

Lista de Revisão

Daniel Kiyoshi Hashimoto Vouzella de Andrade – 119025937

Álgebra Linear Aplicada - 2023.1

Sala 1

Calcule:

$$\min_x \|a - x b\|^2$$

onde:

$$a = \begin{bmatrix} a_0 \\ a_1 \\ a_2 \end{bmatrix}, \quad b = \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{bmatrix} \quad \text{e} \quad a_0, a_1, a_2, x \in \mathbb{R}$$

Da questão 2, foi calculado o mínimo para a e b arbitrários:

$$a^T a - \frac{(b^T a)^2}{b^T b}$$

Substituindo os valores:

$$\begin{aligned} & \begin{bmatrix} a_0 \\ a_1 \\ a_2 \end{bmatrix}^T \begin{bmatrix} a_0 \\ a_1 \\ a_2 \end{bmatrix} - \frac{\left(\begin{bmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{bmatrix}^T \begin{bmatrix} a_0 \\ a_1 \\ a_2 \end{bmatrix} \right)^2}{\begin{bmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{bmatrix}^T \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{bmatrix}} \\ & [a_0 \quad a_1 \quad a_2] \cdot \begin{bmatrix} a_0 \\ a_1 \\ a_2 \end{bmatrix} - \frac{\left([1 \quad 1 \quad 1] \cdot \begin{bmatrix} a_0 \\ a_1 \\ a_2 \end{bmatrix} \right)^2}{[1 \quad 1 \quad 1] \cdot \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{bmatrix}} \\ & a_0^2 + a_1^2 + a_2^2 - \frac{(a_0 + a_1 + a_2)^2}{3} \\ & \frac{3 a_0^2 + 3 a_1^2 + 3 a_2^2 - (a_0^2 + a_1^2 + a_2^2 + 2 a_0 a_1 + 2 a_0 a_2 + 2 a_1 a_2)}{3} \\ & \frac{2 a_0^2 + 2 a_1^2 + 2 a_2^2 - 2 a_0 a_1 - 2 a_0 a_2 - 2 a_1 a_2}{3} \end{aligned}$$

Sala 2

Calcule:

$$\min_x \|a - x b\|^2$$

onde:

$$a, b \in \mathbb{R}^n \quad \text{e} \quad x \in \mathbb{R}$$

$$\begin{aligned} & \min_x \|a - x b\|^2 \\ & \min_x (a - x b)^T (a - x b) \\ & \min_x a^T a - x b^T a - x a^T b + x^2 b^T b \\ & \min_x a^T a - x b^T a - x b^T a + x^2 b^T b \\ & \min_x a^T a - 2 x b^T a + x^2 b^T b \end{aligned}$$

Derivando expressão interna de min em relação à x e igualando a 0 (para achar pontos críticos):

$$\begin{aligned} -2 b^T a + 2 x b^T b &= 0 \\ 2 x b^T b &= 2 b^T a \\ x b^T b &= b^T a \\ x &= \frac{b^T a}{b^T b} \end{aligned}$$

Dessa forma o mínimo é:

$$\begin{aligned} & a^T a - 2 x b^T a + x^2 b^T b \\ & a^T a - 2 \frac{b^T a}{b^T b} b^T a + \left(\frac{b^T a}{b^T b} \right)^2 b^T b \\ & a^T a - 2 \frac{(b^T a)^2}{b^T b} + \frac{(b^T a)^2}{b^T b} \\ & a^T a - \frac{(b^T a)^2}{b^T b} \end{aligned}$$

Sala 3

(Regressão Rigde) Calcule:

$$\min_x \|A x - b\|^2 + \lambda \|x\|^2$$

onde:

$$A \in \mathbb{R}^{m \times n} \quad , \quad b \in \mathbb{R}^m \quad , \quad x \in \mathbb{R}^n \quad \text{e} \quad \lambda \in \mathbb{R}$$

$$\begin{aligned} & \min_x \|A x - b\|^2 + \lambda \|x\|^2 \\ & \min_x (A x - b)^T (A x - b) + \lambda x^T x \\ & \min_x x^T A^T A x - b^T A x - x^T A^T b + b^T b + \lambda x^T x \\ & \min_x x^T A^T A x - (A^T b)^T x - (A^T b)^T x + b^T b + \lambda x^T x \\ & \min_x x^T A^T A x - 2 (A^T b)^T x + \lambda x^T x \end{aligned}$$

Derivando expressão interna de min em relação à x e igualando a 0 (para achar pontos críticos):

$$\begin{aligned} 2 A^T A x - 2 A^T b + 2 \lambda x &= 0 \\ A^T A x - A^T b + \lambda x &= 0 \\ A^T A x + \lambda x &= A^T b \\ (A^T A + \lambda I) x &= A^T b \end{aligned}$$

Agora basta resolver o sistema linear.

Sala 4

Se matrix $A \in \mathbb{R}^{N \times N}$ tem condicionamento 10^3 . Qual é condicionamento da matriz $A^T A$? O novo condicionamento é pior ou melhor do que a de A para se usar no computador?

Lembrete: $\text{cond}(A) = \frac{\sigma_1}{\sigma_N}$

$$\begin{aligned} A &= U \Sigma V^T \\ A^T A &= (U \Sigma V)^T (U \Sigma V^T) \\ &= V^{TT} \Sigma^T U^T U \Sigma V^T \\ &= V \Sigma^T \Sigma V^T \\ &= V \Sigma \Sigma V^T \\ A^T A &= V \Sigma^2 V^T \end{aligned}$$

Como V é uma matriz ortonormal e V^T é uma matriz ortonormal, calculamos o SVD de $A^T A$. Assim temos que:

$$\text{cond}(A^T A) = \frac{\sigma_1^2}{\sigma_N^2} = \left(\frac{\sigma_1}{\sigma_N} \right)^2 = \text{cond}(A)^2$$

Sala 5

Qual seria a saída do algoritmo K-means na notação matricial para esse conjunto de pontos com $K = 2$?

$$a_1 := (0, 0)$$

$$a_4 := (-3, 0)$$

$$a_2 := (0, 1)$$

$$a_3 := (8, 4)$$

$$a_5 := (9, 3)$$

Observe que os pontos médios dos clusters são:

$$m_{1,2,4} = (-1, 0.333) \quad \text{e} \quad m_{3,5} = (8.5, 3.5)$$

A saída seria:

$$\begin{bmatrix} -1 & 8.5 \\ 0.333 & 3.5 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} 1 & 1 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 0 & 1 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -1 & -1 & 8.5 & -1 & 8.5 \\ 0.333 & 0.333 & 3.5 & 0.333 & 3.5 \end{bmatrix}$$

Sala 6

O float do seu computador tem erro de 10^{-8} e você só pode cometer erros na segunda casa decimal. Qual é um condicionamento de A problemático para você?

$$\text{cond} + \text{err} \geq \text{prec}$$

$$\text{cond} - 2 \geq -8$$

$$\text{cond} \geq -8 + 2$$

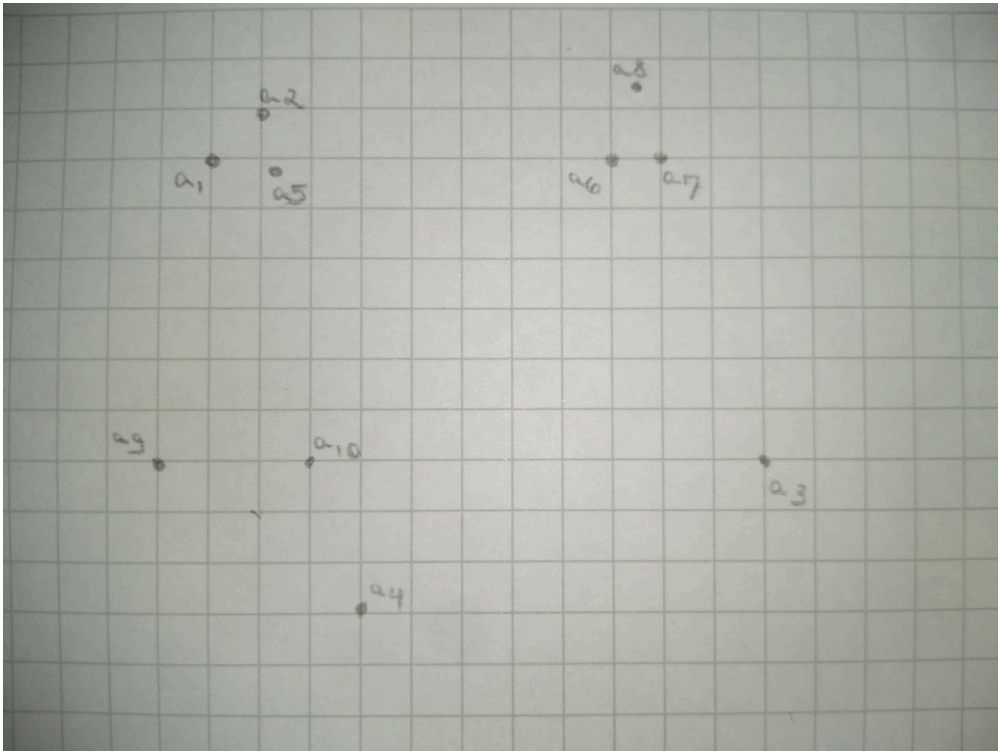
$$\text{cond} \geq -6$$

Se $\text{cond}(A) \geq 10^{-6}$, fica ruim.

Sala 7

Como os pontos a_1, \dots, a_{10} estão distribuídos em \mathbb{R}^2 , se o seu dendograma é:

TODO: incluir desenho



Sala 8

(Coeficiente de Rayleigh) Calcule:

$$\max_x \frac{x^T A x}{x^T x}$$

onde:

$$A \in \mathbb{R}^{n \times n}, \quad A = A^T \quad \text{e} \quad x \in \mathbb{R}^n$$

Derivando expressão interna de max em relação à x e igualando a 0 (para achar pontos críticos):

$$\begin{aligned} \frac{d}{dx} \frac{x^T A x}{x^T x} &= 0 \\ \frac{d}{dx} \left((x^T A x) \frac{1}{x^T x} \right) &= 0 \\ \left(2 A x \frac{1}{x^T x} \right) + \left((x^T A x) \frac{1}{(x^T x)^2} (-2 x) \right) &= 0 \\ \frac{2 (x^T x) A x - 2 (x^T A x) x}{(x^T x)^2} &= 0 \\ (x^T x) A x - (x^T A x) x &= 0 \\ ((x^T x) A - (x^T A x) I) x &= 0 \end{aligned}$$

(**Nota:** eu fiz mais um pouco mas parece que não chegou a lugar algum.)

Como $A = A^T$, temos os autovalores e seus autovetores associados, respectivamente, $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ e b_1, \dots, b_n , e também que para $0 < i, j \leq n$: se $i \neq j$, $b_i^T b_j = 0$ e se $i = j$, $b_i^T b_j = 1$. Com isso, podemos escrever x como combinação linear deles:

$$x = \sum_{i=0}^n c_i b_i \quad , \quad c_i \in \mathbb{R}$$

Dessa forma:

$$\begin{aligned} & \left(\left(\left(\sum_{i=0}^n c_i b_i \right)^T \left(\sum_{i=0}^n c_i b_i \right) \right) A - \left(\left(\sum_{i=0}^n c_i b_i \right)^T A \left(\sum_{i=0}^n c_i b_i \right) \right) I \right) \left(\sum_{i=0}^n c_i b_i \right) = 0 \\ & \left(\left(\sum_{i=0}^n \sum_{j=0}^n (c_i b_i)^T (c_j b_j) \right) A - \left(\left(\sum_{i=0}^n c_i b_i \right)^T \left(\sum_{i=0}^n \lambda_i c_i b_i \right) \right) I \right) \left(\sum_{i=0}^n c_i b_i \right) = 0 \\ & \left(\left(\sum_{i=0}^n \sum_{j=0}^n c_i c_j b_i^T b_j \right) A - \left(\sum_{i=0}^n \sum_{j=0}^n (c_i b_i)^T (\lambda_j c_j b_j) \right) I \right) \left(\sum_{i=0}^n c_i b_i \right) = 0 \\ & \left(\left(\sum_{i=0}^n c_i^2 \right) A - \left(\sum_{i=0}^n \sum_{j=0}^n c_i \lambda_j c_j b_i^T b_j \right) I \right) \left(\sum_{i=0}^n c_i b_i \right) = 0 \\ & \left(\left(\sum_{i=0}^n c_i^2 \right) A - \left(\sum_{i=0}^n \lambda_i c_i^2 \right) I \right) \left(\sum_{i=0}^n c_i b_i \right) = 0 \\ & \left(\sum_{i=0}^n c_i^2 \right) A \left(\sum_{i=0}^n c_i b_i \right) - \left(\sum_{i=0}^n \lambda_i c_i^2 \right) I \left(\sum_{i=0}^n c_i b_i \right) = 0 \\ & \left(\sum_{i=0}^n c_i^2 \right) \left(\sum_{i=0}^n \lambda_i c_i b_i \right) - \left(\sum_{i=0}^n \lambda_i c_i^2 \right) \left(\sum_{i=0}^n c_i b_i \right) = 0 \\ & \left(\sum_{i=0}^n c_i^2 \right) \left(\sum_{i=0}^n \lambda_i c_i b_i \right) = \left(\sum_{i=0}^n \lambda_i c_i^2 \right) \left(\sum_{i=0}^n c_i b_i \right) \end{aligned}$$

Lista 1

Num país politicamente instável, 30% dos defensores da república passam a apoiar a monarquia a cada ano e 20% dos defensores da monarquia passam a apoiar a república a cada ano. Portanto, denotando por r_k e m_k o número de republicanos e monarquistas, respectivamente, no ano k .

- Qual é o código para calcular r_k e m_k ?
- Sabendo que hoje metade da população apoia a república, em 10 anos qual será o percentual que apoia a república?

(c) A longo prazo qual será o percentual de republicanos e monarquistas?

(a) Sendo

$$A = \frac{1}{10} \begin{bmatrix} 7 & 2 \\ 3 & 8 \end{bmatrix}$$

temos que

$$\begin{bmatrix} r_k \\ m_k \end{bmatrix} = A^k \begin{bmatrix} r_0 \\ m_0 \end{bmatrix}$$

(b)

$$\begin{bmatrix} r_0 \\ m_0 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} 0.5 \\ 0.5 \end{bmatrix} \quad \text{e} \quad k = 10$$

Jogando no J:

```
(2 2 $ 0.7 0.2 0.3 0.8) (+/ . *)^:10 (2 $ 0.5 0.5)
0.400098 0.599902
```

Então após 10 anos teremos aproximadamente 40% da população apoiando a república.

(c) No equilíbrio, teremos que:

$$\begin{aligned} \begin{bmatrix} r \\ m \end{bmatrix} &= A \begin{bmatrix} r \\ m \end{bmatrix} \\ \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} r \\ m \end{bmatrix} &= \frac{1}{10} \begin{bmatrix} 7 & 2 \\ 3 & 8 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} r \\ m \end{bmatrix} \\ 0 &= \frac{1}{10} \begin{bmatrix} 7 & 2 \\ 3 & 8 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} r \\ m \end{bmatrix} - \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} r \\ m \end{bmatrix} \\ 0 &= \frac{1}{10} \begin{bmatrix} 7 & 2 \\ 3 & 8 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} r \\ m \end{bmatrix} - \frac{1}{10} \begin{bmatrix} 10 & 0 \\ 0 & 10 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} r \\ m \end{bmatrix} \\ 0 &= \frac{1}{10} \left(\begin{bmatrix} 7 & 2 \\ 3 & 8 \end{bmatrix} - \begin{bmatrix} 10 & 0 \\ 0 & 10 \end{bmatrix} \right) \begin{bmatrix} r \\ m \end{bmatrix} \\ 0 &= \frac{1}{10} \begin{bmatrix} -3 & 2 \\ 3 & -2 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} r \\ m \end{bmatrix} \\ 0 &= \begin{bmatrix} -3 & 2 \\ 3 & -2 \end{bmatrix} \begin{bmatrix} r \\ m \end{bmatrix} \\ \begin{cases} -3r + 2m &= 0 \\ 3r - 2m &= 0 \end{cases} \\ 3r - 2m &= 0 \\ 3r &= 2m \\ r &= \frac{2}{3}m \end{aligned}$$

Usando que $r + m = 1$:

$$\begin{aligned} r + m &= 1 \\ \frac{2}{3}m + m &= 1 \\ 2m + 3m &= 3 \\ 5m &= 3 \\ m &= \frac{3}{5} = \frac{6}{10} = 60\% \\ r &= \frac{2}{5} = \frac{4}{10} = 40\% \end{aligned}$$

Jogando no J (_ é infinito):

$$\begin{pmatrix} 2 & 2 & \$ & 0.7 & 0.2 & 0.3 & 0.8 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} +/ & . & * \end{pmatrix}^{\wedge} : _ \begin{pmatrix} 2 & \$ & 0.5 & 0.5 \end{pmatrix} \\ 0.4 & 0.6 \end{pmatrix}$$

Lista 2

Sequência de Fibonacci.

A sequência de Fibonacci é definida pelas fórmulas:

$$\begin{aligned} F_0 &= 0 \\ F_1 &= 1 \\ F_{t+1} &= F_t + F_{t-1} \end{aligned}$$

Os 13 primeiros números da sequência são 0, 1, 1, 2, 3, 5, 6, 13, 21, 34, 55, 89, 144. Esta famosa sequência tem uma profunda conexão com o número irracional ϕ , conhecido como Proporção Áurea. Esta proporção possui a seguinte propriedade geométrica:

TODO: *incluir desenho*

$$\frac{a}{b} = \phi = \frac{a+b}{a}$$

(a) Seja

$$v = \begin{bmatrix} F_t \\ F_{t+1} \end{bmatrix}$$

um vetor cuja primeira coordenada é um elemento da sequência e a segunda coordenada é o elemento seguinte. Determine qual é a matriz A que avança o vetor v ao longo da sequência, ou seja,

$$A v = A \begin{bmatrix} F_t \\ F_{t+1} \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} F_{t+1} \\ F_{t+2} \end{bmatrix}$$

- (b) Determine os autovetores e autovalores da matriz A . Sabendo que o resultado da aplicação repetida de uma transformação linear tende ao autovetor de maior autovalor associado daquela transformação (*Método da Potência*), escreva em Português o que os autovetores e autovalores nos dizem sobre a Sequência de Fibonacci e sua relação com a Proporção Áurea.
- (c) Dada a lista de números da Sequência de Fibonacci acima, confira se as conclusões às quais você chegou no item anterior se verificam.

(a)

$$A = \begin{bmatrix} 0 & 1 \\ 1 & 1 \end{bmatrix}$$

(b) Seja p um autovetor de A :

$$\begin{aligned} \lambda p &= A p \\ 0 &= A p - \lambda p \\ 0 &= (A - \lambda I) p \\ 0 &= \left(\begin{bmatrix} 0 & 1 \\ 1 & 1 \end{bmatrix} - \lambda \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix} \right) p \\ 0 &= \begin{bmatrix} -\lambda & 1 \\ 1 & 1-\lambda \end{bmatrix} p \\ \begin{cases} -\lambda a + b &= 0 \\ a + (1-\lambda) b &= 0 \end{cases} \\ 0 &= b + \lambda (1-\lambda) b \\ 0 &= (1 + \lambda (1-\lambda)) b \\ 0 &= (1 + \lambda - \lambda^2) b \\ 0 &= 1 + \lambda - \lambda^2 \\ \lambda &= \frac{-1 \pm \sqrt{1 - 4(-1)1}}{-2} \\ \lambda &= \frac{1 \pm \sqrt{5}}{2} \end{aligned}$$

Os autovetores são:

$$p_+ = x \begin{bmatrix} 1 \\ \frac{1+\sqrt{5}}{2} \end{bmatrix} \quad \text{e} \quad p_- = x \begin{bmatrix} 1 \\ \frac{1-\sqrt{5}}{2} \end{bmatrix}$$

onde $x \in \mathbb{R}$.

Quanto mais se aplica A a um v arbitrário, mais próximo se chega ao p_+ (*Método da Potência*). Pela construção de A , temos que:

$$\begin{bmatrix} F_{t+1} \\ F_t + F_{t+1} \end{bmatrix} = A \begin{bmatrix} F_t \\ F_{t+1} \end{bmatrix}$$

e eventualmente (após aplicar várias vezes) vamos chegar à:

$$\begin{aligned} \begin{bmatrix} F_{t+1} \\ F_t + F_{t+1} \end{bmatrix} &= \lambda_+ \begin{bmatrix} F_t \\ F_{t+1} \end{bmatrix} \\ \begin{cases} \lambda F_t &= F_{t+1} \\ \lambda F_{t+1} &= F_t + F_{t+1} \end{cases} \\ \begin{cases} \lambda &= \frac{F_{t+1}}{F_t} \\ \lambda &= \frac{F_t + F_{t+1}}{F_{t+1}} \end{cases} \\ \lambda &= \frac{F_{t+1}}{F_t} = \frac{F_t + F_{t+1}}{F_{t+1}} \\ \lambda &= \frac{a}{b} = \frac{b+a}{a} \end{aligned}$$

Em outras palavras, a Sequência de Fibonacci calcula valores que aproximam a Proporção Áurea; λ_+ é a própria Proporção.

(c) Usando J:

```
((J. (% ,. [ % +) J:)) 0 1 1 2 3 5 8 13 21 34 55 89 144
- 1
1 0.5
2 0.666667
1.5 0.6
1.66667 0.625
1.6 0.615385
1.625 0.619048
1.61538 0.617647
1.61905 0.618182
1.61765 0.617978
1.61818 0.618056
1.61798 0.618026
(1 + %: 5) % 2
1.61803
```

A primeira coluna representa $\frac{a}{b}$ e a segunda coluna representa $\frac{a+b}{a}$. Eles vão convergindo para o mesmo valor ($\lambda_+ = \frac{1+\sqrt{5}}{2} \approx 1.61803$).

Lista 3

População de bactérias.

A população de uma certa espécie de bactéria pode ser compreendida da seguinte maneira. Existem bactérias novas, maduras e velhas. A cada mês:

- (0) 80% das bactérias novas chegam à maturidade, e 20% morrem;
 - (1) 50% das bactérias maduras tornam-se velhas, e 50% morrem;
 - (2) 100% das bactérias velhas morrem;
 - (3) Uma a cada duas bactérias maduras geram uma nova bactéria;
 - (4) Uma a cada cinco bactérias velhas geram uma nova bactéria.
- (a) Modele o sistema populacional descrito acima – ou seja, determine o significado de cada coordenada do vetor que representa a população em um dado mês, e a matriz que representa a transição de um mês para o seguinte.

As coordenadas do vetor v representam, as bactérias novas v_n , as bactérias maduras v_m , as bactérias velhas v_v :

$$v = \begin{bmatrix} v_n \\ v_m \\ v_v \end{bmatrix}$$

A matrix de transição A é dada por

$$A = \frac{1}{100} \begin{bmatrix} 0 & 50 & 20 \\ 80 & 0 & 0 \\ 0 & 50 & 0 \end{bmatrix}$$

Lista 8

Sejam

$$x = \begin{bmatrix} 0 \\ 1 \end{bmatrix} \quad \text{e} \quad A = \begin{bmatrix} 2 & 1 \\ 1 & 2 \end{bmatrix}$$

Determine uma aproximação para $\frac{z_1}{z_2}$, tal que $z = A^{1\,000\,000} x$.

A razão $\frac{z_1}{z_2}$ pode ser aproximada pelo maior λ (*Método da Potência*). Seja p um autovetor de A :

$$\begin{aligned}
\lambda p &= A p \\
0 &= (A - \lambda I) p \\
0 &= A p - \lambda p \\
0 &= \left(\begin{bmatrix} 2 & 1 \\ 1 & 2 \end{bmatrix} - \lambda \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix} \right) p \\
0 &= \begin{bmatrix} 2-\lambda & 1 \\ 1 & 2-\lambda \end{bmatrix} p \\
\begin{cases} (2-\lambda) p_1 + p_2 &= 0 \\ p_1 + (2-\lambda) p_2 &= 0 \end{cases} \\
0 &= p_1 - (2-\lambda)^2 p_1 \\
0 &= (1 - (2-\lambda)^2) p_1 \\
0 &= (1 - 4 + 4\lambda - \lambda^2) p_1 \\
0 &= (-3 + 4\lambda - \lambda^2) p_1 \\
0 &= -3 + 4\lambda - \lambda^2 \\
\lambda &= \frac{-4 \pm \sqrt{16 - 4(-1)(-3)}}{-2} \\
\lambda &= \frac{4 \mp \sqrt{4}}{2} \\
\lambda &= \frac{4 \mp 2}{2} \\
\lambda &= 2 \mp 1 \\
\lambda &\in \{1, 3\}
\end{aligned}$$

Dessa forma:

$$p_+ = x \begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix} \quad \text{e} \quad p_- = x \begin{bmatrix} 1 \\ -1 \end{bmatrix}$$

onde $x \in \mathbb{R}$.

E a aproximação para $\frac{z_1}{z_2}$ é 1.