Линейная алгебра

Проекции. Ортогонализация базиса.

Глеб Карпов

МНаД ФКН ВШЭ

Ортогональные базисы.

Определение

Система векторов $\mathbf{v}_1, \mathbf{v}_2, \ldots, \mathbf{v}_n$ называется ортогональной, если любые два вектора взаимно ортогональны, то есть $(\mathbf{v}_j, \mathbf{v}_k) = 0$ при $j \neq k$.
Если дополнительно $\|\mathbf{v}_k\| = 1$ для всех k, то система называется ортонормированной.

Зачем это нужно?

$$\mathbf{x} = \alpha_1 \mathbf{v}_1 + \alpha_2 \mathbf{v}_2 + \ldots + \alpha_n \mathbf{v}_n = \sum_{j=1}^{n} \alpha_j \mathbf{v}_j$$

Взяв скалярное произведение обеих частей равенства с $\mathbf{v}_1$, получаем

$$(\mathbf{x}, \mathbf{v}_1) = \sum_{j=1}^{n} \alpha_j \left(\mathbf{v}_j, \mathbf{v}_1\right) = \alpha_1 \left(\mathbf{v}_1, \mathbf{v}_1\right) = \alpha_1 \left\|\mathbf{v}_1\right\|^2$$

Аналогично, беря скалярное произведение обеих частей с $\mathbf{v}_k$, получаем

$$(\mathbf{x}, \mathbf{v}_k) = \sum_{j=1}^{n} \alpha_j \left(\mathbf{v}_j, \mathbf{v}_k\right) = \alpha_k \left(\mathbf{v}_k, \mathbf{v}_k\right) = \alpha_k \left\|\mathbf{v}_k\right\|^2$$

Итак

$$\alpha_k = \frac{(\mathbf{x}, \mathbf{v}_k)}{\left\|\mathbf{v}_k\right\|^2}$$

Проекции

Ортогональная проекция на вектор.

Определение (ортогональная проекция)

Пусть $\mathbf{x} \neq \mathbf{0}$. Обозначим единичный вектор в направлении $\mathbf{x}$ как

$$\mathbf{u} = \frac{\mathbf{x}}{\|\mathbf{x}\|}.$$

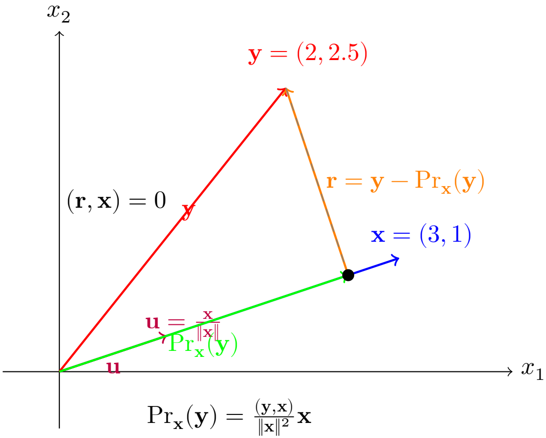
Ортогональная проекция вектора $\mathbf{y}$ на направление $\mathbf{x}$ (обозначение: $\mathrm{Pr}_{\mathbf{x}}(\mathbf{y})$) равна

$$\mathop{\mathrm{Pr}}_{\mathbf{x}}(\mathbf{y}) = (\mathbf{y}, \mathbf{u})\,\mathbf{u} = \frac{(\mathbf{y}, \mathbf{x})}{\|\mathbf{x}\|^2}\,\mathbf{x}.$$

Сопряжённый (ортогональный) остаток:

$$\mathbf{r} = \mathbf{y} - \mathop{\mathrm{Pr}}_{\mathbf{x}}(\mathbf{y}), \qquad (\mathbf{r}, \mathbf{x}) = 0.$$

Пример: ортогональная проекция



Алгоритм Грама-Шмидта

Вход: линейно независимые векторы $\mathbf{x}_1, \ldots, \mathbf{x}_k$.

Классический (ортогонализующий) шаги:

$$\mathbf{v}_1 = \mathbf{x}_1,$$

$$\mathbf{v}_m = \mathbf{x}_m - \sum_{j=1}^{m-1} \frac{(\mathbf{x}_m, \mathbf{v}_j)}{\|\mathbf{v}_j\|^2} \mathbf{v}_j, \quad m = 2, \ldots, k.$$

Получаем ортогональную систему $\{\mathbf{v}_j\}$ с теми же линейными оболочками: $\operatorname{span}\{\mathbf{v}_1, \ldots, \mathbf{v}_m\} = \operatorname{span}\{\mathbf{x}_1, \ldots, \mathbf{x}_m\}$.

Нормировка (получение ортонормированного базиса):

$$\mathbf{e}_m = \frac{\mathbf{v}_m}{\|\mathbf{v}_m\|}, \quad m = 1, \ldots, k.$$

Пример

Ортогонализовать набор векторов $G = \left\{ \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 2 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ 2 \end{pmatrix} \right\}$

Слайд для записей