блочного метода Гаусса — Зейделя с чередованием по строкам (black-red).

В работе [5] для численного решения задачи Дирихле для двумерного уравнения диффузии методом сеток был предложен и исследован вариант MGM с полукрупнением сетки MGM_{SC} (SC — semi-coarse grids). В нем для решения каждой системы уравнений, соответствующей сетке с параметрами (h_x, h_y) , используется система уравнений, соответствующая сетке с параметрами $(2h_x, h_y)$, так что количество неизвестных во вспомогательной системе уменьшается в два раза, MGM_{SC}^x . Такой способ уменьшения неизвестных позволил эффективно применить в качестве сглаживающих итераций блочный метод Гаусса — Зейделя с шахматным (черно-белым) упорядочением (zebra-line), рассмотреть дополнительные варианты построения вспомогательных матриц, в том числе вариант [6], основанный на исключении отдельных строк системы, подобно исключению в известном методе четно-нечетной редукции [7].



Для численного решения системы (1–2) с симметричной положительно определенной матрицей предлагается вариант многосеточного метода с полукрупнением $\text{MGM}_{\text{SC}}^{\text{xy}}$, использующий композицию $\text{MGM}_{\text{SC}}^{\text{x}}$ и $\text{MGM}_{\text{SC}}^{\text{y}}$, исследуется его эффективность на численных примерах при различных способах построения матриц вспомогательных систем. Предложенный метод достаточно просто реализуется и во многих случаях имеет явное преимущество по сравнению с $\text{MGM}_{\text{SC}}^{\text{x}}$.

1. Описание варианта многосеточного метода с полукрупнением прямоугольной сетки

104

Пусть решается система (1), в которой

$$\mathbf{A} = \text{blocktridiag}(\mathbf{L}_{i-1}, \mathbf{D}_i, \mathbf{L}_i), \mathbf{D}_i, \mathbf{L}_i \in \mathfrak{R}^{n_x \times n_x}, \mathbf{A} \in \mathfrak{R}^{n_x \cdot n_y \times n_x \cdot n_y}, \mathbf{A} > 0. \quad (3)$$

Векторы \mathbf{u} и \mathbf{f} – блочные вектор-столбцы из пространства $\mathfrak{R}^{n_x \cdot n_y}$:

$$\mathbf{f} = (\mathbf{F}_1, \mathbf{F}_2, \dots, \mathbf{F}_{n_x})^T, \mathbf{u} = (\mathbf{U}_1, \mathbf{U}_2, \dots, \mathbf{U}_{n_x})^T, \mathbf{F}_i, \mathbf{U}_i \in \mathfrak{R}^{n_y}, i = 1, \dots, n_x.$$

Одна итерация предлагаемого варианта многосеточного метода $\text{MGM}_{\text{SC}}^{\text{xy}}$ состоит в следующем. Для решения (1 и 3) применим $\text{MGM}_{\text{SC}}^{\text{x}}$, использующий последовательность систем $\mathbf{A}_{l_x} \mathbf{u}_{l_x} = \mathbf{f}_{l_x}, l_x = 1, \dots, k_x$, в каждой из которых количество блоков $\mathbf{U}_i \in \mathfrak{R}^{n_y}, i = 1, \dots, n_x^{l_x}$ неизвестного вектора \mathbf{u}_{l_x} уменьшается, но размерность каждого \mathbf{U}_i остается неизменной. Затем каждую из этих систем будем решать аналогично, применяя $\text{MGM}_{\text{SC}}^{\text{y}}$: $\mathbf{A}_{l_x}^{(l_y)} \mathbf{u}_{l_x}^{(l_y)} = \mathbf{f}_{l_x}^{(l_y)}, l_y = 1, \dots, k_y$. Теперь в каждой системе количество блоков неизвестного вектора остается без изменения, но размерность блоков меняется. В результате получаются $(k_x - 1) \cdot (k_y - 1)$ вспомогательных систем, каждая из которых определяется из предыдущей вычеркиванием нечетных столбцов или нечетных строк.

Матрицы \mathbf{A}_l вспомогательных систем строятся рекуррентно. При $l = 1$ \mathbf{A}_l совпадает с матрицей заданной системы. Матрица \mathbf{A}_{l+1} строится по выбранному правилу, например методом Галёркина: $\mathbf{A}_{l+1} = \mathbf{r}_l^x \mathbf{A}_l \mathbf{p}_l^x$, где \mathbf{p}_l^x – оператор продолжения в пространстве \mathfrak{R}^{n_x} , который соответствует шаблону $p = \begin{bmatrix} 1 & & \\ & 1 & \\ & & 1 \end{bmatrix}$, $\mathbf{r}_l^x = (\mathbf{p}_l^x)^T$ – оператор сужения. Получается матрица исходной структуры: $\mathbf{A}_{l+1} = \text{blocktridiag}(\mathbf{L}_{i-1}^{(l+1)}, \mathbf{D}_i^{(l+1)}, \mathbf{L}_i^{(l+1)})$.

Такая же структура будет и у \mathbf{A}_{l+1} , если она строится следующими методами:

- исключением строк [6]: $\mathbf{A}_{l+1} = \text{reduce}(\mathbf{A}_l)$;
- модифицированным методом Галёркина [5]: $\mathbf{A}_{l+1} = \mathbf{r}_l^x \mathbf{A}_l \mathbf{p}_l^x + \mathbf{Q}_{l+1}$, где \mathbf{Q}_{l+1} – некоторая вспомогательная матрица;
- $\mathbf{A}_{l+1} = \text{reduce}(\mathbf{A}_l) + \mathbf{Q}_{l+1}$.

Опишем одну итерацию $\text{MGM}_{\text{SC}}^{\text{x}}$ и $\text{MGM}_{\text{SC}}^{\text{xy}}$ на псевдокоде (табл. 1).



Псевдокоды многосеточных итераций MGM_{SC}^x , MGM_{SC}^{xy}

$MGM_{SC}^x(l_y), l_y = 1$	MGM_{SC}^{xy}
SmoothIter = 1,5; {количество сглаживающих итераций} for $l_x = 1$ to $k_x - 1$ do begin BlockGS_x ($l_x, l_y, SmoothIter$); {сглаживающие итерации Гаусса-Зейделя по строкам} Restriction_x ($l_x + 1, l_y$); {сужение на сетку с номером ($l_x + 1$)} Coarse_f_x (l_x, l_y); {пересчет столбца свободных членов для следующей вспомогательной системы} end; $l_x = k_x$; { k_x – номер самой грубой сетки} SolveInLine_x (l_x, l_y); {решение системы с трех-диагональной матрицей} While $l_x > 1$ do begin Prolongation_x (l_x, l_y); {операция продолжения} $l_x = l_x - 1$; BlockGS_x ($l_x, l_y, SmoothIter$); end	SmoothIter = 1,5; $l_y = 1$; for $l_x = 1$ to $k_x - 1$ do begin BlockGS_x ($l_x, l_y, SmoothIter$); Restriction_x ($l_x + 1, l_y$); Coarse_f_x (l_x, l_y); end; $l_x = k_x$; SolveInLine_x (l_x, l_y); While $l_x > 1$ do begin Prolongation_x (l_x, l_y); $l_x = l_x - 1$; HalfBlockGS_x (l_x, l_y); {половина итерации Гаусса – Зейделя} $MGM_{SC}^y(l_x)$; end

2. Оценка вычислительной сложности алгоритма

Оценим и сравним количество арифметических операций, необходимых для выполнения каждой из итераций MGM_{SC}^x и MGM_{SC}^{xy} . Поскольку элементы матриц вспомогательных систем вычисляются один раз, то не будем включать эти вычисления в общий объем работы. В многосеточной итерации наиболее емкими по количеству арифметических действий являются сглаживающие итерации BlockGS_x, BlockGS_y. Поэтому для оценки вычислительной сложности алгоритма будем учитывать только сглаживающие итерации.

Обозначим через $C^{GS} \cdot n_x \cdot n_y$ количество арифметических операций на выполнение сглаживающей итерации блочным методом Гаусса – Зейделя для приближенного решения системы размером $n_x \cdot n_y$, где C^{GS} – некоторая положительная константа, не зависящая от n_x, n_y . Подсчитаем число арифметических операций, необходимых для выполнения итерации MGM_{SC}^x с 1,5 сглаживающей итерации. При переходе от исходной системы уравнений к системе с наименьшим количеством неизвестных выполняются арифметические действия в количестве:

- $1,5C^{GS} \cdot n_x \cdot n_y$ – для исходной системы ($l_x = 1$ в таблице 1);



- $1,5C^{GS} \cdot \frac{n_x}{2} \cdot n_y$ — для следующей вспомогательной системы ($l_x = 2$);
- ...;
- $1,5C^{GS} \cdot \frac{n_x}{2^{k_x-1}} \cdot n_y$ — для предпоследней вспомогательной системы ($l_x = k_x - 1$) (последняя вспомогательная система — трехдиагональная порядка n_y , которая решается точно методом прогонки).

Всего операций

$$\frac{3}{2} C^{GS} \cdot n_x \cdot n_y \left(1 + \frac{1}{2} + \dots + \frac{1}{2^{k_x-1}}\right) = \frac{2 \cdot 2^{k_x-1} - 1}{2^{k_x-1}} \cdot \frac{3}{2} C^{GS} \cdot n_x \cdot n_y \approx 3 \cdot C^{GS} \cdot n_x \cdot n_y.$$

106

Из таблицы 1 видно, что итерация MGM_{SC}^x реализована по схеме симметричного V-цикла. Поэтому такое же количество сглаживающих итераций затрачивается при обратном переходе: от системы с номером $(k_x - 1)$ к исходной системе с номером 1. Следовательно, общее количество арифметических операций будет примерно $6 \cdot C^{GS} \cdot n_x \cdot n_y$.

Проанализируем теперь MGM_{SC}^{xy} . Как видно из таблицы 1, количество арифметических действий на выполнение сглаживающих итераций при переходе от исходной системы, соответствующей мелкой сетке, к системе, соответствующей крупной сетке, такое же, как в MGM_{SC}^x , $3C^{GS} \cdot n_x \cdot n_y$. При обратном переходе для каждой системы выполняются:

- 1) половина итерации блочного метода Гаусса — Зейделя;
- 2) симметричный V-цикл итерации MGM_{SC}^y , всего

$$\frac{13}{2} C^{GS} \cdot n_x \cdot n_y \left(\frac{1}{2^{k_x-1}} + \frac{1}{2^{k_x-2}} + \dots + 1\right) \approx 13C^{GS} \cdot n_x \cdot n_y$$

арифметических действий. Итак, получим, что на выполнение одной итерации MGM_{SC}^{xy} по схеме симметричного V-цикла необходимо затратить число арифметических действий примерно $16 \cdot C^{GS} \cdot n_x \cdot n_y$.

Если для реализации MGM_{SC}^{xy} -итерации применить схему несимметричного V-цикла, а именно при переходах от системы, соответствующей мелкой сетке, к решению системы, соответствующей крупной, выполнять только половину сглаживающей итерации, то общее число арифметических действий уменьшится так, что получим $10C^{GS} \cdot n_x \cdot n_y$.

3. Численные результаты

Исследуем на численных примерах эффективность вариантов MGM_{SC}^x и MGM_{SC}^{xy} многосеточного метода при различных способах построения матриц вспомогательных систем и схем выполнения V-цикла итерации. Для этого рассмотрим однородную задачу Дирихле в единичном квадрате $D = (0, 1) \times (0, 1)$ для уравнения



$$\frac{\partial}{\partial x} \left(p(x, y) \frac{\partial u}{\partial x} \right) + \frac{\partial}{\partial y} \left(q(x, y) \frac{\partial u}{\partial y} \right) = -f.$$

Применение сеточного метода для численного решения этой задачи приводит к системе (1, 2). Предположим, что $n_x = n_y = n$, обозначим

$$\|\mathbf{r}^{(k)}\| = \sum_{i,j=1}^n |r_{i,j}^{(k)}|, v_k = \|\mathbf{r}^{(k)}\| / \|\mathbf{r}^{(k-1)}\|, \rho = \lim_{k \rightarrow +\infty} v_k,$$

где $\mathbf{r}^{(k)}$ – невязка после k -й многосеточной итерации. Значение скорости сходимости ρ вычислялось в момент, когда первоначальная невязка уменьшилась не менее чем в 10^{10} раз; v_k^1, v_k^2 – значения скоростей сходимости итераций MGM_{SC}^x и $\text{MGM}_{\text{SC}}^{xy}$ соответственно.

Таблица 2

Скорость сходимости и количество итераций $\text{MGM}_{\text{SC}}^x, \text{MGM}_{\text{SC}}^{xy}$ по схеме симметричного V-цикла в зависимости от коэффициентов системы и мелкости сетки при условии $A_{l+1} = \text{reduce}(A_l) + Q_{l+1}$

$p(x, y) = q(x, y)$	n	99	256	512	777
1. $p(x, y) = 1$	$v_k^1(k)$	0,05096(8)	0,05309(8)	0,05355(8)	0,05310(8)
	$v_k^2(k)$	0,00071(3)	0,00067(3)	0,00062(3)	0,00060(3)
2. $p(x, y) = 1 - e^{-x \cdot y}$	$v_k^1(k)$	0,05240(8)	0,05376(8)	0,05409(8)	0,05405(8)
	$v_k^2(k)$	0,00090(3)	0,00082(3)	0,00078(3)	0,00076(3)
3. $p(x, y) = 1 + 0,8 \sin(14\pi x) \sin(14\pi y)$	$v_k^1(k)$	0,07810(10)	0,08124(10)	0,08181(10)	0,08283(10)
	$v_k^2(k)$	0,00184(4)	0,00139(4)	0,00070(3)	0,00046(3)

Видно, что для монотонных коэффициентов в уравнении $\text{MGM}_{\text{SC}}^{xy}$ -метод малоэффективен по сравнению с MGM_{SC}^x , так как для уменьшения первоначальной невязки в 10^{10} раз требуется примерно одинаковое число действий – $48Cn^2$. Строка 3 показывает, что $\text{MGM}_{\text{SC}}^{xy}$ может иметь некоторое преимущество при решении задач с быстро изменяющимися коэффициентами со значительной амплитудой колебаний. Если итерация $\text{MGM}_{\text{SC}}^{xy}$ реализуется по схеме несимметричного V-цикла, то для уменьшения первоначальной невязки в 10^{10} раз требуется примерно $40Cn^2$ действий против $48Cn^2$ MGM_{SC}^x -методом. Следовательно, этот вариант $\text{MGM}_{\text{SC}}^{xy}$ -итерации более эффективен по сравнению с MGM_{SC}^x .

Здесь и далее через k^1, k^2 обозначено количество многосеточных итераций $\text{MGM}_{\text{SC}}^x, \text{MGM}_{\text{SC}}^{xy}$ соответственно. Из таблицы 3 видно, что в большинстве случаев есть явное преимущество $\text{MGM}_{\text{SC}}^{xy}$ -метода, особенно выразительно оно в случае 2: для уменьшения первоначальной невязки в 10^{10} раз требуется примерно $50Cn^2$ арифметических действий против $72Cn^2$ MGM_{SC}^x -методом.



Таблица 3

Количество итераций MGM_{SC}^x , $\text{MGM}_{\text{SC}}^{xy}$ по схеме несимметричного V-цикла в зависимости от коэффициентов системы и мелкости сетки при условии $A_{l+1} = \text{reduce}(A_l) + Q_{l+1}$

$p(x, y), q(x, y)$	n	99	256	512	777
1. $p(x, y) = 1 - e^{-x \cdot y}$ $q(x, y) = 1 + 0,8 \sin(14\pi x) \sin(14\pi y)$	k^1	11	11	11	11
	k^2	7	6	5	5
2. $q(x, y) = 1 - e^{-x \cdot y}$ $p(x, y) = 1 + 0,8 \sin(14\pi x) \sin(14\pi y)$	k^1	12	13	13	13
	k^2	5	5	5	4

108

Из таблицы 4 видно, что при указанном способе построения матриц вспомогательных систем, более экономичном по сравнению с предыдущим способом, также имеются преимущества $\text{MGM}_{\text{SC}}^{xy}$ по сравнению с MGM_{SC}^x . В большинстве приведенных примеров количество арифметических операций для уменьшения невязки в 10^{10} раз $\text{MGM}_{\text{SC}}^{xy}$ -методом примерно в 1,5 раза меньше по сравнению с MGM_{SC}^x -методом.

Таблица 4

Количество итераций MGM_{SC}^x , $\text{MGM}_{\text{SC}}^{xy}$ по схеме несимметричного V-цикла в зависимости от коэффициентов системы и мелкости сетки при условии $A_{l+1} = \text{reduce}(A_l)$

$p(x, y), q(x, y)$	n	99	256	512	777
1. $p(x, y) = q(x, y) = 1$	k^1	7	8	8	8
	k^2	3	3	3	3
2. $p(x, y) = q(x, y) = 1 - e^{-x \cdot y}$	k^1	8	8	8	8
	k^2	3	3	3	3
3. $p(x, y) = q(x, y) = 1 + 0,8 \sin(14\pi x) \sin(14\pi y)$	k^1	9	9	9	10
	k^2	5	4	4	4
4. $p(x, y) = 1 - e^{-x \cdot y}$ $q(x, y) = 1 + 0,8 \sin(14\pi x) \sin(14\pi y)$	k^1	10	10	10	10
	k^2	6	5	4	4
5. $q(x, y) = 1 - e^{-x \cdot y}$ $p(x, y) = 1 + 0,8 \sin(14\pi x) \sin(14\pi y)$	k^1	12	13	13	13
	k^2	4	4	4	4

Из таблицы 5 видно, что $\text{MGM}_{\text{SC}}^{xy}$ -метод имеет явное преимущество по сравнению с MGM_{SC}^x -методом.



Скорость сходимости и количество итераций MGM_{SC}^x , MGM_{SC}^{xy} по схеме несимметричного V-цикла в зависимости от коэффициентов системы и мелкости сетки при условии $A_{i+1} = r_i A_i p_i$

$p(x, y), q(x, y)$	n	128	256	512
1. $p(x, y) = q(x, y) = 1$	$v_k^1(k)$	0,04958(8)	0,05043(8)	0,05087(8)
	$v_k^2(k)$	0,00132(3)	0,00133(3)	0,00133(3)
2. $p(x, y) = q(x, y) = 1 - e^{-x \cdot y}$	$v_k^1(k)$	0,26339(17)	0,32641(20)	0,38538(23)
	$v_k^2(k)$	0,01661(6)	0,01807(6)	0,01916(6)
3. $p(x, y) = q(x, y) = 1 + 0,8 \sin(14\pi x) \sin(14\pi y)$	$v_k^1(k)$	0,08387(10)	0,08563(10)	0,08607(10)
	$v_k^2(k)$	0,00419(5)	0,00248(4)	0,00178(4)
4. $p(x, y) = 1 - e^{-x \cdot y}$ $q(x, y) = 1 + 0,8 \sin(14\pi x) \sin(14\pi y)$	$v_k^1(k)$	0,11729(11)	0,12396(11)	0,15306(12)
	$v_k^2(k)$	0,03480(6)	0,01486(5)	0,01060(5)
5. $q(x, y) = 1 - e^{-x \cdot y}$ $p(x, y) = 1 + 0,8 \sin(14\pi x) \sin(14\pi y)$	$v_k^1(k)$	0,16512(13)	0,16941(13)	0,17058(13)
	$v_k^2(k)$	0,00250(4)	0,00204(4)	0,00180(4)

Список литературы

1. Mandel J., McCormick S., Ruge J. An algebraic theory for the multi-grid method including V-cycle // SIAM J. Numer. Anal. 1983. Vol. 20.
2. Hackbusch W. Multi-grid method and applications. Springer, 1985.
3. Maitre J.-F., Musy F. Multigrid methods for symmetric variational problems: a general theory and convergence estimates for usual smoothers // Appl. Math. and Comp. 1987. Vol. 21.
4. Ольшанский М. А. Лекции и упражнения по многосеточным методам. М., 2005.
5. Белякова О. В., Буздин А. А. Многосеточный метод с полукрупнением для решения систем с блочной трехдиагональной матрицей // Методы вычислений. 2005. №21. С. 5–19.
6. Буздин А. А., Дедух С. С. Вариант многосеточного метода с полукрупнением сетки // Вестник Российского государственного университета им. И. Канта. Калининград, 2009. Вып. 10. С. 74–81.
7. Самарский А. А., Николаев Е. С. Методы решения сеточных уравнений. М., 1978.

Об авторе

Ольга Владиславовна Белякова – канд. физ.-мат. наук, доц., Балтийский федеральный университет им. И. Канта, e-mail: obelyakova@ya.ru.

Author

Dr Olga Belyakova – assistant professor, I. Kant Baltic Federal University, e-mail: obelyakova@ya.ru.