

doi:10.3969/j.issn.1673-9833.2014.04.002

特殊拟 α - 双对角占优矩阵的讨论及其应用

贾明辉

(内蒙古民族大学 数学学院, 内蒙古 通辽 028043)

摘要: 定义了特殊拟 α -双对角占优矩阵, 给出了严格特殊拟 α -双对角占优矩阵的等价表征。由此得到非奇异 H -矩阵的判定条件, 并用数值例子说明了判定条件的有效性。

关键词: 非奇异 H -矩阵; α -双对角占优矩阵; 特殊拟 α -双对角占优矩阵

中图分类号: O151.21

文献标志码: A

文章编号: 1673-9833(2014)04-0008-04

Discussion on Special Quasi α -Double Diagonally Dominant Matrix and Its Applications

Jia Minghui

(School of Mathematics, Inner Mongolia University for the Nationalities, Tongliao Inner Mongolia 028043, China)

Abstract: The special α -double diagonally dominant matrix is defined, and an equivalent representation for strictly special quasi α -double diagonally dominant matrix is presented. And the judgment condition for nonsingular H -matrices is obtained. The efficiency of the judgment condition is illustrated with a numerical example.

Keywords: nonsingular H -matrix; α -double diagonally dominant matrix; special quasi α -double diagonally dominant matrix

0 引言

非奇异 H -矩阵是计算数学、数学物理、控制理论、电力系统理论、经济数学等领域中具有广泛应用的重要矩阵类。在实际应用中, 如何简便地判别一个矩阵是否非奇异 H -矩阵, 一直是学者们关注的热点问题。众所周知, 对角占优矩阵、双对角占优矩阵、按回路对角占优矩阵、 α -对角占优矩阵、 α -双对角占优矩阵、按回路 α -对角占优矩阵以及相应的不可约及非零元链形式等均为非奇异 H -矩阵。

近年来国内外学者做了不少工作, 提出了一些实用的判定非奇异 H -矩阵的条件^[1-12]。本文将定义

特殊拟 α -双对角占优矩阵, 给出严格特殊拟 α -双对角占优矩阵的等价表征, 由此得到非奇异 H -矩阵的判定条件, 从而推广了文献[1-12]中的定理2, 并用数值例子说明判定条件的有效性。

1 预备知识

设 $A = (a_{ij}) \in \mathbf{C}^{n \times n}$ 为 n 阶复方阵, 记

$$R_i(A) = \sum_{j \neq i}^n |a_{ij}|, C_i(A) = \sum_{j \neq i}^n |a_{ji}|;$$

$$P_i(A) = \sum_{k \in N \setminus \{i\}} |a_{ik}| \frac{R_k(A)}{|a_{kk}|}, Q_i(A) = \sum_{k \in N \setminus \{i\}} |a_{ki}| \frac{R_i(A)}{|a_{ii}|};$$

收稿日期: 2014-05-23

基金项目: 内蒙古民族大学科学研究基金资助项目(NMD1303)

作者简介: 贾明辉(1977-), 女, 内蒙古通辽人, 内蒙古民族大学副教授, 硕士, 主要研究方向为数值代数,

E-mail: jiaminghui1978@163.com

$N \triangleq \{1, 2, \dots, n\}$, $M \triangleq \{(i, j) | i \neq j, i \in N, j \in N\}$ 。

若 $|a_{ii}| \geq (>) R_i(A) (i \in N)$, 则称 A 为 (严格) 对角占优矩阵, 记为 $A \in D_0 (A \in D)$; 若 $|a_{ii} a_{jj}| \geq (>) R_i(A) R_j(A) (\forall (i, j) \in M)$, 则称 A 为 (严格) 双对角占优矩阵, 记为 $A \in DD_0 (A \in DD)$; 若存在一正对角阵 $X = \text{diag}(x_1, x_2, \dots, x_n)$, 使 $AX \in D$, 则称 A 为广义严格对角占优矩阵, 记为 $A \in \tilde{D}^{[2-3]}$ 。

众所周知, H -矩阵也可等价地定义为广义严格对角占优矩阵。因为非奇异 H -矩阵主对角元素非零, 所以本文总假定所涉及矩阵主对角元素 $a_{ii} \neq 0$ 且 $R_i(A) > 0 (\forall i \in N)$ 。

定义 1 设 $A = (a_{ij}) \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 若存在某一参数 $\alpha \in [0, 1] (\alpha_0 \in [0, 1])$, 使

$|a_{ii} a_{jj}| \geq (>) [R_i(A) R_j(A)]^\alpha [C_i(A) C_j(A)]^{1-\alpha} (\forall (i, j) \in M)$, 则称 A 为 (严格) α -双对角占优矩阵, 记为 $A \in DD(\alpha_0) (A \in DD(\alpha))$;

若存在一正对角阵 $X = \text{diag}(x_1, x_2, \dots, x_n)$, 使

$$AX \in D\tilde{D}(\alpha),$$

则称 A 为广义 α -双对角占优矩阵, 记为 $A \in DD\tilde{D}(\alpha)$ 。

定义 2 设 $A = (a_{ij}) \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 若

$$R_i(A) > P_i(A) (\forall i \in N),$$

则称 A 为特殊拟对角占优矩阵, 记为 $A \in S\tilde{D}$;

若 $R_i(A) R_j(A) > P_i(A) P_j(A) (\forall (i, j) \in M)$,

则称 A 为特殊拟双对角占优矩阵, 记为 $A \in SD\tilde{D}$ 。

定义 3 设 $A = (a_{ij}) \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 若存在某一参数 $\alpha \in [0, 1]$, 使

$R_i(A) R_j(A) > [P_i(A) P_j(A)]^\alpha [Q_i(A) Q_j(A)]^{1-\alpha} (\forall (i, j) \in M)$, 则称 A 为特殊拟 α -双对角占优矩阵, 记为 $A \in SD\tilde{D}(\alpha)$ 。

引理 1^[5-9] 设 $A = (a_{ij}) \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 若 $A \in SD\tilde{D}(\alpha)$, 则 A 为非奇异 H -矩阵。

2 主要结论

引理 2 设 $A = (a_{ij}) \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 若 $A \in SD\tilde{D}(\alpha)$, 则 A 为非奇异 H -矩阵。

证 取正对角阵 $X = \text{diag}(x_1, x_2, \dots, x_n)$, 其中 $x_i = \frac{R_i(A)}{|a_{ii}|} (\forall i \in N)$, 并记 $B = AX = (b_{ij})$, 则对任意 $i \in N$ 有

$$b_{ii} = R_i(A);$$

$$R_i(B) = \sum_{k \in N \setminus \{i\}} |b_{ik}| = \sum_{k \in N \setminus \{i\}} |a_{ik}| \frac{R_k(A)}{|a_{kk}|} = P_i(A);$$

$$C_i(B) = \sum_{k \in N \setminus \{i\}} |b_{ki}| = \sum_{k \in N \setminus \{i\}} |a_{ki}| \frac{R_i(A)}{|a_{ii}|} = Q_i(A)。$$

由 $A \in SD\tilde{D}(\alpha)$ 易知

$$|b_{ii}| |b_{jj}| > [R_i(B) R_j(B)]^\alpha [C_i(B) C_j(B)]^{1-\alpha} (\forall (i, j) \in M)。$$

由定义 1 及引理 1 可知 B 为非奇异 H -矩阵。又由 H -矩阵的等价定义可知, 存在正对角阵 X_1 , 使得 $A(XX_1) = AXX_1 = BXX_1$ 为严格对角占优矩阵。显然 XX_1 仍为正对角矩阵, 故 A 为非奇异 H -矩阵。

注意 当 $\alpha=0 (\alpha=1)$ 时, $A \in SD\tilde{D} (A^T \in SD\tilde{D})$ 均为非奇异 H -矩阵, 所以下文中只对 $\alpha \in (0, 1)$ 进行讨论。记

$$M_1 = \{(i, j) | P_i(A) P_j(A) < R_i(A) R_j(A) < Q_i(A) Q_j(A)\};$$

$$M_2 = \{(i, j) | Q_i(A) Q_j(A) < R_i(A) R_j(A) < P_i(A) P_j(A)\};$$

$$M_3 = \{(i, j) | R_i(A) R_j(A) \geq Q_i(A) Q_j(A) > P_i(A) P_j(A)\};$$

$$M_4 = \{(i, j) | R_i(A) R_j(A) \geq P_i(A) P_j(A) > Q_i(A) Q_j(A)\};$$

$$M_5 = \{(i, j) | R_i(A) R_j(A) > Q_i(A) Q_j(A) = P_i(A) P_j(A)\};$$

$$M_6 = \{(i, j) | P_i(A) P_j(A) \geq R_i(A) R_j(A),$$

$$Q_i(A) Q_j(A) \geq R_i(A) R_j(A)\}。$$

显然有 $M = M_1 \cup M_2 \cup M_3 \cup M_4 \cup M_5 \cup M_6$ 。

$\forall (i, j) \in M_1$ 记

$$\alpha_{ij} = \frac{R_i(A) R_j(A)}{P_i(A) P_j(A)},$$

$$\beta_{ij} = \frac{Q_i(A) Q_j(A)}{R_i(A) R_j(A)},$$

$$\gamma_{ij} = \frac{Q_i(A) Q_j(A)}{P_i(A) P_j(A)},$$

则 $\gamma_{ij} = \alpha_{ij} \beta_{ij}$ 。

$\forall (i, j) \in M_2$ 记

$$x_{ij} = \frac{R_i(A) R_j(A)}{Q_i(A) Q_j(A)},$$

$$y_{ij} = \frac{P_i(A) P_j(A)}{R_i(A) R_j(A)},$$

$$z_{ij} = \frac{P_i(A) P_j(A)}{Q_i(A) Q_j(A)},$$

则 $z_{ij} = x_{ij} y_{ij}$ 。

因此有 $\gamma_{ij} > \alpha_{ij} > 1, \gamma_{ij} > \beta_{ij} > 1, z_{ij} > x_{ij} > 1, z_{ij} > y_{ij} > 1$ 。

定理 1 设 $A = (a_{ij}) \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 且 $M_6 = \Phi$, 如果 M_1, M_2 至少有一个为空集, 则 $A \in SD\tilde{D}(\alpha)$ 。

证 有以下3种情况:

情形1 若 $M_1 \neq \Phi, M_2 = \Phi$, 则对任意的 $(s, t) \in M_1$,

取 $\alpha \in \left(1 - \min_{(s,t) \in M_1} \log_{\gamma_{st}} \alpha_{st}, 1\right) \subset (0, 1)$, 则有

$$R_i(A)R_j(A) > [P_i(A)P_j(A)]^\alpha [Q_i(A)Q_j(A)]^{1-\alpha} \quad (\forall (i, j) \in M)$$

情形2 若 $M_1 = \Phi, M_2 \neq \Phi$, 则对任意的 $(i, j) \in M_2$,

取 $\alpha \in \left(0, 1 - \max_{(i,j) \in M_2} \log_{z_{ij}} y_{ij}\right) \subset (0, 1)$, 则有

$$R_i(A)R_j(A) > [P_i(A)P_j(A)]^\alpha [Q_i(A)Q_j(A)]^{1-\alpha} \quad (\forall (i, j) \in M)$$

情形3 若 $M_1 = M_2 = \Phi$, 则对任意的 $(i, j) \in M_3 \cup M_4 \cup M_5$, 取 $\alpha \in (0, 1)$, 总有

$$R_i(A)R_j(A) > [P_i(A)P_j(A)]^\alpha [Q_i(A)Q_j(A)]^{1-\alpha} \quad (\forall (i, j) \in M)$$

从而根据定义3知 $A \in SD\bar{D}(\alpha)$.

定理2 设 $A = (a_{ij}) \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 且 $M_6 = \Phi$, 如果 M_1, M_2 至少有一个为空集, 则 A 为非奇异 H -矩阵。

证 由定理1和引理2知结论成立。

下面的讨论中总假定 $M_1 \neq \Phi, M_2 \neq \Phi$ 。

定理3 设 $A = (a_{ij}) \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 则 $A \in SD\bar{D}(\alpha)$ 的充分必要条件是 $M_6 = \Phi$, 且

$$\max_{(t,j) \in M_2} \log_{z_{ij}} y_{ij} < \min_{(s,t) \in M_1} \log_{\gamma_{st}} \alpha_{st} \quad (1)$$

证 先证必要性。

由定义3, 显然有 $M_6 = \Phi$, 且存在 $\alpha \in (0, 1)$ 使得

$$R_i(A)R_j(A) > [P_i(A)P_j(A)]^\alpha [Q_i(A)Q_j(A)]^{1-\alpha} \quad (\forall (i, j) \in M)$$

对任意的 $(s, t) \in M_1$, 有

$$\left(\frac{Q_s Q_t}{R_s R_t}\right)^{1-\alpha} < \left(\frac{R_s R_t}{P_s P_t}\right)^\alpha,$$

所以

$$\begin{aligned} \left(\frac{Q_s Q_t}{P_s P_t}\right)^{1-\alpha} &= \left(\frac{Q_s Q_t}{R_s R_t}\right)^{1-\alpha} \left(\frac{R_s R_t}{P_s P_t}\right)^{1-\alpha} < \\ &\left(\frac{R_s R_t}{P_s P_t}\right)^\alpha \left(\frac{R_s R_t}{P_s P_t}\right)^{1-\alpha} = \frac{R_s R_t}{P_s P_t}, \end{aligned}$$

即

$$\gamma_{st}^{1-\alpha} < \alpha_{st} \quad (\forall (s, t) \in M_1)$$

又因为 $\gamma_{st} > 1$, 则

$$-\alpha < \log_{\gamma_{st}} \alpha_{st} \quad (\forall (s, t) \in M_1)$$

对任意的 $(i, j) \in M_2$, 有

$$\left(\frac{R_i R_j}{Q_i Q_j}\right)^{1-\alpha} > \left(\frac{P_i P_j}{R_i R_j}\right)^\alpha,$$

所以

$$\begin{aligned} \left(\frac{P_i P_j}{Q_i Q_j}\right)^{1-\alpha} &= \left(\frac{R_i R_j}{Q_i Q_j}\right)^{1-\alpha} \left(\frac{P_i P_j}{R_i R_j}\right)^{1-\alpha} > \\ &\left(\frac{P_i P_j}{R_i R_j}\right)^\alpha \left(\frac{P_i P_j}{R_i R_j}\right)^{1-\alpha} = \frac{P_i P_j}{R_i R_j}, \end{aligned}$$

$$z_{ij}^{1-\alpha} > y_{ij} \quad (\forall (i, j) \in M_2)$$

又因为 $z_{ij} > 1$, 则

$$1 - \alpha > \log_{z_{ij}} y_{ij} \quad (\forall (i, j) \in M_2)$$

综上所述, 有

$$\log_{z_{ij}} y_{ij} < \log_{\gamma_{st}} \alpha_{st} \quad (\forall (s, t) \in M_1, \forall (i, j) \in M_2)$$

即式(1)成立。

再证充分性。

由式(1)及指标集 M_1, M_2 的取法可知, 必存在常数 α , 满足

$$\begin{aligned} 0 < \log_{z_{ij}} y_{ij} < 1 - \alpha < \log_{\gamma_{st}} \alpha_{st} < 1 \\ (\forall (s, t) \in M_1, \forall (i, j) \in M_2) \end{aligned} \quad (2)$$

由式(2)中的 $\log_{z_{ij}} y_{ij} < 1 - \alpha$, 以及任意的 $(i, j) \in M_2, z_{ij} = x_{ij} y_{ij} > 1$, 得

$$R_i(A)R_j(A) > [P_i(A)P_j(A)]^\alpha [Q_i(A)Q_j(A)]^{1-\alpha}$$

由式(2)中的 $1 - \alpha < \log_{\gamma_{st}} \alpha_{st}$, 以及对任意的 $(s, t) \in M_1, \gamma_{st} = \alpha_{st} \beta_{st} > 1$, 得

$$R_s(A)R_t(A) > [P_s(A)P_t(A)]^\alpha [Q_s(A)Q_t(A)]^{1-\alpha}$$

又对任意的 $(i, j) \in M_3 \cup M_4 \cup M_5$, 及任意的 $\alpha \in (0, 1)$, 则必有

$$R_s(A)R_t(A) > [P_s(A)P_t(A)]^\alpha [Q_s(A)Q_t(A)]^{1-\alpha}$$

综上所述根据定义3知 $A \in SD\bar{D}(\alpha)$ 。

定理4 设 $A = (a_{ij}) \in \mathbb{C}^{n \times n}$, 且 $M_6 = \Phi$, 如果矩阵 A 满足不等式

$$\max_{(t,j) \in M_2} \log_{z_{ij}} y_{ij} < \min_{(s,t) \in M_1} \log_{\gamma_{st}} \alpha_{st},$$

则 A 为非奇异 H -矩阵。

证 由定理3知 $A \in SD\bar{D}(\alpha)$, 再由引理2知 A 为非奇异 H -矩阵。

3 数值算例

例1 设 $A = \begin{bmatrix} 1 & 0.2i & 1.2 \\ 0.1 & 1 & 0.1 \\ 0.7i & 0.3 & i \end{bmatrix}$, 试判断 A 是否为非

奇异 H - 矩阵。

解 由矩阵 A 可得:

$$R_1(A)=1.4, R_2(A)=0.2, R_3(A)=1.$$

令正对角矩阵 $X=\text{diag}(1.4, 0.2, 1)$, 并根据本文的记号有:

$$P_1(A)=1.24, P_2(A)=0.24, P_3(A)=1.04$$

$$Q_1(A)=1.12, Q_2(A)=0.1, Q_3(A)=1.3.$$

显然不满足文献[1-12]中定理 1 和定理 2 的条件, 因此无法判断出 A 是否为非奇异 H - 矩阵。

经计算可得:

$$M_1 = \{(1,3)\}, M_2 = \{(1,2), (2,3)\},$$

$$M_3 = M_4 = M_5 = M_6 = \Phi,$$

$$0.3396 = \max_{(i,j) \in M_2} \log_{z_{ij}} y_{ij} < \min_{(s,t) \in M_1} \log_{\gamma_{st}} \alpha_{st} = 0.6768.$$

由此可知矩阵 A 满足定理 4 的条件, 所以 A 为非奇异 H - 矩阵。

参考文献:

- [1] 黄 政. 非奇异 H - 矩阵的一组充分条件[J]. 吉首大学学报: 自然科学版, 2006, 27(3): 12-14.
Huang Zheng. A Set of Sufficient Conditions for Nonsingular H -Matrices[J]. Journal of Jishou University: Natural Science Edition, 2006, 27(3): 12-14.
- [2] Varga R S. Matrix Iterative Analysis[M]. Englewood Cliffs: Prentice Hall Inc, 1962: 19-170.
- [3] Varga R S. On Recurring Theorems on Diagonal Dominance [J]. Linear Algebra and Its Applications, 1976, 13(1): 1-9.
- [4] Li Bishan, Tsatsomeros M J. Doubly Diagonally Dominant Matrices[J]. Linear Algebra and Its Applications, 1997, 261(1/2/3): 221-235.
- [5] 黄廷祝. Ostrowski 定理的推广与非奇 H 矩阵的条件[J]. 计算数学, 1994, 16(1): 19-24.
Huang Tingzhu. Generalizations of Ostrowski Theorem and Conditions for H -Matrices[J]. Mathematica Numerica Sinica, 1994, 16(1): 19-24.
- [6] Gan Taibin, Huang Tingzhu. Simple Criteria for Nonsingular H -Matrices[J]. Linear Algebra and Its Applications, 2003, 374: 317-326.
- [7] Cvetković Ljiljana, Kostić Vladimir. New Criteria for Identifying H -Matrices[J]. Journal of Computational and Applied Mathematics, 2005, 180(2): 265-278.
- [8] 庾 清, 谢清明, 刘建州. 非奇异 H - 矩阵的实用新判定 [J]. 应用数学学报, 2008, 31(1): 143-151.
Tuo Qing, Xie Qingming, Liu Jianzhou. New Practical Criteria for Nonsingular H -Matrices[J]. Acta Mathematicae Applicatae Sinica, 2008, 31(1): 143-151.
- [9] Bru R, Corral C, Gimenez I, et al. Classes of general H -Matrices[J]. Linear Algebra and Its Applications, 2008, 429(10): 2358-2366.
- [10] 李 敏, 李庆春. 非奇异 H - 矩阵的新判定准则[J]. 工程数学学报, 2012, 29(5): 715-719.
Li Min, Li Qingchun. New Criteria for Nonsingular H -Matrices[J]. Chinese Journal of Engineering Mathematics, 2012: 29(5): 715-719.
- [11] Hadjidimos A. Irreducibility and Extensions of Ostrowski's Theorem[J]. Linear Algebra and Its Applications, 2012, 436(7): 2156-2168.
- [12] Hadjidimos A. A Note on Ostrowski's Theorem[J]. Linear Algebra and Its Applications, 2013, 439(12): 3785-3795.

(责任编辑: 邓光辉)

