

MVE 275 Linjär algebra AT, Ht 12

Vecko-PM läsvecka 6

Lay: 6.1-6.6 Ortogonalitet, projektion och minstakvadratmetoden 7.1-2 Symmetriska matriser, diagonalisering, kvadratiske former.

I kapitel 6.1 införs *skalärprodukt*, *dot product* och *längd*, eller *norm* som kanske är ett bättre namn. Dessa motsvarar skalärprodukt och längd för geometriska vektorer då vektorerna ges i en ON-bas. Begreppet *ortogonalitet* är viktigt. Ortogonal komplementet till ett underrum i $\mathbb{R}^n$ är ett begrepp som generaliserar normalen till ett plan genom origo.

I avsnitt 6.2 är begreppet ON-bas, ortonormerad bas, viktigt. Sats 6.2.4 säger att ortogonalitet garanterar linjärt oberoende. Sats 6.2.5 visar hur lätt det är att bestämma koordinater i en ortogonal bas. Ännu enklare är det i en ON-bas, då är $x_k = \mathbf{x} \cdot \mathbf{e}_k$

Projektionsformeln, som ger projektionen av en vektor på en annan, är samma som presenterades i inledande kursen. Motiveringen till formeln måste vara algebraisk eftersom vi inte har några vinklar i $\mathbb{R}^n$. Vi använde projektionsformeln i inledande kursen för att dela upp en vektor i två ortogonala komponenter, den ena med en given riktning och den andra i planet ortogonalt mot denna riktning. En vidareutveckling av denna idé kommer i satserna 6.3.8 och 6.3.10. Begreppet ortogonala matriser som nämns i förbigående i 6.2 kommer att användas mycket i kapitel 7.

I 6.4 ges Gram-Schmidt processen för att stegvis bestämma en ortogonal bas för ett underrum W då man har en annan bas för W . Metoden är enkel, det gäller att i varje steg använda projektionsformeln för att ersätta en vektor i basen med en som är ortogonal mot de redan bestämda vektorerna i den sökta ortogonala basen.

I avsnitt 6.5 ges den mycket använda *minstakvadrat-metoden* för att finna *bästa möjliga lösning* till ett ekvationssystem *som saknar lösning*. I synnerhet handlar det då om överbestämda system, sådana med fler ekvationer än obekanta. I Matlab ges denna minstakvadrat-lösning till ekvationen $\mathbf{Ax} = \mathbf{b}$ av $\mathbf{x} = \mathbf{A} \backslash \mathbf{b}$.

Sats 6.5.13 ger metoden. Däremot har man inte direkt nytta av sats 6.5.14, det viktiga är att veta att om kolonnerna i A är linjärt oberoende så har ekvationen i sats 6.5.13 entydig lösning.

I boken definieras *minstakvadrat-felet* som $\|\mathbf{A}\hat{\mathbf{x}} - \mathbf{b}\|$ då $\hat{\mathbf{x}}$ är minsta-kvadrat lösningen. Ofta använder man istället *kvadratiske medelfelet* som är $\|\mathbf{A}\hat{\mathbf{x}} - \mathbf{b}\|/\sqrt{n}$ då n är antalet ekvationer i systemet. I 6.6 tillämpas metoden på t.ex anpassning av linje till mätpunkter. Minsta kvadrat-felet ökar då i allmänhet om man lägger till mätpunkter under det att kvadratiske medelfelet t.o.m. kan minska.

I kapitel 7.1 studeras diagonalisering av reella symmetriska matriser, alltså matriser som uppfyller att $A^T = A$. Spänningsmatrisen $\mathcal{S}$ vars egenvärden och egenvektorer vi behandlade förra veckan, är alltid symmetrisk. Väldigt många andra tillämpningar leder också till symmetriska matriser så resultaten i kapitlet är mycket användbara. I avsnittet ges två mycket viktiga satser. Dels sats 2, som säger att de reella symmetriska matriserna, och inga andra, alltid kan diagonaliseras med en reell ortogonal matris. *Spektralsatsen*, sats 3, beskriver situationen mer i detalj och ger hjälp vid problemlösning. Bevisen av satserna i kapitlet ryms inte i kursen. Utöver att man nu väljer en ortonormerad bas av egenvektorer är det ingen väsentlig skillnad på diagonalisering av symmetriska matriser och osymmetriska som behandlades i kapitel 5.3.

I kapitel 7.2 studerar vi kvadratiske former – funktioner från $\mathbb{R}^n$ till $\mathbb{R}$ som ges av ett andra-gradspolynom som endast har termer av grad två, t.ex. $f(x_1, x_2, x_3) = x_1^2 + 2x_1x_2 - x_3^2$. Sådana funktioner passar in i denna kurs genom att de ges av en matris A , $f(\mathbf{x}) = \mathbf{x}^T A \mathbf{x}$. Matrisen A är inte entydigt bestämd, men det finns en entydigt bestämd *symmetrisk* matris som ger f . Eftersom alla symmetriska matriser kan diagonaliseras kan man alltid göra ett koordinatbyte som förenklar funktionsuttrycket.

Lärsmål:

För att bli godkänd på kursen skall du kunna:

Lay	Mål
6.1	beräkna skalärprodukten av två vektorer i $\mathbb{R}^n$, tillämpa räkneregler för skalärprodukt, beräkna norm av en vektor i $\mathbb{R}^n$ och beräkna avståndet mellan vektorer i $\mathbb{R}^n$.
6.1	avgöra om två vektorer i $\mathbb{R}^n$ är ortogonala
6.1	bevisa Pythagoras sats i $\mathbb{R}^n$.
6.1	förklara vad som menas med $W^\perp$ om W är ett underrum i $\mathbb{R}^n$
6.1	tillämpa sats 6.1.3 vid problemlösning.
6.2	förklara vad som menas med <i>ortogonal bas</i> för ett underrum W och tillämpa sats 6.2.5 för beräkning av koordinaterna för en vektor $\mathbf{y} \in W$ relativt en ortogonal bas för W .
6.2	använda projektionsformeln 6.2.(2) i problemlösning
6.2	förklara vad som menas med <i>ortonormerad bas</i> för ett underrum W .
6.2	förklara vad som menas med en ortogonal matris.
6.3	tillämpa sats 6.3.8 för att dela upp en vektor i ortogonala komponenter, en i W och den andra i $W^\perp$ då en ortogonal bas för W är känd.
6.4	tillämpa Gram-Schmidt processen för att bestämma en ortogonal bas för ett underrum W i $\mathbb{R}^n$ utgående från en annan bas för W .
6.5	förklara vad som menas med en minstakvadrat-lösning
6.6	tillämpa minstakvadrat-metoden för modellanpassning.
7.1	tillämpa satserna 7.1.1 – 7.1.3 vid problemlösning. Spektralsatsen (sats 7.1.3) är extra viktig.
7.2	tillämpa sats 7.2.4 Satsen om principalaxlar för att skriva en kvadratisk form utan blandade termer.

För överbetyg skall du också kunna:

Lay	Mål
6.1	bevisa sats 6.1.3.
6.2	bevisa sats 6.2.4: en ortogonal mängd av vektorer är linjärt oberoende.
6.2	bevisa sats 6.2.7 då U är en ortogonal matris.
6.4	förklara varför Gram-Schmidt processen leder till en ortogonal bas.
6.5	förklara varför minstakvadrat-lösningarna är lösningarna till den normaliserade ekvationen $A^T \mathbf{A} \mathbf{x} = A^T \mathbf{b}$.
7.2	förklara vad som menas med positivt definit, negativt definit och indefinit kvadratisk form och tillämpa sats 7.2.5 för klassificering av kvadratiske former.

Rekommenderade uppgifter

(PP är förkortning av Practice problems. Här menas att du bör inleda med att göra alla dessa. Du hittar dem direkt före övningarna till respektive avsnitt.)

Avsnitt	Godkäntnivå		Överbetygsnivå
	Instuderingsuppgifter	Träningsuppgifter	
6.1	PP, 1, 6, 8, 11, 13, 15	17, 19, 24, 26	28, 29, 30, 34
6.2	PP, 3, 5, 9, 11	17, 21, 23, 27	29, 33
6.3	PP, 1, 3, 5	9, 11, 15, 21	23
6.4	PP, 1, 5	3, 9, 11, 17ab	22
6.5	PP, 3, 5, 7	9, 13, 17	19
6.6	PP, 1, 4	7, 10, 11	15, 16
7.1	PP, 1 - 11	15, 17, 24, 26	28, 29, 35
7.2	PP, 1, 3, 5	7	9, 21a-e, 22