

Factorización de Cholesky

Obsérvese que si, en el proceso de diagonalización por congruencia de una matriz A , el término (1,1) de cada submatriz, objeto de la iteración, es no nulo, la eliminación gaussiana a efectuar no necesita permutación de líneas. Por tanto, en este caso es posible obtener P regular triangular superior tal que $p_{jj} = 1, \forall j$ y $P^t AP$ es diagonal D . Además, D y P son únicas. Este es el fundamento de la llamada factorización de Cholesky.