

שאלה 1

תהי $f: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ עלידי. נגיד את $A \in \mathbb{R}^{n \times m}$, $b \in \mathbb{R}^n$ ויהי $g(x) = f(Ax + b)$. אז שאמם גזירה ברציפות איז $\nabla g(x) = A^T \nabla f(Ax + b)$. הכוונה: השתמשו בכל השרשרת עבור פונקציית מרבבות משתנים.

ל

$$f: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$$

$$g: \mathbb{R}^m \rightarrow \mathbb{R}$$

$$A \in \mathbb{R}^{m \times n}, b \in \mathbb{R}^n$$

$$g(x) = f(Ax + b) = f(u(x)) \quad (u(x) = Ax + b)$$

$$\frac{\partial g}{\partial x_i} = \sum_{j=1}^n \frac{\partial f}{\partial u_j} \cdot \frac{\partial u_j}{\partial x_i} \quad \leftarrow \text{רעיון סדר}$$

$$* \quad u_j(x) = \langle A_j, x \rangle + b_j \Rightarrow \frac{\partial u_j}{\partial x_i} = A_{ji} \quad (x_i - j \text{ הינה } A_{ji})$$

$$\Rightarrow \frac{\partial g}{\partial x_i} = \sum_{j=1}^n \frac{\partial f}{\partial u_j} \cdot A_{ji} = \langle A^i, \nabla f(Ax + b) \rangle \quad (x^i \text{ הינה } A^i)$$

$$\Rightarrow \nabla g(x) = \begin{pmatrix} \langle A^1, \nabla f(Ax + b) \rangle \\ \vdots \\ \langle A^m, \nabla f(Ax + b) \rangle \end{pmatrix} =$$

$$= \begin{pmatrix} (A^1)^T \nabla f(Ax + b) \\ \vdots \\ (A^m)^T \nabla f(Ax + b) \end{pmatrix} =$$

$$= A^T \nabla f(Ax + b)$$

שאלה 2

מיצאו נסחה מפורשת לחישוב הגרדיינט וההסיאן של הפונקציות הבאות. ניתן להגדיר פונקציות, מטריצות וקטורי ערך בדומה למה שראינו בתרגול.

$$f(x, y, z) = (x + 2y - 3z)^2 - e^{-2x+y-z}$$

ר2. (k) $f(x, y, z) = (\underbrace{x+2y-3z}_u)^2 - e^{\underbrace{-2x+y-z}_v}$

$$\begin{pmatrix} u \\ v \end{pmatrix} = \underbrace{\begin{pmatrix} 1 & 2 & -3 \\ -2 & 1 & -1 \end{pmatrix}}_A \underbrace{\begin{pmatrix} x \\ y \\ z \end{pmatrix}}_x := Ax$$

$$\Rightarrow f(x, y, z) = u^2 - e^v = g(u, v) = g(Ax)$$

$$\nabla f(x, y, z) = A^T \nabla g(u, v)$$

$$\frac{\partial g}{\partial u} = 2u, \quad \frac{\partial g}{\partial v} = -e^v \Rightarrow \nabla g(u, v) = \begin{pmatrix} 2u \\ -e^v \end{pmatrix}$$

$$\begin{aligned} \Rightarrow \nabla f(x, y, z) &= A^T \begin{pmatrix} 2u \\ -e^v \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & -2 \\ 2 & 1 \\ -3 & -1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 2x+4y-6z \\ -e^{-2x+y-z} \end{pmatrix} = \\ &= \begin{pmatrix} 2x+4y-6z+2e^{-2x+y-z} \\ 4x+8y-12z-e^{-2x+y-z} \\ -6x-12y+18z+e^{-2x+y-z} \end{pmatrix} \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \frac{\partial(\partial g)}{\partial u} &= \frac{\partial^2 g}{\partial u^2} = 2, \quad \frac{\partial(\partial g)}{\partial v} = 0 \Rightarrow \nabla^2 g(u, v) = \\ \frac{\partial(\partial g)}{\partial v} &= -e^v, \quad \frac{\partial(\partial g)}{\partial u} = 0 \quad = \begin{pmatrix} 2 & 0 \\ 0 & -e^v \end{pmatrix} \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} \Rightarrow \nabla^2 f(x, y, z) &= A^T \begin{pmatrix} 2 & 0 \\ 0 & -e^v \end{pmatrix} A = \begin{pmatrix} 2 & 2ve^v & 1 & 2 & -3 \\ 4 & -ve^v & -2 & 1 & -1 \\ -6 & ve^v & 18 & -ve^v & \end{pmatrix} = \\ &= \begin{pmatrix} 2-4ve^v & 4+2ve^v & -6-2ve^v \\ 4+2ve^v & 8-ve^v & -12+ve^v \\ -6-2ve^v & -12+ve^v & 18-ve^v \end{pmatrix} \end{aligned}$$

$$f(x, y, z) = (x+y)^2 (y+z)^3 (z+x)^4 \quad (3.2)$$

$$\begin{pmatrix} a \\ b \\ c \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} x+y \\ y+z \\ z+x \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \\ z \end{pmatrix}$$

$$X = \begin{pmatrix} x \\ y \\ z \end{pmatrix} \quad A = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 1 \end{pmatrix} \quad \text{Now}$$

For example consider the function $f(x, y, z) = a^2 \cdot b^3 \cdot c^4$.
 - Jacobian matrix

$$f(x, y, z) = g(a, b, c) = a^2 \cdot b^3 \cdot c^4 = g(Ax)$$

$$\nabla g(x) = A^T \cdot \nabla f(Ax) = A^T \nabla f(a, b, c) \quad \text{partial derivatives}$$

$$\nabla f(x, y, z) = A^T \cdot \begin{pmatrix} 2a \cdot b^3 \cdot c^4 \\ 3b^2 \cdot a^2 \cdot c^4 \\ 4c^3 \cdot a^2 \cdot b^3 \end{pmatrix}$$

$$\nabla^2 f(x, y, z) = A^T \begin{pmatrix} 2 \cdot b^3 \cdot c^4 & 6 \cdot b^2 a \cdot c^4 & 8c^3 \cdot a \cdot b^3 \\ 6 \cdot a \cdot b^2 \cdot c^4 & 6 \cdot b \cdot a^2 \cdot c^4 & 12c^3 \cdot b^2 \cdot a^2 \\ 8a \cdot b^3 \cdot c^3 & 12b^2 \cdot a^2 \cdot c^3 & 12 \cdot c^2 \cdot a^2 \cdot b^3 \end{pmatrix} \cdot A$$

$$\text{Solving } A \text{ for } (a, b, c) \text{ given } x, y, z - \text{ do } \text{ solve } \begin{pmatrix} a \\ b \\ c \end{pmatrix} \text{ now} \\ \text{e.g. } \begin{pmatrix} 10, 9, 7 \end{pmatrix}$$

$b, c \in \mathbb{R}^n$ ו- $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ עבור $f(x) = \ln((c^T(Ax + b))^2 + 1)$ המוגדרת על-ידי $f: \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$

(3)

$$f(x) = \ln((c^T(Ax + b))^2 + 1) = \ln((c^T Ax + c^T b)^2 + 1)$$

$$A' = c^T A \in \mathbb{R}^{1 \times n}, b' = c^T b \in \mathbb{R}$$

$$u(x) = A'x + b' = c^T Ax + c^T b$$

$$\Rightarrow f(x) = g(A'x + b') = g(u(x)) = \ln(u^2 + 1)$$

$$\nabla g(A'x + b') = \frac{2u}{u^2 + 1}$$

$$\Rightarrow \nabla f(x) = (A')^\top \cdot \frac{2u}{u^2 + 1} = \frac{2u}{u^2 + 1} \cdot (A')^\top$$

$$\nabla^2 f(x) = (A')^\top \cdot \left(\frac{2u}{u^2 + 1} \right)' (A') = \left(\frac{2u}{u^2 + 1} \right)' A^\top C C^\top A =$$

$$= \frac{2(u^2 + 1) - 2u(2u)}{(u^2 + 1)^2} A^\top C C^\top A = \frac{2 - 2u^2}{(u^2 + 1)^2} A^\top C C^\top A$$

$$(A^i)_{(i)} = A_i^T \quad \text{and} \quad A^i \in \mathbb{R}^{n \times n} \quad \text{and} \quad f(x) = \ln \left(\sum_{j=1}^m e^{A_j^T x + b_j} \right) \quad (7)$$

$$\forall 1 \leq i \leq n \quad g(x) = \ln \left(\sum_{j=1}^m e^{A_j^T x} \right) \Rightarrow f(x) = g(A^i x + b)$$

$$\begin{aligned} \nabla g(x) &= \begin{pmatrix} \frac{\partial x_1}{\sum_{j=1}^m e^{x_j}} \\ \vdots \\ \frac{\partial x_n}{\sum_{j=1}^m e^{x_j}} \end{pmatrix} \Rightarrow \left(\nabla^2 g(x) \right)_{ik} = \frac{\partial^2 g}{\partial x_i \partial x_k}(x) \\ &= \begin{cases} \frac{e^{x_i} \left(\sum_{j=1}^m e^{x_j} - e^{x_i} \right)}{\left(\sum_{j=1}^m e^{x_j} \right)^2} & k=i \\ \frac{-e^{x_i} \cdot e^{x_k}}{\left(\sum_{j=1}^m e^{x_j} \right)^2} & k \neq i \end{cases} \end{aligned}$$

$$\nabla f(x) = A^T \cdot \nabla g(A^i x + b) \quad \text{and} \quad \nabla^2 f(x) = A^T \nabla^2 g(A^i x + b) \cdot A^i$$

$$\nabla^2 f(x) = A^T \nabla^2 g(x) \cdot A^i$$

- א. נתונות קבוצה סגורה $C \subseteq \mathbb{R}^n$ ופונקציה רציפה $\mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}: f$. ידוע כי קיים סקלר $\alpha \in \mathbb{R}^n$ כך שהקבוצה $S = \{x \in \mathbb{R}^n : f(x) \leq \alpha\} \cap C$ חסומה ולא ריקה. הוכיחו כי

$$\underset{x \in C}{\operatorname{argmin}} f(x) \neq \emptyset$$

לפי קיומו של α מתקיים

$$f^{-1}(x \in [-m, \alpha]) = \{x \in \mathbb{R}^n | f(x) \leq \alpha\}$$

הנראה שקיים $x_0 \in C$ כך ש- $f(x_0) \leq \alpha$ ומכיוון ש- f רציפה אז

קיים $\delta > 0$ כך ש- $|x - x_0| < \delta$ מתקיים $f(x) \leq \alpha$.

בנוסף נשים N מוגדרת כך ש- $f(x) \geq \alpha$ אם $|x - x_0| \geq N$.
 $f(x) \geq \alpha \iff x \in S$

$$x \in S \iff f(x) \geq \alpha$$

$$f(x) \geq \alpha \supseteq f(y) \geq \alpha$$

$C^- = \{x \in \mathbb{R}^n : f(x) < \alpha\}$

נוכיח ש- $f(x) \geq \alpha \forall x \in C \setminus S$

\Leftarrow

אנו נניח ש- $f(x) < \alpha$ עבור $x \in C \setminus S$.

$$\underset{x \in C}{\operatorname{argmin}} f(x) \neq \emptyset$$

ב. פונקציה $f: C \subseteq \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ קבוצה סגורה נקראת קוורסיבית ב- C אם לכל M קיים $R > 0$ כך שלכל $x \in C$ ש- $f(x) > M$ אז $\|x\| > R$.

$$\operatorname{argmin}_{x \in C} f(x) \neq \emptyset$$

$x_0 \in C$ מינימום מקומי מינימום:

$$(1) \quad \|x\| > R \Rightarrow f(x) > f(x_0) - \epsilon \geq R > 0 \quad \text{ר'}$$

$$B := B(0, R) = \{x \in C \mid \|x\| \leq R\} \quad \text{ר'}$$

נניח בטענה אציג B העוותה קבוצה סגורה. ב- C קיימת סואת S -קונטינואלית f (ולא f היא מוגדרת ב- C רק ב- B).

$x^* \in \operatorname{argmin}_{x \in S} f(x)$ \Rightarrow קיימת סואת f מוגדרת ב- S , וקיים $x_0 \in S$ מינימום מקומי ל- f ב- S .

$$\forall x \in C/S : f(x^*) \leq f(x_0) \leq f(x)$$

$x^* \in \operatorname{argmin}_S f(x)$

$$\forall x \in S : f(x^*) \leq f(x)$$

$x^* \in \operatorname{argmin}_S f(x)$

$$\Rightarrow x^* \in \operatorname{argmin}_{x \in C} f(x)$$

$$\textcircled{1c} \quad f(x, y, z) = (x - y + z)^4 - (x - z - 3)^2 \quad (5)$$

$$\begin{pmatrix} u \\ v \\ w \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} x-y+z \\ x-z \\ x-z \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & -1 & 1 \\ 1 & 0 & -1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \\ z \end{pmatrix} = A \cdot x$$

$$f(u, v) = u^4 - (v-3)^2$$

$$\nabla f(u, v) = \begin{pmatrix} 4u^3 \\ 6-2v \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix} \Leftrightarrow \begin{array}{l} u=0 \\ v=3 \end{array} \Leftrightarrow \begin{array}{l} y=2z+3 \\ x=z+3 \end{array}$$

$$\forall z \in \mathbb{R}: (z+3, 2z+3, z) \text{ : ein lokales Maximum ist } f(0, 3, 3)$$

$$u = x-y+z = z+3 - 2z+3 + z = 6$$

$$\nabla^2 f(u, v) = \begin{pmatrix} 12u^3 & 0 \\ 0 & -2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 12 \cdot 6^3 & 0 \\ 0 & -2 \end{pmatrix}$$

$$\det(\nabla^2 f(u, v)) = 12 \cdot 6^3 \cdot (-2) < 0 \Rightarrow \text{ lokales Maximum}$$

$\forall z \in \mathbb{R}: (z+3, 2z+3, z)$ ist ein lokales Maximum

• \rightarrow es ist ein Punkt

הכוונה: אל תגזרו ישרות והשתמשו בכלים שלמדו בתרגול.

$$f(x, y, z) = x^4 - 2x^2 + y^2 + 2yz + 2z^2$$

.ב

15.

$$\textcircled{2} \quad f(x, y, z) = x^4 - 2x^2 + y^2 + 2yz + 2z^2$$

$$\Rightarrow \nabla f(x, y, z) = \begin{pmatrix} 4x^3 - 4x \\ 2y + 2z \\ 2y + 4z \end{pmatrix} = 0$$

$$\Rightarrow \begin{cases} 4x(x^2 - 1) = 0 \\ y = -z \\ y = -2z \end{cases} \Rightarrow \begin{cases} x \in \{-1, 0, 1\} \\ y = z = 0 \end{cases} \Rightarrow$$

$$\Rightarrow \underbrace{\left(\begin{pmatrix} -1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} \right)}_{\text{נקודות}} \leftarrow \begin{matrix} \text{נקודות} \\ \text{אינטראקציוניות} \end{matrix}$$

נקודות הולכה

$$\nabla^2 f = \begin{pmatrix} 12x^2 - 4 & 0 & 0 \\ 0 & 2 & 2 \\ 0 & 2 & 4 \end{pmatrix}$$

$$\nabla^2 f(0, 0, 0) = \begin{pmatrix} -4 & 0 & 0 \\ 0 & 2 & 2 \\ 0 & 2 & 4 \end{pmatrix}$$

$$*\Delta_1 = -4 < 0, \quad (-1)^1 \Delta_1 = 4 > 0$$

לפנינו קירקן אינטראקציית מינימום局極值 קשור לנקודה $(0, 0, 0)$

לכן $\boxed{(0, 0, 0)}$

ג'ס'ס נולן

$$\nabla^2 f = \begin{pmatrix} 12x^2 - 4 & 0 & 0 \\ 0 & 2 & 2 \\ 0 & 2 & 4 \end{pmatrix}$$

$$\nabla^2 f(-1,0,0) = \begin{pmatrix} 8 & 0 & 0 \\ 0 & 2 & 2 \\ 0 & 2 & 4 \end{pmatrix} \rightarrow \begin{aligned} \Delta_1 &= 8 > 0 \\ \Delta_2 &= | \begin{matrix} 8 & 0 \\ 0 & 2 \end{matrix} | = 16 > 0 \\ \Delta_3 &= 8 | \begin{matrix} 2 & 2 \\ 2 & 4 \end{matrix} | = 32 > 0 \end{aligned}$$

$\nabla^2 f(-1,0,0) \succ 0$, מינימום מקומי ב- $(-1,0,0)$

לפניהם קיימת שיקוף ב- $(-1,0,0)$ מינימום מקומי ב-

בנוסף ל- $(-1,0,0)$ מינימום מקומי ב-

$$\text{אך } \nabla^2 f(-1,0,0) = \nabla^2 f(1,0,0) - e \neq 0 \text{ מכאן}$$

בנוסף ל- $(-1,0,0)$ מינימום מקומי ב-

$$f(x, y) = \frac{x+y}{3+x^2+xy+y^2}$$

הכוונה: ניתן להראות שכל הנקודות הסטציונריות הן גלובליות ולכן אין צורך לחשב את ההסיאן.

(2)

$$f(x, y) = \frac{x+y}{3+x^2+xy+y^2}$$

$$\frac{\partial f}{\partial x}(x, y) = \frac{3+x^2+xy+y^2 - (x+y)(2x+y)}{(3+x^2+xy+y^2)^2} = \frac{3-x^2-2xy}{(3+x^2+xy+y^2)^2}$$

$$\frac{\partial f}{\partial y}(x, y) = \frac{3+x^2+xy+y^2 - (x+y)(2y+x)}{(3+x^2+xy+y^2)^2} = \frac{3-y^2-2xy}{(3+x^2+xy+y^2)^2}$$

לפיה נצרכו מסקנ'ר א-דינמי.

$$\begin{cases} 3-x^2-2xy=0 \\ 3-y^2-2xy=0 \end{cases} \Rightarrow x^2-y^2=0 \Rightarrow x^2=y^2 \Rightarrow$$

① $x=y$
② $x=-y$

$$\textcircled{1} \quad 3-x^2-2x^2=0 \Rightarrow 3x^2=3 \Rightarrow x=\pm 1 \Rightarrow \left(\begin{matrix} 1 \\ 1 \end{matrix}\right), \left(\begin{matrix} -1 \\ -1 \end{matrix}\right)$$

$$\textcircled{2} \quad 3-x^2+2x^2=0 \Rightarrow x^2=-3 \Rightarrow x=\emptyset$$

$$f(1, 1) = \frac{2}{6} = \frac{1}{3}; \quad f(-1, -1) = -\frac{2}{6} = -\frac{1}{3}$$

$$-\frac{1}{3} \leq f(x, y) \leq \frac{1}{3} \quad \therefore \text{מתקיים}$$

C 800, 5 zadce pení

$$f(x,y) = \frac{x+y}{3+x^2+xy+y^2}$$

① $f(x,y) > -\frac{1}{3}$:

$$\frac{x+y}{3+x^2+xy+y^2} > -\frac{1}{3} \Rightarrow \frac{-3x-3y}{3+x^2+xy+y^2} < 1$$

$$\Rightarrow -3x-3y < 3+x^2+xy+y^2$$

$$\Rightarrow x^2+x(3+y)+y^2+3y+3 > 0$$

• O-n גדרה שORTHOGONAL LINE

$$\mathcal{D} = (3+y)^2 - 4(y^2+3y+3) =$$

$$= y^2 + 6y + 9 - 4y^2 - 12y - 12 =$$

$$= -3y^2 - 6y - 3 = -3(y^2 + 2y + 1) = -3(y+1)^2$$

(-1,-1) -> הנקודה (-1,-1) מוגדרת כנקודת מינימום局地 מינימום

$f(x) > -\frac{1}{3}$: (-1,-1) היא LINE שמעבר לה $f(x) > -\frac{1}{3}$ =>

ENN: LINE $y = -3$ מוגדרת כPOINT - (-1,-1) =>

② $f(x) \leq \frac{1}{3}$

$$\Rightarrow \frac{x+y}{3+x^2+xy+y^2} \leq \frac{1}{3} \Rightarrow 3x+3y \leq 3+x^2+xy+y^2$$

$$\Rightarrow x^2+x(y-3)+(y^2-3y+3) \geq 0$$

(O-n גדרה שORTHOGONAL LINE) על מנת שנמצא פתרון יש $y \neq -3$

$$\mathcal{D} = (y-3)^2 - 4(y^2-3y+3) = y^2 - 6y + 9 - 4y^2 + 12y - 12 =$$

$$= -3y^2 + 6y - 3 = -3(y^2 - 2y + 1) = -3(y-1)^2$$

$\forall y \neq 1$: $f(x) < \frac{1}{3}$ \Leftarrow $\forall y \neq 1$: $\mathcal{D} < 0$

$y = 1$: $\mathcal{D} = 0$

ENN: LINE $y = 1$ מוגדרת כPOINT - (1,1) =>