

Övningar MMG410: minstakvadratproblem

Larisa Beilina, e-mail: larisa.beilina@chalmers.se

L. Beilina

Department of Mathematical Sciences, Chalmers University of Technology and University of Gothenburg, SE-412 96 Gothenburg, Sweden, e-mail: larisa.beilina@chalmers.se

1. Vi vill lösa minstakvadratproblemet

$$\min_x \|Ax - b\|_2^2$$

då A har ortogonala kolumner ($a_j^T a_k = 0$ då $j \neq k$). Hur förenklar denna egenskap hos A lösandet av problemet?

Lösning:

Om A har ortogonala kolonner så är $A^T A = D$, där $D = \text{diag}(a_1^T a_1, a_2^T a_2, \dots, a_n^T a_n)$. Antag att ingen kolonn har längden noll, då är matrisen D ickesingulär med invers $D^{-1} = \text{diag}(1/\|a_1\|_2^2, 1/\|a_2\|_2^2, \dots, 1/\|a_n\|_2^2)$. Lösningen till minstakvadratproblemet kan skrivas (normalekvationerna) $x = (A^T A)^{-1} A^T b$ (ty om A har ortogonala kolonner och inga nollkolonner så måste den ha full kolonnrang. Varför?) Så, $x = D^{-1} A^T b$ eller $x_k = a_k^T b / \|a_k\|_2^2$.

2. Vi vill anpassa mätpunkter (t_k, N_k) (alla $N_k > 0$) till funktionen

$$N(t) = N_0 \exp^{-\lambda t}.$$

Gör en lämplig omskriving av problemet så att parametrarna, N_0 och λ , i modellen kan bestämmas med hjälp av ett (linjärt) minstakvadratproblem.

Lösning:

Problemet är att N_0 och λ ej ingår linjärt i modellen varför vi inte kan använda $\min_x \|Ax - b\|_2^2$ direkt. Idé: logaritmera

$$\log N(t) = \log N_0 - \lambda t.$$

$x_1 := \log N_0, x_2 := \lambda, b := \log N(t)$, då

$$b = x_1 - x_2 t.$$

Då får vi

$$\min_x \left\| \begin{bmatrix} 1 & -t_1 \\ 1 & -t_2 \\ \vdots & \vdots \\ 1 & -t_m \end{bmatrix} \cdot \begin{bmatrix} x_1 \\ x_2 \end{bmatrix} - \begin{bmatrix} \log N(t_1) \\ \log N(t_2) \\ \vdots \\ \log N(t_m) \end{bmatrix} \right\|_2^2$$

När x är beräknad sätter vi $N_0 = e^{x_1}$ och $\lambda = x_2$.

3. Givet mätpunkterna

$$(t_k, b_k) = (-n, 0), (-(n-1), 0), \dots, (-1, 0), (0, 1), (1, 0), (2, 0), \dots, (n, 0)$$

anpassa en rät linje till punkterna i tvånorm. (Alla b_k -värden är 0 förutom då $t_k = 0$ när $b_k = 1$.)

Lösning:

En rät linje har ekvation: $f(t) = x_1 + x_2 t$. A och b har $2n + 1$ rader och ser ut som:

$$A = \begin{bmatrix} 1 & -n \\ 1 & -(n-1) \\ \vdots & \vdots \\ 1 & -1 \\ 1 & 0 \\ \vdots & \vdots \\ 1 & n \end{bmatrix}, \quad b = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \\ \vdots \\ 0 \\ 1 \\ \vdots \\ 0 \end{bmatrix}.$$

På rad $n + 1$ står 1 i vektor b . Vi noterar att vi kan utnyttja föregående uppgift eftersom A har ortogonala kolonner.

Lösningen blir alltså

$$x = (A^T A)^{-1} A^T b = \begin{bmatrix} 2n+1 & 0 \\ 0 & 2n(n+1)(2n+1)/6 \end{bmatrix}^{-1} \begin{bmatrix} 1 \\ 0 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \frac{1}{2n+1} \\ 0 \end{bmatrix}.$$

Den räta linjen ges alltså av $f(t) = x_1 + x_2 t = 1/(2n+1) + 0 \cdot t$ eller $f(t) = 1/(2n+1)$ (konstant oberoende av t).

4. Antag att x och y löser problemen

$$\min_x \|Ax - b\|_2^2 \text{ resp. } \min_y \|(A + E)y - b\|_2^2$$

y är alltså lösningen till ett stört problem. Studera minstakvadratproblemet $\min_x \|Ax - b\|_2^2$ ur störningssynpunkt då

$$A = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & \delta \\ 0 & 0 \end{bmatrix}, 0 < \delta \ll 1, b = \begin{bmatrix} b_1 \\ b_2 \\ b_3 \end{bmatrix}, b_3 \neq 0$$

och då vi stör A med E

$$E = \begin{bmatrix} 0 & 0 \\ 0 & 0 \\ 0 & \varepsilon \end{bmatrix}, 0 < \varepsilon \ll \delta \ll 1.$$

Lösning:

Vi sätter upp normalekvationerna $A^T A x = A^T b$ och får

$$A^T A x = \underbrace{\begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & \delta^2 \end{bmatrix}}_{A^T A} x = \underbrace{\begin{bmatrix} b_1 \\ \delta b_2 \end{bmatrix}}_{A^T b} \rightarrow x = (A^T A)^{-1} A^T b = \begin{bmatrix} b_1 \\ b_2 / \delta \end{bmatrix}$$

Vi sätter nu upp normalekvationerna för det störda problemet, dvs. $(A + E)^T (A + E)y = (A + E)^T b$.

$$(A + E)^T (A + E)y = \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & \delta^2 + \varepsilon^2 \end{bmatrix} y = (A + E)^T b = \begin{bmatrix} b_1 \\ \delta b_2 + \varepsilon b_3 \end{bmatrix} \rightarrow$$

$$y = (A + E)^T (A + E)^{-1} (A + E)^T b = \begin{bmatrix} b_1 \\ \frac{\delta b_2 + \varepsilon b_3}{\delta^2 + \varepsilon^2} \end{bmatrix} \approx \begin{bmatrix} b_1 \\ \frac{\delta b_2 + \varepsilon b_3}{\delta^2} \end{bmatrix}$$

Så

$$y - x \approx \frac{\varepsilon}{\delta^2} \begin{bmatrix} 0 \\ b_3 \end{bmatrix} = \|E\|_2 k_2^2(A) \begin{bmatrix} 0 \\ b_3 \end{bmatrix}$$

med $k_2(A) = \|A^+\| \cdot \|A\| = \frac{1}{\delta}$ eftersom

$$\|A^+\| = \|(A^T A)^{-1} A^T\| = \left\| \begin{bmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1/\delta & 0 \end{bmatrix} \right\| = 1/\delta; \|A\| = 1.$$

5. Vi har modellen $e^{\alpha t} \approx b$ och vill bestämma α . Formulera ett icke-linjärt och ett linjärt minstakvadratproblem. Lös problemen exakt då antalet observationer är $m = 2$ och där $t_1 = 1, t_2 = 2$ samt $b_2 = 1/2$. (Den optimala lösningen beror alltså av b_1 .)

Lösning:

Ickelinjärt minstakvadratproblem:

$$\min_{\alpha} \|e^{\alpha t} - b\|_2^2$$

Linjärt minstakvadratproblem:

$$\min_{\alpha} \|\alpha t - \log(b)\|_2^2$$

För antalet observationer $m = 2$: Ickelinjärt minstakvadratproblem:

$$\min_{\alpha} (e^{\alpha t_1} - b_1)^2 + (e^{\alpha t_2} - b_2)^2$$

Linjärt minstakvadratproblem:

$$\min_{\alpha} (\alpha t_1 - \log(b_1))^2 + (\alpha t_2 - \log(b_2))^2$$

Först för antalet observationer $m = 2$ vi löser icke linjärt minstakvadratproblem. Vi vill lösa:

$$((e^{\alpha t_1} - b_1)^2 + (e^{\alpha t_2} - b_2)^2)'_{\alpha} = 0$$

och deriverar icke linjärt minstakvadratproblem:

$$((e^{\alpha t_1} - b_1)^2 + (e^{\alpha t_2} - b_2)^2)'_{\alpha} = 2t_1 e^{\alpha t_1} (e^{\alpha t_1} - b_1) + 2t_2 e^{\alpha t_2} (e^{\alpha t_2} - b_2).$$

Då $t_1 = 1, t_2 = 2$ och $b_2 = 1/2$ vi får ekvationen:

$$0 = e^{\alpha} (e^{\alpha} - b_1) + 2e^{2\alpha} (e^{2\alpha} - 1/2) = e^{2\alpha} - b_1 e^{\alpha} + 2e^{4\alpha} - e^{2\alpha} = 2e^{4\alpha} - b_1 e^{\alpha}.$$

och $2e^{4\alpha} = b_1 e^{\alpha}$, logariterar med $\log_e$:

$$\log(2) + 4\alpha = \log(b_1) + \alpha,$$

$$4\alpha - \alpha = \log(b_1) - \log(2),$$

$$\alpha = \frac{\log(b_1) - \log(2)}{3}$$

Nu för antalet observationer $m = 2$ vi löser linjärt minstakvadratproblem. Vi vill lösa:

$$((\alpha t_1 - \log(b_1))^2 + (\alpha t_2 - \log(b_2))^2)'_{\alpha} = 0$$

och deriverar linjärt minstakvadratproblem:

$$((\alpha t_1 - \log(b_1))^2 + (\alpha t_2 - \log(b_2))^2)'_{\alpha} = 2t_1 (\alpha t_1 - \log(b_1)) + 2t_2 (\alpha t_2 - \log(b_2))$$

Då $t_1 = 1, t_2 = 2$ och $b_2 = 1/2$: vi får ekvationen:

$$0 = \alpha - \log(b_1) + 2(2\alpha - \log(b_2)) = 5\alpha - (\log(b_1) + 2\log(b_2))$$

och $5\alpha = \log(b_1) + 2\log(b_2)$,

$$\alpha = \frac{\log(b_1) + 2\log(b_2)}{5} = \frac{\log(b_1) + 2\log(b_2)}{5}.$$