

# Nekrasov 矩阵的逆矩阵无穷范数的新上界\*

李艳艳

(文山学院 数学学院, 云南 文山 663009)

**摘要:**【目的】Nekrasov 矩阵是 H-矩阵的子类,同时它包含了严格对角占优矩阵。针对 Nekrasov 矩阵的逆矩阵,给出它的无穷范数的上界估计。【方法】先对矩阵  $A$  进行分裂( $A=D-L-U$ ),然后构造严格对角占优矩阵  $C(C=E-(|D|-|L|)^{-1}|U|)$ ,再通过利用 Nekrasov 矩阵的定义、相关的引理,以及不等式的放缩等手段来估计  $\|A^{-1}\|_{\infty}$  的上界。【结果】得到了  $\|A^{-1}\|_{\infty}$  上界的两个较好的结果。【结论】理论证明和数值算例都说明,一定情况下,得到的结果优于现有的结果。

**关键词:**无穷范数;Nekrasov 矩阵;H-矩阵;上界

**中图分类号:**O151.21

**文献标志码:**A

**文章编号:**1672-6693(2017)04-0061-04

## 1 预备知识

令  $C^{n \times n}(\mathbf{R}^{n \times n})$  表示复(实)矩阵的集合,  $\mathbf{N}=\{1,2,\dots,n\}$ 。设  $A=(a_{ij})$ ,记:

$$r_i(A) = \sum_{j \neq i}^n |a_{ij}|, i \in \mathbf{N}, h_1(A) = \sum_{j=1}^n |a_{1j}|, h_i(A) = \sum_{j=1}^{i-1} |a_{ij}| \frac{h_j(A)}{|a_{jj}|} + \sum_{j=i+1}^n |a_{ij}|。$$

将矩阵  $A$  分裂为  $A=D-L-U$ ,其中  $D=\text{diag}(a_{11}, a_{22}, \dots, a_{nn})$ ,  $U$  是严格上三角矩阵,  $L$  是严格下三角矩阵,即

$$U = \begin{pmatrix} 0 & -a_{12} & -a_{13} & \cdots & -a_{1n} \\ 0 & 0 & -a_{23} & \cdots & -a_{2n} \\ 0 & 0 & 0 & \cdots & -a_{3n} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \cdots & \vdots \\ 0 & 0 & 0 & \cdots & 0 \end{pmatrix}, L = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 & \cdots & 0 \\ -a_{21} & 0 & 0 & \cdots & 0 \\ -a_{31} & -a_{32} & 0 & \cdots & 0 \\ \vdots & \vdots & \vdots & \cdots & \vdots \\ -a_{n1} & -a_{n2} & -a_{n3} & \cdots & 0 \end{pmatrix}。$$

**定义 1**<sup>[1]</sup> 设矩阵  $A=(a_{ij}) \in \mathbf{R}^{n \times n}$ ,若矩阵  $A$  的非主对角元素  $a_{ij} \leq 0(i \neq j)$ ,且  $A$  的逆矩阵  $A^{-1}$  非负( $A^{-1} \geq 0$ ),则称  $A$  为 M-矩阵。

**定义 2**<sup>[2]</sup> 设矩阵  $A=(a_{ij}) \in \mathbf{R}^{n \times n}$ ,当  $A$  的比较矩阵,  $\langle A \rangle=(m_{ij})$  是 M-矩阵时,则称  $A$  为 H-矩阵,其中  $m_{ij} = \begin{cases} |a_{ii}|, & i=j \\ -|a_{ij}|, & i \neq j \end{cases}$ 。

**定义 3**<sup>[3]</sup> 设矩阵  $A=(a_{ij}) \in \mathbf{R}^{n \times n}, n \geq 2$ ,若对于  $\forall i \in \mathbf{N}$ ,有  $|a_{ii}| > h_i(A)$ ,则称矩阵  $A$  为 Nekrasov 矩阵。

**引理 1**<sup>[4]</sup> 设矩阵  $A=(a_{ij}) \in \mathbf{R}^{n \times n}$  是非奇异 H-矩阵,则  $|A^{-1}| \leq \langle A \rangle^{-1}$  ( $|A^{-1}|$  表示  $A^{-1}$  的每个元素都取绝对值后得到的矩阵)。

**引理 2**<sup>[5]</sup> 若矩阵  $A=(a_{ij}) \in \mathbf{R}^{n \times n}, n \geq 2, a_{ii} \neq 0$ ,则  $h_i(A) = |a_{ii}| [ (|D|-|L|)^{-1} |U| e ]_i$ ,其中  $e=(1,1,\dots,1)$ 。

**引理 3**<sup>[6]</sup> 矩阵  $A=(a_{ij}) \in \mathbf{R}^{n \times n} (n \geq 2)$  是 Nekrasov 矩阵的充要条件是  $(|D|-|L|)^{-1} |U| e < e$ 。进一步,该充要条件说明矩阵  $E-(|D|-|L|)^{-1} |U|$  是严格对角占优矩阵,其中  $E$  是单位矩阵。

\* 收稿日期:2016-05-03 修回日期:2017-05-20 网络出版时间:2017-05-16 11:27

资助项目:云南省科技厅应用基础研究青年项目(No.2013FD052);云南省教育厅项目(No.2013Y585);文山学院科学研究项目(No.16WSY11)

第一作者简介:李艳艳,女,讲师,研究方向为矩阵理论及其应用,E-mail:liyanyan409@126.com

网络出版地址: <http://kns.cnki.net/kcms/detail/50.1165.N.20170516.1127.084.html>

引理 4<sup>[7]</sup> 设  $\mathbf{A}, \mathbf{B} \in \mathbf{R}^{n \times n}$ ,  $\mathbf{A}$  和  $\mathbf{A} - \mathbf{B}$  都为非奇异矩阵, 则  $(\mathbf{A} - \mathbf{B})^{-1} = \mathbf{A}^{-1} + \mathbf{A}^{-1} \mathbf{B} (\mathbf{E} - \mathbf{A}^{-1} \mathbf{B})^{-1} \mathbf{A}^{-1}$ .

引理 5<sup>[7]</sup> 若  $\|\mathbf{A}\|_{\infty} < 1$ , 那么  $\mathbf{E} - \mathbf{A}$  是非奇异的, 且  $\|(\mathbf{E} - \mathbf{A})^{-1}\|_{\infty} \leq \frac{1}{1 - \|\mathbf{A}\|_{\infty}}$ .

## 2 主要结果

Nekrasov 矩阵、S-Nekrasov 矩阵是 H-矩阵的子类。关于该类矩阵的判定、行列式的估计、逆矩阵无穷范数上界的估计等问题已得到了一些学者的关注和研究<sup>[8-15]</sup>。本文研究了目前研究较为活跃的 Nekrasov 矩阵  $\mathbf{A}$  的逆矩阵无穷范数上界的估计问题, 并得到了两个较好的结果。

定理 1 设矩阵  $\mathbf{A} = (a_{ij}) \in \mathbf{R}^{n \times n}$  是 Nekrasov 矩阵, 若  $\max_{i \in \mathbf{N}} \frac{z_i(\mathbf{A})}{|a_{ii}|} \|\mathbf{U}\|_{\infty} < 1$ , 则  $\|\mathbf{A}^{-1}\|_{\infty} \leq \frac{\max_{i \in \mathbf{N}} \frac{z_i(\mathbf{A})}{|a_{ii}|}}{1 - \max_{i \in \mathbf{N}} \frac{z_i(\mathbf{A})}{|a_{ii}|} \|\mathbf{U}\|_{\infty}}$ ,

其中  $z_1(\mathbf{A}) = 1, z_i(\mathbf{A}) = \sum_{j=1}^{i-1} \frac{|a_{ij}|}{|a_{jj}|} z_j(\mathbf{A}) + 1, i \in \mathbf{N}, i \neq 1$ 。

证明 因为矩阵  $\mathbf{A}$  是 Nekrasov 矩阵, 则由引理 3 知  $\mathbf{E} - (|\mathbf{D}| - |\mathbf{L}|)^{-1} |\mathbf{U}|$  是严格对角占优矩阵, 令  $\mathbf{C} = \mathbf{E} - (|\mathbf{D}| - |\mathbf{L}|)^{-1} |\mathbf{U}|$ , 应用引理 4 和引理 5 得

$$\begin{aligned} \|\mathbf{C}^{-1}\|_{\infty} &= \|(\mathbf{E} - (|\mathbf{D}| - |\mathbf{L}|)^{-1} |\mathbf{U}|)^{-1}\|_{\infty} = \|\mathbf{E} + \mathbf{E}^{-1} (|\mathbf{D}| - |\mathbf{L}|)^{-1} |\mathbf{U}| (\mathbf{E} - \mathbf{E}^{-1} (|\mathbf{D}| - |\mathbf{L}|)^{-1} |\mathbf{U}|)^{-1} \mathbf{E}^{-1}\|_{\infty} = \\ &= \|\mathbf{E} + \mathbf{E} (|\mathbf{D}| - |\mathbf{L}|)^{-1} |\mathbf{U}| (\mathbf{E} - \mathbf{E} (|\mathbf{D}| - |\mathbf{L}|)^{-1} |\mathbf{U}|)^{-1}\|_{\infty} \leq \\ &= \|\mathbf{E}\|_{\infty} + \|\mathbf{E}\|_{\infty} \|( |\mathbf{D}| - |\mathbf{L}| )^{-1} \|\mathbf{U}\|_{\infty} \frac{1}{1 - \|( |\mathbf{D}| - |\mathbf{L}| )^{-1} \|\mathbf{U}\|_{\infty}} \leq \\ &= 1 + \|( |\mathbf{D}| - |\mathbf{L}| )^{-1} \|\mathbf{U}\|_{\infty} \frac{1}{1 - \|( |\mathbf{D}| - |\mathbf{L}| )^{-1} \|\mathbf{U}\|_{\infty}} = \frac{1}{1 - \|( |\mathbf{D}| - |\mathbf{L}| )^{-1} \|\mathbf{U}\|_{\infty}} \end{aligned} \quad (1)$$

下面寻找  $\|\mathbf{C}^{-1}\|_{\infty}$  和  $\|\mathbf{A}^{-1}\|_{\infty}$  的关系。因为  $\mathbf{C} = (|\mathbf{D}| - |\mathbf{L}|)^{-1} \langle \mathbf{A} \rangle$ , 则  $\langle \mathbf{A} \rangle = (|\mathbf{D}| - |\mathbf{L}|) \mathbf{C}$ , 于是由引理 1 知  $\|\mathbf{A}^{-1}\|_{\infty} \leq \|\langle \mathbf{A} \rangle^{-1}\|_{\infty} \leq \|\mathbf{C}^{-1}\|_{\infty} \|( |\mathbf{D}| - |\mathbf{L}| )^{-1} \|_{\infty}$ 。

下面讨论  $\|\mathbf{C}^{-1}\|_{\infty}$  和  $\|( |\mathbf{D}| - |\mathbf{L}| )^{-1} \|_{\infty}$  的上界。因为  $|\mathbf{D}| - |\mathbf{L}|$  是 M-矩阵, 则:

$$\|( |\mathbf{D}| - |\mathbf{L}| )^{-1} \|_{\infty} = \|( |\mathbf{D}| - |\mathbf{L}| )^{-1} \mathbf{e} \|_{\infty}.$$

令  $\mathbf{y} = (|\mathbf{D}| - |\mathbf{L}|)^{-1} \mathbf{e}$ , 则  $\mathbf{e} = (|\mathbf{D}| - |\mathbf{L}|) \mathbf{y}$ , 写成分量有  $|a_{11}| y_1 = 1, |a_{ii}| y_i = 1 + \sum_{j=1}^{i-1} |a_{ij}| y_j, i \in \mathbf{N}, i \neq 1$ , 由于  $|a_{ii}| y_i = z_i(\mathbf{A})$ , 则

$$\|( |\mathbf{D}| - |\mathbf{L}| )^{-1} \|_{\infty} = \|\mathbf{y}\|_{\infty} = \max_{i \in \mathbf{N}} \frac{z_i(\mathbf{A})}{|a_{ii}|}. \quad (2)$$

将该结果代入(1)式得  $\|\mathbf{C}^{-1}\|_{\infty} \leq \frac{1}{1 - \max_{i \in \mathbf{N}} \frac{z_i(\mathbf{A})}{|a_{ii}|} \|\mathbf{U}\|_{\infty}}$ 。

又因为  $\|\mathbf{A}^{-1}\|_{\infty} \leq \|\mathbf{C}^{-1}\|_{\infty} \|( |\mathbf{D}| - |\mathbf{L}| )^{-1} \|_{\infty}$ , 所以  $\|\mathbf{A}^{-1}\|_{\infty} \leq \frac{\max_{i \in \mathbf{N}} \frac{z_i(\mathbf{A})}{|a_{ii}|}}{1 - \max_{i \in \mathbf{N}} \frac{z_i(\mathbf{A})}{|a_{ii}|} \|\mathbf{U}\|_{\infty}}$ 。证毕

注 1 当  $\|\mathbf{U}\|_{\infty} < 1$  时, 本文得到的  $\|\mathbf{A}^{-1}\|_{\infty}$  上界的估计式小于文献[15]中的相应估计式, 所以这一结果改进了文献[15]中的结果。

定理 2 若矩阵  $\mathbf{A} = (a_{ij}) \in \mathbf{R}^{n \times n}$  是 Nekrasov 矩阵, 则  $\|\mathbf{A}^{-1}\|_{\infty} \leq \frac{\max_{i \in \mathbf{N}} z_i(\mathbf{A}) \|( |\mathbf{D}|^{-1} \|_{\infty}}{1 - \max_{i \in \mathbf{N}} \frac{z_i(\mathbf{A})}{|a_{ii}|} \|\mathbf{U}\|_{\infty}}$ 。

其中,  $z_1(\mathbf{A}) = 1, z_i(\mathbf{A}) = \sum_{j=1}^{i-1} \frac{|a_{ij}|}{|a_{jj}|} z_j(\mathbf{A}) + 1, i \in \mathbf{N}, i \neq 1$ 。

**证明** 因为矩阵  $A$  是 Nekrasov 矩阵, 则由引理 3 知  $E - (|D| - |L|)^{-1}|U|$  是严格对角占优矩阵, 记  $B = |D| - |D|(|D| - |L|)^{-1}|U|$ , 显然  $B$  仍然是严格对角占优矩阵. 又因为  $B = |D|(|D| - |L|)^{-1}A$ , 所以  $A = [|D|(|D| - |L|)^{-1}]^{-1}B = (E - |L||D|^{-1})B$ , 即  $\|A^{-1}\|_{\infty} \leq \|A\|_{\infty} \leq \|B^{-1}\|_{\infty} \|(E - |L||D|^{-1})^{-1}\|_{\infty}$ .

下面分别计算  $\|B^{-1}\|_{\infty}$  和  $\|(E - |L||D|^{-1})^{-1}\|_{\infty}$ . 因为  $B = |D| - |D|(|D| - |L|)^{-1}|U|$ , 则应用引理 3 知,

$$\begin{aligned} \|B^{-1}\|_{\infty} &\leq \|D^{-1}\|_{\infty} \|(E - (|D| - |L|)^{-1}|U|)^{-1}\|_{\infty}, \\ \|(E - (|D| - |L|)^{-1}|U|)^{-1}\|_{\infty} &= \|E + E^{-1}(|D| - |L|)^{-1}|U|(E - E^{-1}(|D| - |L|)^{-1}|U|)^{-1}E^{-1}\|_{\infty} = \\ &= \|E + E(|D| - |L|)^{-1}|U|(E - E(|D| - |L|)^{-1}|U|)^{-1}\|_{\infty} \leq \\ &= \|E\|_{\infty} + \|E\|_{\infty} \|( |D| - |L| )^{-1}\|_{\infty} \|U\|_{\infty} \frac{1}{1 - \|( |D| - |L| )^{-1}\|_{\infty} \|U\|_{\infty}} \leq \\ &= \frac{1 + \|( |D| - |L| )^{-1}\|_{\infty} \|U\|_{\infty}}{1 - \|( |D| - |L| )^{-1}\|_{\infty} \|U\|_{\infty}} = \frac{1}{1 - \|( |D| - |L| )^{-1}\|_{\infty} \|U\|_{\infty}}. \end{aligned}$$

所以  $\|B^{-1}\|_{\infty} \leq \|D^{-1}\|_{\infty} \|(E - (|D| - |L|)^{-1}|U|)^{-1}\|_{\infty} \leq \frac{\|D^{-1}\|_{\infty}}{1 - \|( |D| - |L| )^{-1}\|_{\infty} \|U\|_{\infty}}$ .

因为  $E - |L||D|^{-1}$  是 M-矩阵, 所以  $\|(E - |L||D|^{-1})^{-1}\|_{\infty} = \|(E - |L||D|^{-1})^{-1}e\|_{\infty}$ . 定义

$$z(A) = (E - |L||D|^{-1})^{-1}e,$$

则  $e = (E - |L||D|^{-1})z(A)$ , 写成分量有  $z_1(A) = 1, z_i(A) = 1 + \sum_{j=1}^{i-1} \frac{|a_{ij}|}{|a_{jj}|} z_j(A), i \in N, i \neq 1$ . 所以

$$\|(E - |L||D|^{-1})^{-1}\|_{\infty} = \|z(A)\|_{\infty} = \max_{i \in N} z_i(A).$$

结合以上二式得

$$\begin{aligned} \|A^{-1}\|_{\infty} &\leq \frac{\|D^{-1}\|_{\infty}}{1 - \|( |D| - |L| )^{-1}\|_{\infty} \|U\|_{\infty}} \max_{i \in N} z_i(A) \leq \\ &= \frac{\|D^{-1}\|_{\infty}}{1 - \max_{i \in N} \frac{z_i(A)}{|a_{ii}|} \|U\|_{\infty}} \max_{i \in N} z_i(A) = \frac{\max_{i \in N} z_i(A) \|D^{-1}\|_{\infty}}{1 - \max_{i \in N} \frac{z_i(A)}{|a_{ii}|} \|U\|_{\infty}}. \end{aligned}$$

证毕

注 2 定理 2 所得的  $\|A^{-1}\|_{\infty}$  的估计式, 与文献[15]中估计式的优劣性无法从理论上进行比较。

### 3 数值例子

下面通过选用恰当的数值算例, 说明本文的估计式优于文献[15]所给的估计式. 设:

$$A = \begin{pmatrix} 8 & -0.3 & -0.3 & -0.1 \\ -9 & 16 & -0.5 & -0.4 \\ -6 & -4 & 15 & -0.2 \\ -4.9 & -0.9 & -0.9 & 6 \end{pmatrix}.$$

应用 Nekrasov 矩阵的定义验证,  $A$  是 Nekrasov 矩阵, 应用文献[15]中的估计式得  $\|A^{-1}\|_{\infty} \leq 0.4453$ , 应用本文的结果得  $\|A^{-1}\|_{\infty} \leq 0.4263, \|A^{-1}\|_{\infty} \leq 0.4391$ . 而真值为  $\|A^{-1}\|_{\infty} = 0.3308$ .

通过上述数值算例发现, 本文的结果一定程度上提高了文献[15]中的相应结果. 所以定理 1, 定理 2 中的估计式是对 Nekrasov 矩阵的逆矩阵无穷范数上界估计的一个有益补充和完善。

#### 参考文献:

[1] VARGA R S. Matrix iterative analysis[M]. Berlin Springer Verlag, 2000. [M]. New York: Cambridge University Press, 1991.  
 [2] HORN R A, JOHNSON C R. Topics in matrix analysis [J]. Linear Algebra Appl, 1998, 281: 87-96.  
 [3] LI W. On Nekrasov matrices [J]. Linear Algebra Appl, 1998, 281: 87-96.

- [4] BERMAN A, PLEMMONS R J. Nonnegative matrices in the mathematical sciences[M]. Classics in Applied Mathematics, 1994, 9: 32-40.
- [5] ROBERT F. Blocs  $H$ -matrices et convergence des methods iteratives classiques par blocs [J]. Linear Algebra Appl, 1969, 2: 223-265.
- [6] SZULC T. Some remarks on a theorem of Gudkov[J]. Linear Algebra Appl, 1975, 11: 3-5.
- [7] 赵建兴, 桑彩丽. 严格  $\alpha$ -对角占优  $M$ -矩阵  $A$  的  $\|A^{-1}\|_{\infty}$  的上界估计[J]. 数学的实践与认识, 2015, 45(19): 280-284.  
ZHAO J X, SANG C L. Estimation of the upper bound on  $\|A^{-1}\|_{\infty}$  for strictly diagonally dominant  $M$ -matrix  $A$  [J]. Journal of Mathematics in Practice and Theory, 2015, 45(19): 280-284.
- [8] 郭爱丽, 聂祥荣, 武玲玲. Nekrasov 矩阵行列式界的估计 [J]. 安徽大学学报(自然科学版), 2015, 39(6): 15-18.  
GUO A L, NIE X R, WU L L. On bounds of determinants for the Nekrasov matrices[J]. Journal of Anhui University (Natural Science Edition): 2015, 39(6): 15-18.
- [9] 王银燕, 徐仲, 陆全. 广义 Nekrasov 矩阵的迭代判定准则 [J]. 高等学校计算数学学报, 2015, 37(1): 19-30.  
WANG Y Y, XU S, LU Q. Iterative criteria for generalized Nekrasov matrices[J]. Numerical Mathematics A Journal of Chinese Universities, 2015, 37(1): 19-30.
- [10] 郭爱丽, 刘建州. 广义 Nekrasov 矩阵的新判据[J]. 数学的实践与认识, 2016, 46(5): 239-245.  
GUO A L, LIU J Z. The new criteria for generalizad Nekrasov matrices[J]. Journal of Mathematics in Practice and Theory, 2016, 46(5): 239-245.
- [11] LI C Q, PEI H, GAO L, et al. Improvements on the infinity norm bound for the inverse of Nekrasov matrices[J]. Numerical Algorithms, 2016, 71(3): 613-630.
- [12] CVETKOVIC L.  $H$ -matrix theory vs eigenvalue localication[J]. Numer Algor, 2006, 42(3/4): 229-245.
- [13] CVETKOVIC L J, KOSTIC V, RAUSKI S. A new subclass of  $H$ -matrices[J]. Appl Math Comput, 2009, 208(1): 206-210.
- [14] LJILJANA C, VLADIMIR K, KSENIJA D. Max-norm bounds for the inverse of  $S$ -Nekrasov matrices[J]. Applied Mathematics and Computation, 2012, 218(18): 9498-9503.
- [15] LJILJANA C, DAI P F, KSENIJ A D, et al. Infinity norm bounds for the inverse of Nekrasov matrices [J]. Applied Mathematics & Computation, 2013, 219(10): 5020-5024.

## New Upper Bounds of the Infinite Norm for the Inverse of Nekrasov matrices

LI Yanyan

(School of Mathematics, Wenshan University, Wenshan Yunnan 663009, China)

**Abstract:** [Purposes] Nekrasov matrix is a subclass of  $H$ -matrix, and it also contains strictly diagonally dominant matrix, An estimate of the upper bound of the infinite norm of the inverse of the matrix. [Methods] Firstly, splitting of matrix  $A$  ( $A = D - L - U$ ); secondly, strictly diagonally dominant matrix  $C$  is constructed ( $C = E - (|D| - |L|)^{-1} |U|$ ); finally, by using the definition of Nekrasov matrix, related lemmas, and contraction of inequality. [Findings] Got two good results for  $\|A^{-1}\|_{\infty}$ . [Conclusions] Theoretical and numerical examples are given to show that the results here are better than the existing results.

**Keywords:** infinite norm; Nekrasov matrix;  $H$ -matrix; upper bound

(责任编辑 许 甲)