

### 第1单元 采集表达



- 第2章 摄象机成象
- ▶ 第3章 压缩感知与成象
  - 第4章 深度信息采集 第5章 3-D景物表达
- ✓ 从图象出发,认识和理解世界 需要获得能反映场景内容和本质的图象 需要用尽少的采样精确地重构原信号 需要采集含有全面立体信息的图象 需要有对3-D空间景物的3-D表达方法



# 第3章 压缩感知



- 2.1 工炉 配加 决
- 3.1 压缩感知概述
  - 3.2 稀疏表达
  - 3.3 测量矩阵及特性
  - 3.4 解码重构
- 3.5 稀疏编码与字典学习 3.6 压缩感知的成象应用



### 3.1 压缩感知概述



压缩感知的3个关键处理步骤:

- (1) **稀疏表达**:判断信号是否具有稀疏性是实现压缩感知的前提
- (2)**测量编码**:对信号进行测量/观测,从而得到感知测量值,即进行测量编码。测量矩阵是压缩感知理论能否成功实现的关键
  - (3)解码重构:运用压缩测量的低维数据 (感知测量值)精确地重构高维原始信号。这是压缩感知模型求解的保证,也是压缩感知的核心部分



### 压缩感知概述

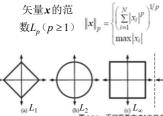


压缩感知的流程框图 第一行的3个框: 压缩感知的3个关键处理步骤 第二行的3个框,实现压缩感知要完成的3个工作 恢复图像 原始图像 稀疏图像 线性投影 稀疏表达 确定正交基 /緊框架 观测矩阵 重建算法 图 3.1.1 压缩感知流程





#### 矢量空间



 $p \in [1, \infty)$   $i = 1, 2, \dots, N$ 

章毓晋 (TH-EE-IE) ZHANG YU JIN

 $p = \infty$ 

拟范数 (p < 1)





#### 2. 基和框架

考虑矢量集 $\mathbf{Y} = \{ \mathbf{w} \}$ , i = 1, 2, ..., N, 如果其中的矢量可以生成矢量空间 $V = \mathbf{R}^N$ , 而且矢量 $\mathbf{w}$ 之间是非线性相关的,则 $\mathbf{Y}$ 可以称为有限维矢量空间V中的**基** 

标准正交集就是一种特殊的基: 矢量集 $\Psi$  =  $\{\psi_i\}$ , 其中所有矢量之间是正交的且每个基的范数都为单位1,即 $\Psi$ <sup>T</sup> $\Psi$ =I

对于任何属于该矢量空间中的矢量x,可以很容易地计算出系数a,即 $a = \mathbf{Y}^{\mathsf{T}}x$ 





#### 2. 基和框架

把基的概念推广到一些可能线性相关的矢量集就形成列**框架**,即矢量集**乎**={ $\psi$ ;} $_{i=1}^{N}$ 且 $\psi_{i}$   $\in$  R<sup>d</sup>,其中d < N,相当于矩阵**乎**  $\in$  R<sup>dxN</sup>,对所有矢量x  $\in$  R<sup>d</sup>满足 $L\|x\|_{i}^{2} \leq \|\mathbf{\Psi}^{T}x\|_{i}^{2} \leq R\|x\|_{i}^{2}$ 

如果L被选为使这个不等式成立的可能存在的最大值,R被选为使这个不等式成立的可能存在的最小值,则把它们称为无框架界。如果L=R,则这个框架称为紧框架。如果 $\Psi$ 是一个有限维矩阵,则L和R分别对应 $\Psi$  $\Psi$ T的最小特征值和最大特征值





#### 稀疏性表达

为了更精炼地表达一个信号,可以把信号变换 到一个新的基或框架下,当非零系数的个数远远少 于原始信号的项数时,可以把这些少量的非零系数 称为原始信号的**稀疏性表**达

在稀疏性表达中,常把基或框架称为**字典**或过 完备字典,而把其中的矢量元素称为**原子** 

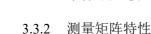
从数学的角度看,当信号x中最多有K个非零的值时,称信号x是K稀疏的,即 $\|x\|_0 \le K$ ,可以采用 $\Sigma_K = \{x: \|x\|_0 \le K\}$ 来表示所有K稀疏信号的集合



# 3.3 测量矩阵及特性



3.3.1 采样/测量模型



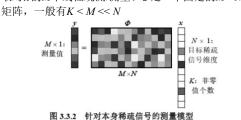




### 3.3.1 采样/测量模型



根据压缩感知的原理,通过一个测量矩阵 $\phi$ 获取对x的M个线性观测/测量。 $\phi$ 是一个固定的 $M \times N$ 





### 3.3.1 采样/测量模型



对本身并不稀疏的信号,可通过将其变换到一 个新的基或框架下而使其表现出稀疏特性  $\mathbf{u}_{\mathbf{x}}$ 在 $\mathbf{\Psi}$ 中体现出稀疏性,即 $\mathbf{x} = \mathbf{\Psi}_{\mathbf{z}}$ ,则可合 **并の**和 ♥  $M \times N$  $\Phi x = \Phi \Psi z$ 

图 3.3.3 具有普适性的测量模型



### 3.3.2 测量矩阵特性



#### 1. 零空间及其特性

 $\mathcal{N}(\boldsymbol{\phi})$ 与 $\Sigma_{2K}$ 的交集是空集

对一个矩阵 $\boldsymbol{\phi}$ ,其零空间可定义为 $\mathcal{N}(\boldsymbol{\phi})$  $\mathcal{N}(\boldsymbol{\phi}) = \{z: \boldsymbol{\phi}z = 0\}$ 

对任意稀疏信号x,如果希望基于测量值y= $\mathbf{o}x$ 无失真地重建该稀疏信号x,则对任意两个矢量x和 $x' \in \mathcal{E}_K = \{z: ||z||_0 \le K\}$ ,一定有 $\mathbf{o}x = \mathbf{o}x'$ ,由此得到 $\mathbf{o}(x-x') = 0$ ,其中 $x-x' = h \in \mathcal{E}_{2K}$ 用矩阵 $\mathbf{o}$ 可以唯一地表达x的充分必要条件是

 $\Phi$ 的零空间 $\mathcal{N}(\Phi)$ 不含有任何 $\Sigma_{2K}$ 中的元素,

印引



### 3.3.2 测量矩阵特性



### 1. 零空间及其特性

假设S ⊂ {1, 2, ....., N}是一个索引集的子集,

 $S^C = \{1, 2, \ldots, N\} \setminus S$ 是其相应的补集,则矢量 $x_s$ 表 示长度为N的矢量,且这个矢量中所有下标属于集  $合S^{C}$ 的元素都被设为0。类似地,矩阵 $\phi$ 。表示长度 为 $M \times N$ 的矢量,且其所有下标属于集合 $S^C$ 的列矢 量都被设为零矢量

矩阵 $\phi$ 满足K阶零空间特性:存在一个常数C

>0,使得右式对所有 $h \in \mathcal{N}(\mathbf{\Phi})$ 和所有 $|S| \le K$ 的S都成立



### 3.3.2 测量矩阵特性



需要

#### . 约束等距特性

讨论更为严格的重建条件

零空间特性是确保重建的必要条件

当测量值有噪声或在量化时引入误差时,

如果存在 $\delta_K \in (0,1)$ ,使得

$$(1 - \delta_K) \| \mathbf{x} \|_2^2 \le \| \mathbf{\Phi} \mathbf{x} \|_2^2 \le (1 + \delta_K) \| \mathbf{x} \|_2^2$$

对所有 $\mathbf{x} \in \Sigma_K \{\mathbf{x}: \|\mathbf{x}\|_0 \le K\}$ 都成立,则称矩阵 $\mathbf{o}$ 满足 K阶约束等距特性, $\delta_K$ 称为矩阵 $\mathbf{o}$ 的**约束等距常数** ( $\delta_K$ 是对所有K阶稀疏矢量 $\mathbf{x}$ 均满足的最小常数)

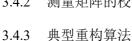


# 3.4 解码重构



3.4.1 重构原理

3.4.2 测量矩阵的校准











### 1. 基本重构模型

假设矢量 $\mathbf{x} \in \mathbf{R}^N$ 是一个长度为N的稀疏信号,测量矩阵 $\mathbf{\phi} : \mathbf{R}^N \to \mathbf{R}^M$ 已知,要基于很少的测量值

 $y \in \mathbb{R}^{M}$ , M < N重建原始目标信号x $\min \|x\|_{o}$ , s.t.  $y = \Phi x$ , 测量值无噪声的情况

 $\min \|\mathbf{x}\|_{0}$ , s.t. $\|\mathbf{\Phi}\mathbf{x}-\mathbf{y}\|_{2} \le \varepsilon$ ,测量值存在少量有界噪声的情况

原始目标信号在某个正交变换域或 $\phi$ 中, $x = \phi z$ min |z|, s.t.  $y = \phi y x$ , 测量值无噪声的情况

 $\min \|\mathbf{z}\|_0$ , s.t. $\|\boldsymbol{\phi} \boldsymbol{\Psi} \mathbf{x} \cdot \mathbf{y}\|_2 \le \varepsilon$ ,测量值存在少量有界噪声的情况





第18页

### 1. 基本重构模型

一个组合优化问题, 也是一个NP难题

可采用凸的L,范数来近似非凸的L,范数,把组

合优化问题转化为凸优化问题

当测量值没有噪声时,得到如下基本追踪表达 式:  $\min \|x\|_1$ , s.t.  $y = \Phi x$ 

当测量值存在少量有界噪声时,得到加下基本 追踪去噪表达式:

 $\min \|x\|_1$ , s.t.  $\|\boldsymbol{\Phi}x - y\|_2 \le \varepsilon$ 

章毓晋 (TH-EE-IE) ZHANG YU JIN





### 2. 无噪声稀疏信号重构

考虑一个更为通用的无噪声稀疏信号重构问题  $x' = \operatorname{argmin} \|x\|_{\bullet}$ , s.t.  $x \in B(y)$ 

其中,B(y)确保x'与测量值y保持一致, $\{x: \mathbf{\Phi}x = y\}$ 

可以证明,当 $\mathbf{x} \in \Sigma_K = \{\mathbf{x}: \|\mathbf{x}\|_0 \le K\}$ 时,如果 $\boldsymbol{\sigma}$ 满足约束等距特性,则只要 $O(K \ln(N/K))$ 个采样值就可以无失真地重建任何包含K个非零元素的目标信号 $\mathbf{x}$ ,而不需考虑这K个非零元素具体如何分布





### 3. 有噪声稀疏信号重构

考虑一个通用的、存在噪声污染情况下的稀疏 信号重构问题

 $x' = \operatorname{argmin} \|x\|_1$ , s.t.  $x \in B(y)$ 

x = a.gama||v||1, sin v = 2(3)

其中,B(y)确保x'与测量值y保持一致。B(y)可有多种选择,下面两种情况重构都是有界的

(1) 有界噪声污染信号的重构 (2) 高斯噪声污染信号的重构

{P.64}



### 3.4.2 测量矩阵的校准



## 如测量矩阵本身存在噪声,则要考虑校准问题

- (1) 忽略这个问题,这有可能明显影响重建精度
- (2) 把由非精确测量矩阵带来的影响当作噪声  $v = \Phi x + \varepsilon + \eta$
- (3) 监督校准:利用已知训练信号: $x_1, x_2, ..., x_l, ..., x_L$ 和相应的测量值 $y_l = \Phi_l' x_l + e_l Y = \Phi' X + E$

优化 $\Phi'$ 以使  $\|Y - \Phi'X\|$ 最小  $\Phi' := \underset{\Phi'}{\operatorname{arg min}} \|Y - \Phi'X\|_{\mathbb{F}}^2$ 



### 3.4.2 测量矩阵的校准



# 如测量矩阵本身存在噪声,则要考虑校准问题

(4) 非监督校准: 盲校准

无须已知的/用于训练的稀疏信号

把未知的训练信号矢量 $x_1, x_2, ..., x_l$ 表述成矩阵

X,基于已知精确的测量矩阵 $\phi_0$ 和多组观测矢量 $y_1$ , $y_2$ ,…, $y_1$ 形成的矩阵Y,通过一定的方法可以确定增益矩阵D和X

 $\min_{\boldsymbol{D}, X} \|\boldsymbol{X}\|_{1} \quad \text{s.t.} \quad \boldsymbol{Y} = \boldsymbol{D}\boldsymbol{\Phi}_{0}\boldsymbol{X}$ 

 $\mathbf{p}_{0}\mathbf{X}^{-}$  {P.65}



### 343 典型重构算法



### 1. 重构要考虑的因素

- (1) 先验信息: 如信号稀疏、全变分信息
- (2) 测量值数量: 要求尽可能少 (3) 抗噪声鲁棒性:无论测量值包含噪声或测
  - 量系统本身具有系统噪声 (4) 重构速度: 占用较少计算资源
- (5) 稳定性: 采用Lī范数最小化 多数重建算法可成4大类,包括凸优化算法,



### 3.4.3 典型重构算法



#### 2. 凸优化算法

基本思路:用凸函数代替 $L_0$ 范数,并在一个  $R^N$ 空间中的凸集里去优化关于未知变量x的凸目标 函数J(x)

这类算法重构精度高,需要的测量数据比较 少,约为 $O(K\log(N/K))$ ;但计算速度慢,计算复杂 性约为O(N3)

假设J(x)是一个能促进稀疏性的(即当目标信 号x很稀疏时,J(x)的值很小)且凸的代价函数



# 3.4.3 典型重构算法



### 2. 凸优化算法

在测量值没有噪声时  $\min\{J(x)\}\$ , s.t.  $v = \Phi x$ 

在测量值有噪声时

 $\min\{J(x)\}, \text{ s.t. } H(\Phi x, y) \leq \varepsilon$ 

改写成没有约束条件的形式

惩罚代价函数  $\min\{J(x) + \lambda H(\boldsymbol{\Phi}x, y)\}\$ 常用:  $J(x) = ||x||_1$   $H(\Phi x, y) = 0.5 \times ||\Phi x - y||_2^2$ 

第3讲 童毓晋 (TH-EE-IE) ZHANG YU JIN



#### 典型重构算法 3.4.3



#### 3. 含婪算法

稀疏信号重构是基于线性测量值v来重构出最 具稀疏性的目标信号x,即重建出非零个数最少的 目标信号x

$$\min\left\{ |I| : y = \sum_{i \in I} \phi_i x_i \right\}$$

 $I \subset \{1, ..., N\}$ ,表示一个索引集(对应支撑集)

这类算法的复杂度大多是由找到正确索引集所 需要的迭代次数所决定的, 计算速度一般比较快但 是需要的测量数据多且重构的精度比较低



### 3.4.3 典型重构算法



### 4. 组合算法

基本思想: 先对信号进行高度结构化采样(线性投影),再借助组/群测试快速获得信号的支撑集,实现精确重构

将重构问题表述成:已知长度为N的矢量x中包含K个非零元素, $x_i \neq 0$ ,但它们的位置分布未知

特点是简单高效,要求测量值没有噪声干扰

- (1) 计数-最小略图法: 仅考虑非负信号 {P.69}
- (2) 计数-中值略图法: 信号为负数时也适用



### 3.4.3 典型重构算法



#### 5. 贝叶斯算法

基本思想:在未知信号模型的基础上考虑非确 定性因素,即考虑一个概率分布已知的稀疏信号,

从随机测量中重构符合此概率分布的信号 对具有较强时间相关性的信号可提供比其他重 构算法更高的重构精度,但并不能基于一定数量的 测量值无失真地重建原始目标信号 (1) 相关向量机

(2) 贝叶斯压缩感知

{P.70}



### 3.5 稀疏编码与字典学习



设 $\mathbf{y}_i \in \mathbf{R}^L$ 是一个维度为L的矢量,用来表示一共N个信号中的第i个; $\mathbf{A} = [a_1, ..., a_M] \in \mathbf{R}^{L \times N}$ 表示原子信号矩阵,其中第i列是维度为L的原子信号; $\mathbf{w}_i \in \mathbf{R}^M$ 是一个维度为M的矢量,用来表示构成矢量 $\mathbf{y}_i$ 的原子信号的权重矢量

$$\mathbf{y}_i = \mathbf{A}\mathbf{w}_i^{\mathrm{T}} + \mathbf{\varepsilon}_i \quad \|\mathbf{w}_i\|_0 \le K \quad i = 1, ..., N$$
  
 $\mathbf{Y} = \mathbf{A}\mathbf{W} + \mathbf{E} \quad \|\mathbf{w}_i\|_0 \le K \quad i = 1, ..., N$ 

其中, $\boldsymbol{\varepsilon}_i \in \mathbb{R}^L$ 是来自某个概率分布的未知误差;  $\|\boldsymbol{x}\|_0$ 代表矢量 $\boldsymbol{x}$ 的 $L_0$ 范数,K是一个大于零的正整数







3.5.4 稀疏编码



### 3.5.1 字典学习与矩阵分解



如果忽略误差  $Y \approx AW$ 

这是一个矩阵乘式分解的问题

利用SVD分解  $Y = UDV^T$ 

如果已知U和V都是满秩矩阵,则奇异值矩阵 D中的非零奇异值的个数对应矩阵Y的秩R(Y)

设R(Y) = T,那么可以截掉SVD分解中各矩阵中冗余的列,得到稍微简洁的SVD分解矩阵

**瘦SVD:** 即 $U \in \mathbb{R}^{L \times T}$ ,  $D \in \mathbb{R}^{T \times T}$ , 并且 $V \in \mathbb{R}^{N \times T}$ 



### 3.5.1 字典学习与矩阵分解



Y ≈ AW 中是个约等号, 说明有误差存在

**截断SVD**(tSVD): 保留若干个(设保留了T

个) 最重要的奇异值, 将不重要的奇异值设为零 为确定T,可根据SVD与PCA之间的关系。即

SVD的U矩阵对应PCA中的主分量,DVT就是数据 在主分量上的投影值

tSVD逼近实际上是要选取若干个主分量来重 构信号。所以,可以利用PCA中确定主分量个数的 方法来确定tSVD中的T



### 3.5.2 非负矩阵分解



### 截断SVD (tSVD) 的优化形式

 $\min_{A \in \mathbb{R}^{L \times M}, W \in \mathbb{R}^{M \times N}} \|E\|_{\mathbb{F}}^2$  要优化的目标

s.t. Y = AW + E 限定条件

两个问题:①可能有无穷多个解;②对字典信 号必须正交的要求过于苛刻

用来限定解空间的规则应满足两个条件:一个 是限定规则本身应具有物理意义;另一个是限定后 优化问题应可解 ⇒ 非负矩阵分解



### 3.5.3 端元提取



一种字典学习方法,其两个限制条件为:一个是权重矩阵非负;另一个是权重矩阵每一列的和必须为1  $y_i = Aw_i + \varepsilon$   $w_i \ge 0$   $w_i^T L = 1$ 

Y = AW + E  $W \ge 0$   $W^TL = L$ 

迭代约束端元化(ICE)

 $\min_{A \in \mathbb{R}^{LM}, W \in \mathbb{R}^{M \times N}} \|E\|_{F}^{2} + \lambda \sum_{i \neq j} \|a_{i} - a_{j}\|_{2}^{2}$ st Y = AW + F

 $W \ge 0$   $W^{\mathsf{T}}L = L \qquad \{P.76\}$ 



### 3.5.4 稀疏编码



寻找数据的一种字曲表达方式, 要使得每个数 据都可以表示成为少数几个原子信号的线性组合

 $\min_{\boldsymbol{A} \in \mathbb{R}^{L \times M}} \|\boldsymbol{E}\|_{p}$ st Y = AW + E

 $\|\mathbf{w}_i\|_{0} \leq K \quad i=1,\cdots,N$ 含义, 找到用干表示数据Y的字曲, 使得使用 该字典的每个数据的重建系数在一定误差允许范围

内是K稀疏的 在稀疏编码中矩阵4也是需要求解的目标之一



## 3.5.2 非负矩阵分解



非负矩阵分解 (NMF) 的优化形式  $\min_{A \in \mathbb{R}^{L \times M}, W \in \mathbb{R}^{M \times N}} \|E\|_F^2 = \mathcal{E}$ 优化的目标 s.t. Y = AW + E限定条件 (非角)  $A \ge 0$  $W \ge 0$  $\min_{A \in \mathbb{R}^{L \times M}} d(Y, AW)$ 稀疏非负矩阵分解 s.t. Y = AW + E(加入权重矩阵  $A \ge 0$ 的稀疏性条件)~ W > 0

 $\|W\|_{0} \leq K$ 



# 3.6 压缩感知的成象应用



3.6.1 单象素相机

3.6.2 压缩感知磁共振成象



#### 3.6.1 单象素相机



数字微镜器(DMD): 一种借助大量微镜来 (射入射光而实现光调制的器件

反射入射光而实现光调制的器件 微镜阵列中的每个单元都可借助电压信号控制 以分别进行正负12度的机械翻转,这样就可将入射 光分别进行对称角度的反射或完全吸收而不输出。 这样就构成来一个由1和0组成的随机测量矩阵



### 3.6.1 单象素相机



利用光学透镜将场景中得到光源照射的目标投影到数字微镜器,以对称角度反射出来的光被光敏二极管所接收,其电压随反射光强度发生变化,量化后给出一个测量值 $y_i$ ,其中每次DMD的随机测量模式对应测量矩阵中的一行 $\phi_i$ ,如果将输入图象看成一个矢量x,则该次测量的结果为 $y_i = \phi_i x$ 

将此投影操作重复M次,则通过M次随机配置 DMD上每个微镜的翻转角度,就可获得M个测量结果,得到 $y = \Phi x$ ,再利用总变分重构法重建



## 3.6.2 压缩感知磁共振成象







# 3.6.2 压缩感知磁共振成象



(1) 考虑一幅N-D图象x在 $\Psi = \{\Psi_1, ..., \Psi_N\}$ 下 具有稀疏性  $x = \sum_{i=1}^{K} \theta_{i} \boldsymbol{\Psi}_{N} = \boldsymbol{\Psi} \boldsymbol{\Theta}$ 

借助 $\mathbf{F} \in \mathbf{R}^{M \times N} (M \ll N)$  将图象 $\mathbf{x}$ 投影到 低维空间,得到M维的测量值 $y \in \mathbb{R}^{M}$ :

 $v = Fx = F\Psi\Theta$ 图象x可由K空间的测量值y通过求解约束 优化问题来精确重构:

章毓晋 (TH-EE-IE) ZHANG YU JIN

 $\min \|\Psi x\|_1$  s.t.  $\|Fx - y\|_2 < \varepsilon$ 



### 联系信息



- ☞ 通信地址:北京清华大学电子工程系
- ☞ 邮政编码: 100084
- ☞ 办公地址:清华大学,罗姆楼,6层305室
- ☞ 办公电话: (010) 62798540 ☞ 传真号码: (010) 62770317
- ☞ 电子邮件: zhang-yj@tsinghua.edu.cn ☞ 个人主页: oa.ee.tsinghua.edu.cn/~zhangyujin/