

Rasgele İzdüşümü (Random Projection) ile SVD

Eğer ana matrisimiz A 'nin çok fazla kolonu var ise bunu bir şekilde azaltmanın yollarını arayabiliriz. [1]'e göre bunu yapmanın yollarından biri rasgele izdusum hesabıdır. İlk önce $n \times k$ boyutunda bir Gaussian rasgele matris Ω üretiriz. Ardından

$$Y = A\Omega$$

hesaplanır. Bu Y üzerinde QR ayrıştırması yaparız, ve elde edilen Q ile

$$B = Q^T A$$

hesabını yaparız. Ardından bu matris üzerinde SVD ayrıştırması yaparız,

$$B = \hat{U}\Sigma V^T$$

ve

$$U = Q\hat{U}$$

matrisini hesaplarız. Ana fikir suradan geliyor,

$$A = QQ^T A$$

ki bu standart bir cebir numarası olurdu, Q yerine rasgele izdusumdan gelen yaklaşık Q 'yu kullanabiliriz, o zaman

$$A \approx \tilde{Q}\tilde{Q}^T A$$

olacaktır. Yani izdusumdan gelen Q, R gerçek versiyona yakın. Üstteki carpımda R yerine B harfi kullanıyoruz, ki $B = \tilde{Q}^T A$ oluyor, yani

$$A \approx \tilde{Q}B$$

ya da

$$B \approx \tilde{Q}^T A$$

.

O zaman İstatistik notlarımız altındaki *Paralel Matris Carpımı*, *Ax*, *QR* ve *SVD* yazısında olduğu gibi B 'nin SVD'sini alarak yaklaşık bir U elde etmek mümkün olacaktır.

Bu yaklasiksal metot isler cunku noktalar yaklasiksal bir altuzaya yansittikten sonra elde edilen yeni noktalarin arasindaki mesafelerin fazla bozulmadan muhafaza edildiği soylenir, daha detayli soylemek gerekirse, n -boyutlu verileri $O(\log n/\epsilon^2)$ boyutundaki bir rasgele altuzaya yansitmak, pozitif olasilikla, yeni noktalarin arasindaki mesafeleri sadece $1 \pm \epsilon$ olcusunde degistirir [2]. Y 'nin, A 'nin "menzilini" iyi temsil ettigi de soylenir.

Test olarak suradaki [3] veri seti uzerinde gorelim:

```
import numpy.random as rand
import numpy.linalg as lin
import pandas as pd

k = 7 # izdusum uzayinin boyutlari
df = pd.read_csv("w1.dat", sep=';', header=None)
A = np.array(df)[: , 1:]

print "A", A.shape

rand.seed(1000)

Omega = rand.randn(A.shape[1], k)

Y = np.dot(A, Omega)

print "Y", Y.shape

Q, R = lin.qr(Y)

# niye devrigi ile is yaptigimizi altta anlatiyoruz
BT = np.dot(A.T, Q)

print "Q", Q.shape
print "BT", BT.shape

x, x, V = lin.svd(BT)

print 'V', V.shape

Uhat = V.T # cunku B=USV', B'=VSU' U of B icin V' lazim

print "Uhat", Uhat.shape

U = np.dot(Q, Uhat)

print "U", U.shape
```

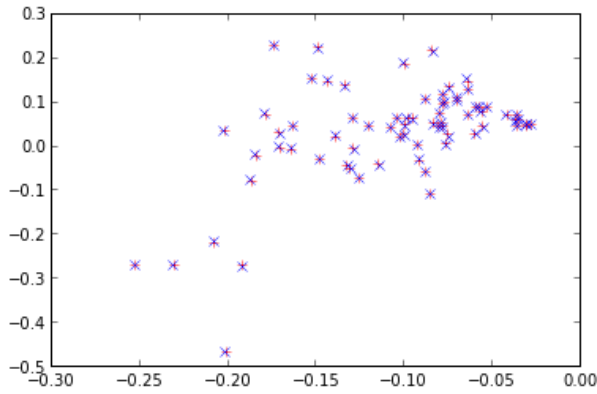
```
plt.plot(U[:,0],U[:,1], 'r+')

plt.hold(True)

# gercek SVD ile karsilastir

U, Sigma, V = lin.svd(A);
plt.plot(U[:,0],-U[:,1], 'bx')
plt.savefig('rnd_1.png')

A (71, 30)
Y (71, 7)
Q (71, 7)
BT (30, 7)
V (7, 7)
Uhat (7, 7)
U (71, 7)
```



Mavi noktalar A üzerinde "gercek" SVD sonucu, kırmızılar yansıtma sonrası elde edilen U . Sonuçlar çok iyi.

B yerine B^T

Kodlama açısından, ya da büyük veri bağlamında başka amaçlar [4] için $B = Q^T A$ yerine $B^T = A^T Q$ hesabı yapmak istenilebilir. Niye? Çünkü çıktı olarak $n \times k$ matrisi istiyor olabiliriz, $k \times n$ matrisi istemiyoruz, yani çok olanın satırlar olmasını istiyoruz, kolonlar olmasını istemiyoruz.

O zaman, elde edilen B^T ise, B üzerinde değil B^T üzerinde SVD alacağız demektir, bu da sonuçları birazcık degistirir, yani

$$B = U\Sigma V^T$$

$$B^T = V\Sigma U^T$$

haline gelir. Yani B 'nin U 'sunu elde etmek için B^T 'nin SVD'si sonrasında ele geçen sonucta $(U_{BT}^T)^T$ yapmak gerekir. Her şeyin hafızada yapıldığı durumda bu fark yaratmaz, fakat "ilerisi için", yani esle / indirge ortamları için akılda tutmak faydalı olur.

Kaynaklar

- [1] Halko, N., Randomized methods for computing low-rank approximations of matrices
- [2] Gupta, A., Dasgupta, S., An Elementary Proof of a Theorem of Johnson and Lindenstrauss
- [3] archive.ics.uci.edu/ml/datasets/Breast+Cancer
- [4] arxiv.org/abs/1310.4664