

# 2025 模式识别 作业四

人工智能学院 221300079 王俊童

2025.4.15

221300079 王俊童, 人工智能学院

## 1 问题一

a. 我们假设对于  $i$  样本,  $K$  近邻  $z_{i1}, \dots, z_{iK}$ , 设  $Z_i = [z_{i1} - z_i, \dots, z_{iK} - z_i]$ , 有重构误差:

$$\left\| \sum_{j=1}^K w_{ij}(z_{ij} - z_i) \right\|^2 = w_i^T C_i w_i = w_i^T Z_i^T Z_i w_i$$

所以优化问题如下:

$$\begin{aligned} \min_{w_i} \quad & w_i^T C_i w_i \\ \text{s.t.} \quad & \sum_{j=1}^K w_{ij} = 1 \end{aligned}$$

根据拉格朗日乘子法:

$$L(w_i, \lambda) = w_i^T C_i w_i - \lambda(\mathbf{1}^T w_i - 1), \quad C_i w_i = \frac{\lambda}{2} \mathbf{1}, \quad \mathbf{1}^T w_i = 1$$

解得:

$$\lambda = \frac{2}{\mathbf{1}^T C_i^{-1} \mathbf{1}}, \quad w_i = \frac{C_i^{-1} \mathbf{1}}{\mathbf{1}^T C_i^{-1} \mathbf{1}}$$

b. 根据第一问, 我们逐个进行证明:

- 旋转不变性, 令  $z'_j = Qz_j$ , 因为  $Q$  是正交矩阵  $Q^T Q = I$ :

$$\|Qz_i - \sum_j w_{ij} Qz_j\|^2 = \|Q(z_i - \sum_j w_{ij} z_j)\|^2 = \|(z_i - \sum_j w_{ij} z_j)\|^2$$

- 平移不变性, 令  $z'_j = z_j + t$ :

$$\|z_i + t - \sum_j w_{ij}(z_j + t)\|^2 = \|z_i - \sum_j w_{ij} z_j + t - (\sum_j w_{ij} t)\|^2 = \|(z_i - \sum_j w_{ij} z_j)\|^2$$

- 缩放不变性, 令  $z'_j = sz_j$ :

$$\|sz_i - \sum_j w_{ij} sz_j\|^2 = \|s^2(z_i - \sum_j w_{ij} z_j)\|^2 \rightarrow \|(z_i - \sum_j w_{ij} z_j)\|^2$$

其中缩放倍数  $s$  并不改变优化目标。

- c. 首先这么修改之后，因为这个问题本质是一个 manifold learning 的问题。优化目标不改变，仍然是在一个低维空间里面重构一个权重，保留了局部的 manifold 的结构。

对于两个约束条件，第一个等于 0 的约束相当于约束了所有低维向量的均值为 0，消除了平移自由度，这样低维表示都在原点附近了。

对于第二个条件，相当于正交而且归一化，这样协方差就是单位了，消除了缩放，而且整个低维都在一个单位球上，所以表示也被规范化了。所以好像旋转自由度也被消除了。

其实我个人还有一个理解是，这个问题对于旋转自由度其实不是特别的敏感，因为好像旋转自由度对于这个问题影响真的不大，似乎最优解都是在一个点附近了。

- d. 不妨由厦门政府，我们从 9.52 开始算：

$$L(y) = \sum_{i=1}^n \|y_i - \sum_j w_{ij} y_j\|^2 = \|Y - WY\|^2$$

这个问题是等价的事，我们可以令  $\hat{y} = \sum_j w_{ij} y_j$ ，然后写成矩阵形式。可以化简

$$L(y) = \text{Tr}(Y^T (I - W)^T (I - W) Y) = \text{Tr}(Y^T M Y) = \sum_{i,j} M_{ij} y_i^T y_j$$

- e. 首先证明 M 是一个半正定的，假设有 v:

$$v^T M v = \|(I - W)v\|^2 \geq 0$$

然后为什么 1 向量是一个特征向量呢:

$$(I - W)\mathbf{1} = \mathbf{1} - W\mathbf{1} = \mathbf{0}, \quad \sum_j w_{ij} = 1$$

所以证明完了，然后这个第一个按照升序排序的就是 0 对应的特征向量。因为我们在降维的时候实际上对于的是 d 个最小的非零特征值的特征向量。所以这个对于平移自由度的约束其实是没用的，所以要舍弃，无意义。

- f. 尝试看看但是:

## 禁止访问!

您无权访问所请求的目录。这是由于没有主页或该目录不允许被读取导致的。

如果您认为这是一个服务器错误，请联系[网站管理员](#)。

### Error 403

[cs.nyu.edu](http://cs.nyu.edu)

Apache/2.4.62

Figure 1: forbidden

## 2 问题二

a.

$$1 - \sigma(x) = 1 - \frac{1}{1 + e^{-x}} = \frac{e^{-x}}{1 + e^{-x}} = \frac{1}{1 + e^x} = \sigma(-x)$$

b.

$$\sigma(x)' = \frac{e^{-x}}{(1 + e^{-x})^2} = \sigma(x)(1 - \sigma(x))$$

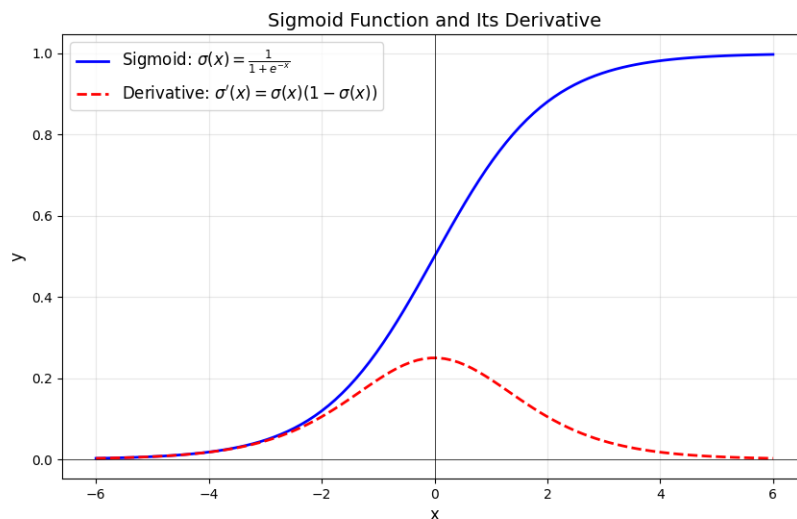


Figure 2: sigmoid

c. 因为神经网络是一个多层的，并且是一层一层求导往后算的，所以我们目前看第  $i$  层的网络节后

$$y_j^{(i)} = \sigma'(z_j^{(i)})$$

所以根据上面的图可以看到，这个导数是一个只有最大值 0.25 的情况，并且越往旁边数据就越接近 0，有大一点的值的位置是非常少的。所以我们如果从头开始算  $L$  次，梯度会变得非常非常少，这就会导致深度神经网络中的梯度消失问题。结果越趋近于 0，问题越大。

## 3 问题三

a. 1, 1, 2, 3, 5, 8

b. 可以求解  $F_n - F_{n-1} - F_{n-2} = 0$ , 我们假设通解如下:

$$F_n = A\alpha^n + B\beta^n$$

所以根据特征方程可以得到:

$$r^2 - r - 1 = 0, \quad \alpha = \frac{1 + \sqrt{5}}{2}, \beta = \frac{1 - \sqrt{5}}{2}$$

因为根据前两个斐波那契数可以得到：

$$\begin{cases} A\alpha + B\beta = 1 \\ A\alpha^2 + B\beta^2 = 1 \end{cases}$$

可以解答得到：  $A = \frac{1}{\alpha - \beta}, B = \frac{-1}{\alpha - \beta}$ , 所以得到：

$$F_n = \frac{\alpha^n - \beta^n}{\alpha - \beta}$$

c. 我们首先证明这个式子，用数学归纳法；

- 首先为 1 的情况：  $F_3 = 2, F_1 = 1$ , 所以满足。
- 假设 n 也满足
- 看 n+1 的情况：

$$\sum_{i=1}^{n+1} F_i = (\sum_{i=1}^n F_i) + F_{n+1} = F_{n+2} - 1 + F_{n+1} = F_{n+3} - 1$$

然后我们看

$$p_i = \frac{F_i}{F_{n+2} - 1}, i = 1, 2, \dots, n$$

首先这个东西肯定非负，然后在 0-1 之间， 然后还满足：

$$\sum p_i = \frac{\sum F_i}{F_{n+2} - 1} = 1$$

d. 用数学归纳法证明：

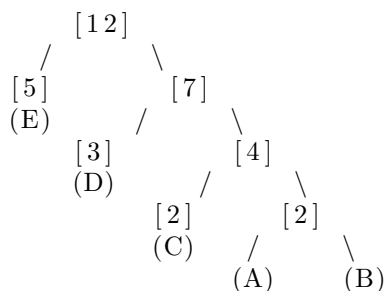
- n=1,  $\sum 1F_1 = F_3 - F_4 + 2 = 1$
- n=k, 假设也满足这个式子
- n=k+1: 要证明

$$\sum_{i=1}^{k+1} iF_i = (k+1)F_{k+3} - F_{k+4} + 2$$

$$\begin{aligned} \sum_{i=1}^{k+1} iF_i &= \sum_{i=1}^k iF_i + (k+1)F_{k+1} = kF_{k+2} - F_{k+3} + 2 + (k+1)F_{k+1} \\ &= (k+1)(F_{k+1} + F_{k+2}) - (F_{k+2} + F_{k+3}) + 2 = (k+1)F_{k+3} - F_{k+4} + 2 \end{aligned}$$

所以证明完毕

e. 首先这个 p 为  $F_1, \dots, F_5 = \{\frac{1}{12}, \frac{1}{12}, \frac{2}{12}, \frac{3}{12}, \frac{5}{12}\}$  所以霍夫曼树如下：



其中：  $E : 0, D : 10, C : 110, A : 1110, B : 1111$ .

- f. 根据观察，我们可以看到由于斐波那契数列的单调性质，从  $n=2$  开始，就满足每一个都比上一个大，所以树一定是不平衡的，意思是，我们的  $F_1, \dots, F_n$  对应的编码长度是： $n-1, n-1, n-2, \dots, 1$ ，所以满足：

$$B = p * l = \frac{1}{F_{n+2} - 1} * E, \quad E = \left( \sum_{i=2}^n F_i(n-i+1) + (n-1) \right)$$

因为：

$$\sum_{i=2}^n F_i n = F_{n+2} - 2, \quad \sum_{i=2}^n i F_i = n F_{n+2} - F_{n+3} + 1$$

所以可以化简为：

$$E = n(F_{n+2} - 2) - (n F_{n+2} - F_{n+3} + 1) + (F_{n+2} - 2) + n - 1 = F_{n+3} + F_{n+2} - n - 4 = F_{n+4} - (n + 4)$$

$$B = \frac{F_{n+4} - (n + 4)}{F_{n+2} - 1}$$

- g. 因为  $F_n = \frac{\alpha^n - \beta^n}{\sqrt{5}}$  因为有一个  $\frac{1-\sqrt{5}}{2} < 0$ ，所以  $n \rightarrow \infty$ ， $F_n \sim \frac{\alpha^n}{\sqrt{5}}$

所以：

$$B_n \approx \frac{\frac{\alpha^{n+4}}{\sqrt{5}} - (n + 4)}{\frac{\alpha^{n+2}}{\sqrt{5}} - 1}$$

可以忽略低阶项：

$$B_n \approx \frac{\frac{\alpha^{n+4}}{\sqrt{5}}}{\frac{\alpha^{n+2}}{\sqrt{5}}} = \left( \frac{1 + \sqrt{5}}{2} \right)^2 \approx 2.618$$

所以平均需要 2.618 的比特来编码。