

---

# An example document

---

**Eingereicht von**

Kennart Loliwer

koliwer1@uni-bremen.de

**Gutachter:innen**

Prof. Dr. Anke Pohl  
Dr. Maxim Kirsebom

Fachbereich 3

Universität Bremen

WiSe 2025/26

1. Dezember 2025



# Inhaltsverzeichnis

<b>1 Einleitung</b>	<b>1</b>
<b>2 Definitionen</b>	<b>3</b>
<b>3 DMD</b>	<b>11</b>
3.1 Dynamic Mode Decomposition (DMD) [1] . . . . .	11
<b>4 Paper</b>	<b>13</b>
4.1 paper [3] . . . . .	13
4.2 Idee . . . . .	13
4.3 Setting . . . . .	14
<b>5 Marchenko-Pastur-Verteilung</b>	<b>15</b>
<b>6 BuchChapter3</b>	<b>21</b>
6.1 Marčenko-Pastur Gesetz für i.i.d . . . . .	21
<b>Literatur</b>	<b>25</b>
<b>Eigenständigkeits- und Einverständniserklärung</b>	<b>28</b>



# 1 Einleitung

In dieser Arbeit beschäftigen wir uns mit einer Möglichkeit den Rechenaufwand des Dynamic Mode Decomposition Algorithmus, kurz DMD, zu verringern. DMD ist ein Algorithmus, der ursprünglich im Feld der "Strömungsdynamik" entwickelt wurde. Er dient dazu anhand von Messdaten mehrerer Zeitpunkte die Dynamik eines Systems approximieren zu können. Im Laufe der letzten Jahre wurden eine Vielzahl von Varianten der DMD entwickelt. Wir begrenzen uns hier aber nur auf exact DMD. Diese Variante hat den Vorteil gegenüber des ursprünglichen DMD, dass die Messzeitpunkte keine einheitlichen Zeitabstände benötigen. Für jede Messung werden alle Daten der Messpunkte in eine Spalte unserer Datenmatrix  $X$  eingetragen. Tut man das gleiche nur um einen Zeitpunkt versetzt, hat man zwei Datenmatrizen, die zwei sich überlappende Zeitintervalle abdecken. Das Ziel ist von DMD ist es nun einen linearen Operator  $A$  zu finden, der das System  $X' = AX$  so gut wie möglich beschreit. Diesen Operator bestimmt man mittels Singulärwertzerlegung (SVD) unserer Datenmatrix  $X$ . Um für die folgenden schritte den Rechenaufwand zu minimieren, lohnt es sich eine Dimensionsreduktion durchzuführen.

**mmmmh hat noch formulierungsbedarf...** ( Dieser Vorgang ist auch unter ökonomischer SVD (TSVD) bekannt. Dabei führt man die SVD so weit durch bis die Singulärwerte 0 sind, da diese nichts über die Dynamik des Systems aussagen.)

Frage ob es sich noch weiter kürzen lässt.

Gavish Donoho: Ja

Messfehler und so.

Überleitung zu MP



## 2 Definitionen

In diesem Kapitel wird eine Grundlage für einheitliche und verständliche Notation geschaffen. Zudem werden einige Sätze und Definitionen eingeführt, die im weiteren Verlauf dieser Arbeit verwendet werden.

Die Elemente einer Matrix  $A$  werden mit  $a_{ij}$  bezeichnet. Dabei gibt  $i$  die Zeilen- und  $j$  die Spaltenposition des Elements an. Sei  $A \in \mathbb{K}^{n \times m}$ , dann hat  $A$  die Form

$$A = \begin{pmatrix} a_{11} & \cdots & a_{1m} \\ \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{n1} & \cdots & a_{nm} \end{pmatrix}. \quad (2.1)$$

Weiter bezeichnen wir  $A^\top$  als Transponierte und  $A^H$  als Adjungierte von  $A$ . Matrizen sind orthogonal bezüglich des standard Skalarproduktes. Das komplex konjugierte von  $a$  bezeichnen wir als  $\bar{a}$ .

**Definition 2.1** (Frobeniusnorm). Sei  $X \in \mathbb{C}^{n \times m}$  eine Matrix und  $x_{ij}$  mit  $i \in \{1, \dots, n\}$ ,  $j \in \{1, \dots, m\}$ . Die Frobeniusnorm ist definiert durch

$$\|X\|_F := \sqrt{\sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^m |x_{ij}|^2}.$$

**Lemma 2.2.** Sei  $X \in \mathbb{C}^{n \times m}$  eine Matrix. Dann gilt

$$\|X\|_F = \sqrt{\text{tr}(X^H X)}.$$

*Beweis.* Sei  $x_i$  ein Spaltenvektor von  $X$ . Dann ist

$$\begin{aligned} X^H X &= \begin{pmatrix} - & x_1^H & - \\ & \vdots & \\ - & x_m^H & - \end{pmatrix} \begin{pmatrix} | & & | \\ x_1 & \dots & x_m \\ | & & | \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} \sum_{j=1}^n x_{1j}^H x_{1j} & * & \\ & \ddots & \\ * & \sum_{j=1}^n x_{mj}^H x_{mj} & \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \sum_{j=1}^n \bar{x}_{1j} x_{1j} & * & \\ & \ddots & \\ * & \sum_{j=1}^n \bar{x}_{mj} x_{mj} & \end{pmatrix}. \end{aligned}$$

Mit  $\bar{x}x = |x|^2$  erhalten wir

$$\text{tr}(X^H X) = \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^n \bar{x}_{ij} x_{ij} = \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^n |x_{ij}|^2 = \|X\|_F^2. \quad (2.2)$$

□

Die Frobeniusnorm wird im weiteren Verlauf aufgrund ihrer Invarianz bezüglich unitärer Transformation verwendet, welche wir durch folgendes Lemma zeigen.

**Lemma 2.3.** Sei  $X \in \mathbb{C}^{n \times m}$  eine Matrix und  $U \in \mathbb{C}^{n \times n}$  und  $V \in \mathbb{C}^{m \times m}$  unitäre Matrizen. Dann gilt

1.  $\|X\|_F = \|X^H\|_F,$
2.  $\|UX\|_F = \|X\|_F,$
3.  $\|XV\|_F = \|X\|_F.$

*Beweis.*

1. Aus Gleichung (2.2) folgt

$$\|X\|_F^2 = \text{tr}(X^H X) = \sum_{i=1}^m \sum_{j=1}^n \bar{x}_{ij} x_{ij} = \sum_{j=1}^n \sum_{i=1}^m \bar{x}_{ij} x_{ij} = \text{tr}(XX^H) = \|X^H\|_F^2.$$

2. Es ist

$$\|UX\|_F^2 = \text{tr}(X^H U^H UX) = \text{tr}(X^H \mathbf{1} X) = \text{tr}(X^H X) = \|X\|_F^2.$$

3. Mit 1. und 2. folgt

$$\|XV\|_F = \|V^H X^H\|_F = \|X^H\|_F = \|X\|_F.$$

□

**Satz 2.4** (Singulärwertzerlegung [4]). Sei  $X \in \mathbb{R}^{n \times m}$  eine Matrix und  $r := \text{rang } X$  mit  $r \leq \min(n, m)$ . Dann existieren orthogonale Matrizen  $U \in \mathbb{R}^{n \times n}$  und  $V \in \mathbb{R}^{m \times m}$  und eine Diagonalmatrix  $\hat{\Sigma} = \text{diag}(\sigma_1, \dots, \sigma_r) \in \mathbb{R}^{r \times r}$  mit  $\sigma_1 \geq \sigma_2 \geq \dots \geq \sigma_r > 0$  so, dass

$$X = U\Sigma V^\top \text{ mit } \Sigma = \begin{pmatrix} \hat{\Sigma} & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{n \times m}$$

gilt.

Der Beweis des Satzes 2.4 folgt etwas später, da dafür noch etwas Vorbereitung benötigt wird.

**Bemerkung 2.5.** Unter den in Satz 2.4 genannten Voraussetzungen, ist  $\hat{\Sigma}$  durch  $X$  eindeutig bestimmt. Die beiden orthogonalen Matrizen  $U$  und  $V$  hingegen sind nicht eindeutig.

**Lemma 2.6.** Sei  $X \in \mathbb{R}^{n \times m}$  und  $\lambda_i$  die Eigenwerte von  $X^\top X$ . Dann gilt für die Singulärwerte unter den Voraussetzungen aus Satz 2.4

$$\sigma_i = \sqrt{\lambda_i}.$$

*Beweis.* Durch

$$\begin{aligned} X^\top X &= (U\Sigma V^\top)^\top (U\Sigma V^\top) \\ &= V\Sigma^\top U^\top U\Sigma V^\top \\ &= V\Sigma^\top \Sigma V^\top \end{aligned}$$

ist  $X^\top X$  ähnlich zu  $\Sigma^\top \Sigma$ . Also haben  $X^\top X$  und  $\Sigma^\top \Sigma$  auch die gleichen Eigenwerte. □

**Definition 2.7.** Die Diagonalelemente von  $\hat{\Sigma}$  aus Satz 2.4, wobei  $\sigma_i = \sqrt{\lambda_i}$  sind die Wurzeln der Eigenwerte von  $X^\top X$  und werden als Singulärwerte bezeichnet.

**Definition 2.8.** Wir bezeichnen bei der Singulärwertzerlegung die Spaltenvektoren  $u_i$  mit  $i = 1, \dots, n$  von  $U$  als Links-Singulärvektoren und die Spaltenvektoren  $v_i$  mit  $i = 1, \dots, m$  von  $V$  als Rechts-Singulärvektoren. **Lasse ich erstmal drinnen, für den Fall, dass ich diese Begriffe später noch verwenden werde**

**Bemerkung 2.9.** Die aus der Singulärwertzerlegung in 2.4 entstehenden Singulärwerte sind invariant bezüglich Transposition vom  $X$ .

*Beweis.* Seien die Voraussetzungen aus Satz 2.4 gegeben, dann gilt

$$X^\top = (U\Sigma V^\top)^\top = V\Sigma^\top U^\top.$$

Da die Singulärwerte in  $\Sigma$  auf der Diagonalen liegen, erhalten wir

$$X^\top = V\Sigma U^\top.$$

□

**Lemma 2.10** ([4, S. 191]). Sei  $X \in \mathbb{R}^{n \times n}$  eine symmetrische Matrix. Dann existiert eine orthogonale Matrix  $U \in \mathbb{R}^{n \times n}$  und eine Diagonalmatrix  $D \in \mathbb{R}^{n \times n}$  so, dass

$$U^\top X U = D$$

gilt.

**Lemma 2.11** ([4, S. 227]). Sei  $X \in \mathbb{R}^{n \times m}$  eine Matrix mit  $\text{rang } X = r < \min(n, m)$ . Dann existieren orthogonale Matrizen  $U \in \mathbb{R}^{n \times n}$  und  $V \in \mathbb{R}^{m \times m}$  sowie eine reguläre obere Dreiecksmatrix  $\hat{R} \in \mathbb{R}^{r \times r}$  so, dass

$$U^\top X V = R \text{ mit } R = \begin{pmatrix} \hat{R} & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{n \times m}$$

gilt.

*Beweis Satz 2.4.* Nach Bemerkung 2.9 nehmen wir o.B.d.A an, dass  $m \leq n$  gilt. Zunächst betrachten wir den Fall des vollen Ranges von  $X$ , also  $\text{rang } X = r = m$ . Bei vollem Rang ist  $X^\top X \in \mathbb{R}^{m \times m}$  sowohl symmetrisch als auch positiv definit. Die Eigenwerte  $\lambda_i$  von  $X^\top X$  sortieren wir nach ihrer Größe, also

$$\lambda_1 \geq \lambda_2 \geq \dots \geq \lambda_m > 0.$$

Mit Lemma 2.10 finden wir ein orthogonales  $V \in \mathbb{R}^{m \times m}$ , sodass

$$V^\top X^\top X V = D = \text{diag}\{\lambda_1, \dots, \lambda_m\} \in \mathbb{R}^{m \times m}.$$

Weiter definieren wir

$$\hat{\Sigma} := \text{diag}\{\sigma_1, \dots, \sigma_m\}$$

mit  $\sigma_i := \sqrt{\lambda_i} \in (0, \infty]$ , für  $i = 1, \dots, m$ , und setzen

$$\hat{U} := X V \hat{\Sigma}^{-1} \in \mathbb{R}^{n \times m}.$$

Jetzt kann man durch Umformung von

$$\begin{aligned}\hat{U}^\top \hat{U} &= \hat{\Sigma}^{-\top} V^\top X^\top X V \hat{\Sigma}^{-1} \\ &= \hat{\Sigma}^{-1} D \hat{\Sigma}^{-1} \\ &= \hat{\Sigma}^{-1} \hat{\Sigma}^{-1} D \\ &= D^{-1} D \\ &= \mathbb{1}\end{aligned}$$

die Orthonormalität der Spalten von  $\hat{U}$  sehen.

Da  $\hat{U}$  in  $\mathbb{R}^{n \times m}$  mit  $m < n$  liegt und aus orthonormalen Spaltenvektoren besteht, finden wir ein  $Z \in \mathbb{R}^{n \times (n-m)}$ , welches  $\hat{U}$  so um  $n - m$  orthonormale Spaltenvektoren ergänzt, dass

$$U = (\hat{U} \ Z) \in \mathbb{R}^{n \times n}$$

eine orthogonale Matrix ist. Es gilt also

$$\begin{aligned}Z^\top X V \hat{\Sigma}^{-1} &= Z^\top \hat{U} \\ &= 0 \in \mathbb{R}^{(n-m) \times n}.\end{aligned}$$

Da  $\hat{\Sigma} \hat{\Sigma}^{-1} = \mathbb{1}$  ist, folgt auch direkt

$$Z^\top X V = 0.$$

Zusammengetragen haben wir dann

$$\begin{aligned} U^\top XV &= \begin{pmatrix} \hat{U}^\top \\ Z^\top \end{pmatrix} XV = \begin{pmatrix} \hat{\Sigma}^{-1}V^\top X^T XV \\ Z^\top XV \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} \hat{\Sigma}^{-1}D \\ 0 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} \hat{\Sigma} \\ 0 \end{pmatrix}, \end{aligned}$$

womit wir den Fall des vollen Ranges bewiesen hätten.

Seien  $\lambda_i$  wie oben definiert wieder die Eigenwerte von  $X^\top X$  und sei  $X_r \in \mathbb{R}^{n \times m}$  eine Matrix mit  $\text{rang } X_r = r < m$ . Nach Lemma 2.11 gibt es zwei orthogonale Matrizen  $\tilde{U} \in \mathbb{R}^{n \times n}$  und  $\tilde{V} \in \mathbb{R}^{m \times m}$ , sowie eine obere Dreiecksmatrix  $\hat{R} \in \mathbb{R}^{r \times r}$ , sodass

$$\tilde{U}^\top X_r \tilde{V} = R \text{ mit } R = \begin{pmatrix} \hat{R} & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{n \times m}$$

gilt. Nach obigem Fall mit vollem Rang, wissen wir, dass es orthogonale Matrizen  $U_r \in \mathbb{R}^{n \times n}$  und  $V_r \in \mathbb{R}^{r \times r}$ , sodass

$$U_r^\top \begin{pmatrix} \hat{R} \\ 0 \end{pmatrix} V_r = \begin{pmatrix} \hat{\Sigma}_r \\ 0 \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{n \times r}.$$

Dabei ist  $\hat{\Sigma}_r := \text{diag}\{\sigma_1, \dots, \sigma_r\}$  mit  $\sigma_i = \sqrt{\lambda_i}$ . Im Folgenden erweitern wir

$$\begin{pmatrix} \hat{\Sigma}_r \\ 0 \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{n \times r} \quad \text{zu} \quad \begin{pmatrix} \hat{\Sigma}_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} = \Sigma \in \mathbb{R}^{n \times m}$$

und finden eine orthogonale Fortsetzung für  $V_r$  zu

$$\bar{V}_r = \begin{pmatrix} V_r & 0 \\ 0 & \mathbb{1} \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{m \times m}.$$

Wenn wir uns jetzt die orthogonalen Matrizen

$$U := \tilde{U}U_r \in \mathbb{R}^{n \times n} \quad \text{und} \quad V := \tilde{V}\bar{V}_r \in \mathbb{R}^{n \times m}$$

definieren, erhalten wir durch

$$\begin{aligned}
U^\top X_r V &= U_r^\top \tilde{U} X_r \tilde{V} \bar{V}_r \\
&= U_r^\top \begin{pmatrix} \hat{R} & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \bar{V}_r \\
&= \begin{pmatrix} \hat{\Sigma}_r & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} =: \Sigma
\end{aligned}$$

eine erfolgreiche Zerlegung von  $X_r$  durch orthogonale Matrizen.  $\square$

**Satz 2.12** (Moore-Penrose-Inverse [4]). Sei  $X \in \mathbb{R}^{n \times m}$  eine Matrix und  $U, \hat{\Sigma}$  und  $V$  die Matrizen aus der Singulärwertzerlegung in Satz 2.4. Dann existiert genau eine Moore-Penrose-Inverse der Form

$$X^\dagger = V \begin{pmatrix} \hat{\Sigma}^{-1} & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} U^\top \in \mathbb{R}^{m \times n}.$$

**Definition 2.13** ( $\arg \min$ ). Sei  $f: X \rightarrow \mathbb{R}$  eine Funktion. Dann ist die Menge  $\arg \min$  definiert durch

$$\arg \min_{x \in X} f(x) := \{x \in X \mid f(x) \text{ ist minimal}\}.$$

**Definition 2.14** (Erwartungswert). lala

**Definition 2.15** (Varianz). lalala

**Definition 2.16** (Wahrscheinlichkeitsraum). lalalala

**Definition 2.17** (Wahrscheinlichkeitsmaß). lalalalala

**Definition 2.18** (Verteilungsfunktion). lalalalalala



## 3 DMD

### 3.1 Dynamic Mode Decomposition (DMD) [1]

Sei nun  $X \in \mathbb{R}^{n \times m}$  der Zustand des Systems zu  $m$  diskreten Zeitpunkten  $t_k = k\Delta t$  mit  $k \in \mathbb{N}$  also

$$X = \begin{pmatrix} | & | & & | \\ x(t_1) & x(t_2) & \dots & x(t_m) \\ | & | & & | \end{pmatrix}$$

und  $X' \in \mathbb{R}^{n \times m}$  der Zustand mit jedem Punkt einen Zeitschritt weiter mit  $t'_k = t_k + \Delta t$

$$X' = \begin{pmatrix} | & | & & | \\ x(t'_1) & x(t'_2) & \dots & x(t'_m) \\ | & | & & | \end{pmatrix}$$

dann versuchen wir die Matrix  $A$  zu finden, der dieses System beschreiben kann und wir mit möglichst geringem Fehler

$$X' \approx AX$$

bestimmen können. Ein ideales  $A$  finden wir durch

$$A = \arg \min_A \|X' - AX\|_F = X'X^\dagger$$

mit  $X^\dagger$  als Pseudoinversen von  $X$ . Dabei sind die hier betrachteten Pseudoinversen alle Moore-Penrose-Inverse. Um die zu bestimmen, machen wir eine Singulärwertzerlegung von  $X$ . Damit erhalten wir wie in 2.4 und 2.12

$$X = U\Sigma V^\top = U \begin{pmatrix} \hat{\Sigma} & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} V^\top$$

und

$$X^\dagger = V \begin{pmatrix} \hat{\Sigma}^{-1} & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} U^\top$$

so, dass  $XX^\dagger = \mathbb{1}$  ergibt. Da wir aber häufig mit sehr großen Matrizen arbeiten, liegt es nahe zu versuchen die Dimensionen weitgehend zu reduzieren. **Motivation für Paper.** Haben wir ein passendes  $r \leq m$  zum Reduzieren gefunden, erhalten wir

$$X \approx U_r \Sigma_r V_r^\top$$

und

$$X^\dagger \approx V_r \Sigma_r^{-1} U_r^\top.$$

Dabei sind  $U_r \in \mathbb{R}^{n \times r}$ ,  $\Sigma_r \in \mathbb{R}^{r \times r}$  und  $V_r \in \mathbb{R}^{m \times r}$ .

$A$  würde man also mit

$$A \approx X' X^\dagger \approx X' V_r \Sigma_r^{-1} U_r^\top \tag{3.1}$$

näher approximieren können. Da wir aber nicht an ganz  $A$  interessiert sind, sondern nur die ersten  $r$  Eigenwerte, Projizieren wir  $A$  auf **die POD modes von  $U$** .

- DMD mode ist eigenvektor von  $A$
-

# 4 Paper

Dieses Kapitel ist noch seeeeehr work in progress also ich hab erstmal grob Gedanken aufgeschrieben.

## 4.1 paper [3]

### 4.2 Idee

Wir betrachten die gemessene Datenmatrix

$$X = X^{\text{true}} + \gamma X^{\text{noise}} \quad (4.1)$$

mit  $X \in \mathbb{R}^{n \times m}$ ,  $X^{\text{true}}$  als *echte* Datenmatrix und *approximately of low rank* und  $X^{\text{noise}}$  als Messfehlermatrix welche Unabhängig und identisch verteilte Zufallsvariablen enthält *vielleicht noch definieren*.

Hier benutzen wir die *truncated* Singulärwertzerlegung also

$$X = \sum_{i=1}^n \sigma_i u_i v_i' . \quad (4.2)$$

Schätzen kann man die *truncation* jetzt mit

$$\hat{X}_r = \sum_{i=1}^r \sigma_i u_i v_i' . \quad (4.3)$$

mit  $r = \text{rang}(X^{\text{true}})$  und den Singulärwerten wieder nach Größe absteigend sortiert.

Da aber der Rang von  $X^{\text{true}}$  nicht unbedingt bekannt ist kann man versuchen, anhand der Größe, der Singulärwerte zu Kürzen. Dafür bauen wir mithilfe einer Indikatorfunktion

$\eta_H(\sigma_i; \tau) = \sigma \chi_{\{\sigma \geq \tau\}}$  die gekürzte Matrix

$$\hat{X}_\tau = \sum_{i=1}^r \eta_H(\sigma_i; \tau) u_i v_i' . \quad (4.4)$$

Jetzt gilt es aber herauszufinden wie wir dieses  $\tau$  wählen damit wir immernoch sinnvolle Ergebnisse erhalten, aber gleichzeitig zu viel rechenaufwand spaaren wie möglich.

### 4.3 Setting

**Definition 4.1** (denoiser). Ein *Denoiser* reduziert eine Matrix auf nur noch *relevante* Ränge mit der Form

$$\hat{X}: \sum_{i=1}^n \sigma_i u_i v_i' \rightarrow \sum_{i=1}^n \eta(\sigma_i; \lambda) u_i v_i' \quad (4.5)$$

**Definition 4.2** (Mean Square Error (MSE)). Mit dem MSE wird der Fehler der beim *denoising* Prozess entsteht, durch

$$\left\| \hat{X}(X) - X^{\text{true}} \right\|_F^2 = \sum_{i,j} \left( \hat{X}(X)_{i,j} - X_{i,j}^{\text{true}} \right)^2 \quad (4.6)$$

quantifiziert.

Wir betrachten eine Folge an denoising Problemen, die immer größer werden.

$$X_k = X_k^{\text{true}} + \gamma X_k^{\text{noise}} \quad (4.7)$$

mit  $X_k^{\text{true}}, X_k^{\text{noise}} \in M_{n_k, m}$ .

Jedes  $X_k^{\text{noise}}$  erfüllt die Eigenschaften von  $X^{\text{noise}}$ . Gegeben sei ein fixer Vektor  $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^r$ , mit  $r > 0$ , den Einträgen  $\mathbf{x} = (x_1, \dots, x_r)$  und  $x_i \geq x_{i+1} > 0$ . Für alle  $k$  gilt

$$X_k^{\text{true}} = U_k \text{diag}(x_1, \dots, x_r, 0, \dots, 0) V_k' . \quad (4.8)$$

**Definition 4.3** (Asymptotic Mean Square Error (AMSE)). lalala

## 5 Marchenko-Pastur-Verteilung

**Lemma 5.1.** Sei  $\beta \in (0, 1]$  und  $\beta_{\pm} = (1 \pm \sqrt{\beta})^2$ . Dann gilt

$$\beta_+ - \beta_- = 4\sqrt{\beta} \quad (5.1)$$

$$\beta_+ + \beta_- = 2\beta + 2 \quad (5.2)$$

$$\beta_+\beta_- = (\beta - 1)^2 \quad (5.3)$$

$$m = \beta + 1 \quad (5.4)$$

$$r = 4\sqrt{\beta} \quad (5.5)$$

Beweis, dass die Lösung der Marchenko Pastur Verteilung mit  $\beta_- \leq \mu_\beta \leq \beta_+$  und  $\beta_{\pm} = (1 \pm \sqrt{\beta})^2$  also

$$\int_{\beta_-}^{\mu_\beta} \frac{\sqrt{(\beta_+ - t)(t - \beta_-)}}{2\pi\beta t} dt = \frac{1}{2} \quad (5.6)$$

ergeben kann.

Umgangssprache ist überall :(. Definitionen und Sätze aufschreiben. Und aus den align Umgebungen vielleicht noch die Label auf ein angenehmes Minimum reduzieren.

*Beweis.* Da das Integral mit  $\mu_\beta = \beta_-$  gleich 0 ist und das Integral stetig innerhalb des Intervalls  $[\beta_-, \beta_+]$  ist, müssen wir nur noch zeigen, dass das Integral bei  $\mu_\beta = \beta_+$  gleich 1 ist, damit wir den Zwischenwertsatz nutzen können. Dafür bietet sich an, das Integral

$$\frac{1}{2\pi\beta} \int_{\beta_-}^{\beta_+} \frac{\sqrt{(\beta_+ - t)(t - \beta_-)}}{t} dt \quad (5.7)$$

mit  $\mu_\beta = \beta_+$  auszurechnen. Wir beginnen damit eine Substitution zu finden. Dafür bauen wir uns also einen Weg  $\delta$ , der von  $\beta_-$  zu  $\beta_+$  läuft. Sei  $m = \frac{\beta_+ + \beta_-}{2}$  der Mittelpunkt zwischen  $\beta_-$  und  $\beta_+$  und  $r = \frac{\beta_+ - \beta_-}{2}$  der Abstand von Mittelpunkt zu den Grenzen, dann brauchen wir nur noch eine Funktion, die von  $-1$  bis  $1$  läuft, damit wir den Weg von einer Grenze zur anderen ablaufen. Dafür eignet sich der Cosinus von  $-\pi$  bis  $0$ . Da dieser aber eine gerade Funktion ist, können wir auch von  $0$  bis  $\pi$  gehen.

Damit erhalten wir

$$\delta: [0, \pi] \rightarrow \mathbb{R} \quad (5.8)$$

$$\varphi \mapsto m + r \cos(\varphi). \quad (5.9)$$

Da  $\delta$  injektiv und stetig differenzierbar ist, substituieren wir  $t$  mit  $\delta$  und erhalten

$$-\frac{1}{2\pi\beta} \int_{\pi}^0 \frac{\sqrt{(\beta_+ - (m + r \cos(\varphi)))((m + r \cos(\varphi)) - \beta_-)}}{m + r \cos(\varphi)} r \sin(\varphi) d\varphi$$

setzen wir  $\beta_+ = m + r$  und  $\beta_- = m - r$

$$\begin{aligned} &= -\frac{1}{2\pi\beta} \int_{\pi}^0 \frac{\sqrt{((m+r) - (m+r \cos(\varphi)))((m+r \cos(\varphi)) - (m-r))}}{m+r \cos(\varphi)} r \sin(\varphi) d\varphi \\ &= -\frac{1}{2\pi\beta} \int_{\pi}^0 \frac{\sqrt{(r - r \cos(\varphi))(r + r \cos(\varphi))}}{m+r \cos(\varphi)} r \sin(\varphi) d\varphi \\ &= -\frac{1}{2\pi\beta} \int_{\pi}^0 \frac{\sqrt{(r^2 - r^2 \cos^2(\varphi))}}{m+r \cos(\varphi)} r \sin(\varphi) d\varphi \\ &= -\frac{1}{2\pi\beta} \int_{\pi}^0 \frac{(r - r \cos(\varphi))}{m+r \cos(\varphi)} r \sin(\varphi) d\varphi \\ &= -\frac{1}{2\pi\beta} \int_{\pi}^0 \frac{r^2 \sin^2(\varphi)}{m+r \cos(\varphi)} d\varphi \end{aligned}$$

Nutzen wir hier Lemma 5.1, erhalten wir

$$\begin{aligned} &= -\frac{1}{2\pi\beta} \int_{\pi}^0 \frac{4\beta \sin^2(\varphi)}{\beta + 1 + 2\sqrt{\beta} \cos(\varphi)} d\varphi \\ &= \frac{1}{2\pi\beta} \int_0^{\pi} \frac{4\beta \sin^2(\varphi)}{\beta + 1 + 2\sqrt{\beta} \cos(\varphi)} d\varphi. \end{aligned}$$

Ab hier müssen wir eine Fallunterscheidung vornehmen.

Fall 1:  $\beta = 1$ .

$$\frac{1}{2\pi} \int_0^\pi \frac{4 \sin^2(\varphi)}{2 + 2 \cos(\varphi)} d\varphi \quad (5.10)$$

$$= \frac{1}{2\pi} \int_0^\pi \frac{2^2 - 2^2 \cos^2(\varphi)}{2 + 2 \cos(\varphi)} d\varphi \quad (5.11)$$

$$= \frac{1}{2\pi} \int_0^\pi \frac{(2 - 2 \cos(\varphi))(2 + 2 \cos(\varphi))}{2 + 2 \cos(\varphi)} d\varphi \quad (5.12)$$

$$= \frac{1}{\pi} \int_0^\pi 1 - \cos(\varphi) d\varphi \quad (5.13)$$

$$= 1. \quad (5.14)$$

Fall 2:  $\beta \in (0, 1)$ . **hier noch eine Motivation finden den Residuensatz nutzen zu wollen**  
Bei genauerer Betrachtung des Integranten, nennen wir ihn  $f$ , kann man erkennen, dass man ihn in zwei Teile separieren kann, genau

$$f(\varphi) = a \cdot \sin^2(\varphi) \quad \text{mit} \quad a = \frac{1}{m + r \cos(\varphi)}. \quad (5.15)$$

Da der Cosinus  $2\pi$ -periodisch ist und  $m$  und  $r$  konstant sind, ist auch  $a$   $2\pi$ -periodisch und spiegelt sich an  $\varphi = \pi$ .  $\sin^2(\varphi)$  hingegen ist  $\pi$ -periodisch. Daraus erkennen wir in  $f$  eine  $2\pi$ -Periodizität mit einer Symmetrie um  $\pi$ . Wir können das Integral also von 0 bis  $2\pi$  laufen lassen und dann halbieren. Wir haben also jetzt

$$\frac{1}{\pi} \int_0^{2\pi} \frac{\sin^2(\varphi)}{\beta + 1 + 2\sqrt{\beta} \cos(\varphi)} d\varphi \quad (5.16)$$

Sei nun  $z = Re^{i\varphi}$ ,  $\cos(\varphi) = \frac{e^{i\varphi} + e^{-i\varphi}}{2}$  und  $\sin(\varphi) = \frac{e^{i\varphi} - e^{-i\varphi}}{2i}$  und setzen ein

$$-\frac{1}{4\pi} \int_0^{2\pi} \frac{(e^{i\varphi} - e^{-i\varphi})^2}{(e^{i\varphi} + \sqrt{\beta})(e^{-i\varphi} + \sqrt{\beta})} d\varphi. \quad (5.17)$$

Um den Residuensatz anwenden zu wollen brauchen wir ein Wegintegral, das wir uns bauen können, indem wir eine Definition für komplexe Wegintegrale nutzen (Definition

3.7 Funktheo Skript). Durch Multiplizieren mit einer passenden 1 können wir also aus

$$-\frac{1}{4\pi} \int_0^{2\pi} \frac{(e^{i\varphi} - e^{-i\varphi})^2}{(e^{i\varphi} + \sqrt{\beta})(e^{-i\varphi} + \sqrt{\beta})} \cdot \frac{ie^{i\varphi}}{ie^{i\varphi}} d\varphi \quad (5.18)$$

$$= -\frac{1}{4\pi i} \int_{|z|=1} \frac{(z - z^{-1})^2}{z(z + \sqrt{\beta})(z^{-1} + \sqrt{\beta})} dz \quad (5.19)$$

$$= -\frac{1}{4\pi i} \int_{|z|=1} \frac{z^2 - 2 + z^{-2}}{(z + \sqrt{\beta})(z\sqrt{\beta} + 1)} dz \quad (5.20)$$

machen. Um die  $z^{-2}$  in Zähler zu eliminieren multiplizieren wir erneut mit einer passenden 1

$$= -\frac{1}{4\pi i} \int_{|z|=1} \frac{z^4 - 2z^2 + 1}{z^2(z + \sqrt{\beta})(z\sqrt{\beta} + 1)} dz. \quad (5.21)$$

Sichtbar werden hier die Singularitäten  $z = 0$ , welche eine Polstelle 2. Ordnung ist und  $z = -\sqrt{\beta}$ , welche eine einfache Polstelle ist. Die Singularität  $-\sqrt{\beta}^{-1}$  liegt außerhalb des Einheitskreises und damit  $\text{ind}(\gamma, -\sqrt{\beta}^{-1}) = 0$ . Weiter nennen wir den Weg des Einheitskreises  $\gamma$ . Der Residuensatz gibt uns dann

$$= -\frac{1}{4\pi i} \int_{\gamma} \frac{z^4 - 2z^2 + 1}{z^2(z + \sqrt{\beta})(z\sqrt{\beta} + 1)} dz \quad (5.22)$$

$$= -\frac{1}{4\pi i} 2\pi i \sum_{z \in \mathbb{C}} \text{ind}(\gamma, z) \text{res}(f, z) \quad (5.23)$$

Für unsere beiden Singularitäten bekommen wir also

$$= -\frac{1}{2} (\text{res}(f, -\sqrt{\beta}) + \text{res}(f, 0)). \quad (5.24)$$

Fangen wir mit  $z = -\sqrt{\beta}$  an.

$$\text{res}(f, -\sqrt{\beta}) = \lim_{z \rightarrow -\sqrt{\beta}} ((z + \sqrt{\beta}) f(z)) \quad (5.25)$$

$$= \lim_{z \rightarrow -\sqrt{\beta}} \frac{z^4 - 2z^2 + 1}{z^2(z\sqrt{\beta} + 1)} \quad (5.26)$$

$$= \frac{1 - \beta}{\beta} \quad (5.27)$$

Weiter mit  $z = 0$ .

$$\text{res}(f, 0) = \lim_{z \rightarrow 0} \frac{d}{dz} (z^2 f(z)) = \lim_{z \rightarrow 0} \frac{d}{dz} \frac{z^4 - 2z^2 + 1}{(z + \sqrt{\beta})(z\sqrt{\beta} + 1)} \quad (5.28)$$

$$= \lim_{z \rightarrow 0} \frac{(4z^3 - 4z)(z + \sqrt{\beta})(z\sqrt{\beta} + 1) - (z^4 - 2z^2 + 1)(2z\sqrt{\beta} + 1 + \beta)}{((z + \sqrt{\beta})(z\sqrt{\beta} + 1))^2} \quad (5.29)$$

$$= -\frac{1 + \beta}{\beta}. \quad (5.30)$$

Zusammengefasst erhalten wir

$$= -\frac{1}{2} (\text{res}(f, -\sqrt{\beta}) + \text{res}(f, 0)) \quad (5.31)$$

$$= -\frac{1}{2} \left( \frac{1 - \beta}{\beta} - \frac{1 + \beta}{\beta} \right) \quad (5.32)$$

$$= 1. \quad (5.33)$$

Juhu

□

**Satz 5.2** (Zwischenwertsatz [2] weiß noch nicht ob das rein sollte oder nicht weil zu trivial vielleicht). Sei  $f: [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$  eine stetige Funktion und  $n \in \mathbb{R}$ . Weiter sei  $f(a) < n$  und  $f(b) > n$ . Dann gibt es ein  $c \in [a, b]$ , sodass  $f(c) = n$ .



# 6 BuchChapter3

**Definition 6.1** (empirische Kovarianzmatrix). Sei  $X \in \mathbb{C}^{n \times m}$  eine Matrix dessen Elemente unabhängig und identisch verteilte Zufallsvariablen sind und ihr Erwartungswert 0 mit Varianz  $\sigma^2$  ist. Weiter sind  $x_k = (x_{1k}, \dots, x_{nk})$ ,  $\mathbf{X} = (x_1, \dots, x_m)$  und  $\bar{x} = \frac{1}{m} \sum_{k=1}^m x_k$ . Dann ist die empirische Kovarianzmatrix

$$\mathbf{S} = \frac{1}{m-1} \sum_{k=1}^m (x_k - \bar{x})(x_k - \bar{x})^H$$

## 6.1 Marčenko-Pastur Gesetz für i.i.d







# Literatur

- [1] S. L. Brunton und J. N. Kutz. *Data-driven science and engineering. Machine learning, dynamical systems, and control.* 2nd edition. Cambridge: Cambridge University Press, 2022. doi: [10.1017/9781009089517](https://doi.org/10.1017/9781009089517).
- [2] O. Forster. *Analysis 1. Differential- und Integralrechnung einer Veränderlichen.* 11th revised ed. Grundkurs Math. Heidelberg: Springer Spektrum, 2013. doi: [10.1007/978-3-658-00317-3](https://doi.org/10.1007/978-3-658-00317-3).
- [3] M. Gavish und D. L. Donoho. *The optimal hard threshold for singular values is  $4/\sqrt{3}$ .* IEEE Trans. Inf. Theory 60.8 (2014), S. 5040–5053. doi: [10.1109/TIT.2014.2323359](https://doi.org/10.1109/TIT.2014.2323359).
- [4] A. Meister und T. Sonar. *Numerik. Eine lebendige und gut verständliche Einführung mit vielen Beispielen.* Berlin: Springer Spektrum, 2019. doi: [10.1007/978-3-662-58358-6](https://doi.org/10.1007/978-3-662-58358-6).



## Hinweise zu den offiziellen Erklärungen

1. Die folgende Seite mit den offiziellen Erklärungen

- A)** Eigenständigkeitserklärung
- B)** Erklärung zur Veröffentlichung von Bachelor- oder Masterarbeiten
- C)** Einverständniserklärung über die Bereitstellung und Nutzung der Bachelorarbeit / Masterarbeit in elektronischer Form zur Überprüfung durch eine Plagiatssoftware

ist entweder direkt in jedes Exemplar der Bachelor- oder Masterarbeit fest mit einzubinden oder unverändert im Wortlaut in jedes Exemplar der Bachelor- oder Masterarbeit zu übernehmen.

**Bitte achten Sie darauf, jede Erklärung in allen drei Exemplaren der Arbeit zu unterschreiben.**

2. In der digitalen Fassung kann auf die Unterschrift verzichtet werden. Die Angaben und Entscheidungen müssen jedoch enthalten sein.

**Zu B)**

Die Einwilligung kann jederzeit durch Erklärung gegenüber der Universität Bremen, mit Wirkung für die Zukunft, widerrufen werden.

**Zu C)**

Das Einverständnis der dauerhaften Speicherung des Textes ist freiwillig.

Die Einwilligung kann jederzeit durch Erklärung gegenüber der Universität Bremen, mit Wirkung für die Zukunft, widerrufen werden.

Weitere Informationen zur Überprüfung von schriftlichen Arbeiten durch die Plagiatsoftware sind im Nutzungs- und Datenschutzkonzept enthalten. Diese finden Sie auf der Internetseite der Universität Bremen.

---

## Notes on the official declarations

1. The following pages with the official declarations

- A) Declaration of Authorship
- B) Declaration on the Publication of Bachelor's or Master's Thesis
- C) Declaration of Consent for the Provision and Use of the Bachelor's Thesis / Master's Thesis in Electronic Form for Review by Plagiarism Software

is to be either integrated directly into each copy of the bachelor's or master's thesis or adopted unchanged in the wording of each copy of the bachelor's or master's thesis.

**Please be sure to sign each declaration in all three copies of the thesis.**

2. The signature can be omitted from the digital version. However, the information and decisions must be included.

**Regarding B)**

The consent can be revoked at any time with future effect by notifying the University of Bremen.

**Regarding C)**

Consent for the permanent storage of the text is voluntary. The consent can be revoked at any time with future effect by notifying the University of Bremen.

Further information on the checking of written work using plagiarism software can be found in the data protection and usage concept. This can be found on the University of Bremen website.

**Eigenständigkeits- und Einverständniserklärung zur Überprüfung mit Plagiatssoftware sowie die Erklärung zur Veröffentlichung bei Bachelor- und Masterarbeiten**

**Declarations of Authorship and Consent for Checking with Plagiarism Software and the Declaration of Publication for Bachelor's and Master's Thesis**

Studierenden-Angaben / Student Information:

Matrikelnr./ Student ID \_\_\_\_\_  
Nachname / Surname \_\_\_\_\_  
Vorname / First Name \_\_\_\_\_

Titel der Arbeit / Title of Thesis

**A) Eigenständigkeitserklärung / Declaration of Authorship**

Ich versichere, dass ich die vorliegende Arbeit selbstständig verfasst und keine anderen als die angegebenen Quellen und Hilfsmittel verwendet habe. Alle Teile meiner Arbeit, die wortwörtlich oder dem Sinn nach anderen Werken entnommen sind, wurden unter Angabe der Quelle kenntlich gemacht. Gleichermaßen gilt dies für Zeichnungen, Skizzen, bildliche Darstellungen sowie für Quellen aus dem Internet, dazu zählen auch KI-basierte Anwendungen oder Werkzeuge.

Die Arbeit wurde in gleicher oder ähnlicher Form noch nicht als Prüfungsleistung eingereicht.

I hereby affirm that I have written the present work independently and have used no sources or aids other than those indicated. All parts of my work that have been taken from other works, either verbatim or in terms of meaning, have been marked as such, indicating the source. The same applies to drawings, sketches, pictorial representations and sources from the Internet, including AI-based applications or tools. The work has not yet been submitted in the same or a similar form as a final examination paper.

- Ich habe KI-basierte Anwendungen und/oder Werkzeuge genutzt und diese im Anhang "Nutzung KI basierte Anwendungen" dokumentiert.

I have used AI-based applications and/or tools and documented them in the appendix "Use of AI-based applications".

**B) Erklärung zur Veröffentlichung von Bachelor- oder Masterarbeiten**  
Declaration regarding the publication of bachelor's or master's thesis

Die Abschlussarbeit wird zwei Jahre nach Studienabschluss dem Archiv der Universität Bremen zur dauerhaften Archivierung angeboten. Archiviert werden:

Two years after graduation, the thesis is offered to the archive of the University of Bremen for permanent archiving. The following are archived:

- 1) Masterarbeiten mit lokalem oder regionalem Bezug sowie pro Studienfach und Studienjahr 10 % aller Masterarbeiten  
Master's theses with a local or regional focus, as well as per subject and academic year 10% of all Master's thesis
- 2) Bachelorarbeiten des jeweils ersten und letzten Bachelorabschlusses pro Studienfach und Jahr.  
Bachelor's thesis for the first and last bachelor's degrees per subject and year.

- Ich bin damit einverstanden, dass meine Abschlussarbeit im Universitätsarchiv für wissenschaftliche Zwecke von Dritten eingesehen werden darf.  
I agree that my thesis may be viewed by third parties in the university archive for academic purposes.
- Ich bin damit einverstanden, dass meine Abschlussarbeit nach 30 Jahren (gem. §7 Abs. 2 BremArchivG) im Universitätsarchiv für wissenschaftliche Zwecke von Dritten eingesehen werden darf.  
I agree that my thesis may be viewed by third parties for academic purposes in the university archive after 30 years (in accordance with §7 para. 2 BremArchivG).
- Ich bin **nicht** damit einverstanden, dass meine Abschlussarbeit im Universitätsarchiv für wissenschaftliche Zwecke von Dritten eingesehen werden darf.  
I do not consent to my thesis being made available in the university archive for third parties to view for academic purposes.

**C) Einverständniserklärung zur elektronischen Überprüfung der Arbeit auf Plagiate**  
**Declaration of consent for electronic checking of the work for plagiarism**

Eingereichte Arbeiten können nach § 18 des Allgemeinen Teil der Bachelor- bzw. der Masterprüfungsordnungen der Universität Bremen mit qualifizierter Software auf Plagiatsvorwürfe untersucht werden.

Zum Zweck der Überprüfung auf Plagiate erfolgt das Hochladen auf den Server der von der Universität Bremen aktuell genutzten Plagiatssoftware.

Submitted papers can be checked for plagiarism using qualified software in accordance with § 18 of the General Section of the Bachelor's or Master's Degree Examination Regulations of the University of Bremen. For the purpose of checking for plagiarism, the upload to the server is done using the plagiarism software currently used by the University of Bremen.

- Ich bin damit einverstanden, dass die von mir vorgelegte und verfasste Arbeit zum oben genannten Zweck dauerhaft auf dem externen Server der aktuell von der Universität Bremen genutzten Plagiatssoftware, in einer institutionseigenen Bibliothek (Zugriff nur durch die Universität Bremen), gespeichert wird.

I agree that the work I have submitted and written will be stored permanently on the external server of the plagiarism software currently used by the University of Bremen, in a library belonging to the institution (accessed only by the University of Bremen), for the above-mentioned purpose.

- Ich bin **nicht** damit einverstanden, dass die von mir vorgelegte und verfasste Arbeit zum o.g. Zweck dauerhaft auf dem externen Server der aktuell von der Universität Bremen genutzten Plagiatssoftware, in einer institutionseigenen Bibliothek (Zugriff nur durch die Universität Bremen), gespeichert wird.

I do not consent to the work I submitted and wrote being permanently stored on the external server of the plagiarism software currently used by the University of Bremen, in a library belonging to the institution (accessed only by the University of Bremen), for the above-mentioned purpose.

Das Einverständnis der dauerhaften Speicherung des Textes ist freiwillig. Die Einwilligung kann jederzeit durch Erklärung gegenüber der Universität Bremen, mit Wirkung für die Zukunft, widerrufen werden. Weitere Informationen zur Überprüfung von schriftlichen Arbeiten durch die Plagiatssoftware sind im Nutzungs- und Datenschutzkonzept enthalten. Diese finden Sie auf der Internetseite der Universität Bremen.

Consent to the permanent storage of the text is voluntary. Consent can be withdrawn at any time by making a declaration to this effect to the University of Bremen, with effect for the future. Further information on the checking of written work using plagiarism software can be found in the data protection and usage concept. This can be found on the University of Bremen website.

Mit meiner Unterschrift versichere ich, dass ich die obenstehenden Erklärungen gelesen und verstanden habe und bestätige die Richtigkeit der gemachten Angaben.

With my signature, I confirm that I have read and understood the above explanations and confirm the accuracy of the information provided.