Отчет?

Климов Иван

В дальнейших рассуждениях будем считать число популяций равное единице.
Функция, которую мы хотим оптимизировать:

$$h(\Theta|S) = \prod_{d=0\dots n} \frac{e^{-M[d]} M[d]^{S[d]}}{S[d]!}$$

Посмотрим что вообще хочется знать в общем случае:

$$\frac{\mathrm{d}h}{\mathrm{d}\theta} = \frac{\partial h}{\partial \phi}\frac{\partial \phi}{\partial \theta} + \frac{\partial h}{\partial \theta}$$

Заметим, что в h не используется θ в явном виде. Поэтому $\frac{\partial h}{\partial \theta} = 0$. Попробуем избежать подсчета $\frac{\partial \phi}{\partial \theta}$ при помощи Adjoint-State Method. Пусть:

$$\mathcal{L}(\phi(\theta), \theta) = h(\phi(\theta), \theta) + \lambda \cdot F(\phi(\theta), \theta)$$

Что такое F? Разумеется условие на то, что $\phi(\theta)$ является ровно корнем нашего дифференциального уравнения. Продифференцируем Лагранжиан:

$$\frac{\mathrm{d}\mathcal{L}}{\mathrm{d}\theta} = \frac{\partial h}{\partial \phi}\frac{\partial \phi}{\partial \theta} + \lambda \cdot \left(\frac{\partial F}{\partial \phi}\frac{\partial \phi}{\partial \theta} + \frac{\partial F}{\partial \theta}\right) = \left(\frac{\partial h}{\partial \phi} + \lambda \frac{\partial F}{\partial \phi}\right) \cdot \frac{\partial \phi}{\partial \theta} + \lambda \frac{\partial F}{\partial \theta}$$

Распишем размерности функций чтобы понимать что вообще происходит(в одномерном случае):

- h выдает в качестве результата конкретный likehood, поэтому она действует в $\mathbb{R}$
- θ можно воспринимать как "константную"функцию, она всегда выдает $\mathbb{R}^M$, где M — количество параметров.
- ϕ выдает в качестве результата все ответы на константной сетке, то есть вектор $\mathbb{R}^{N^P}$ или $\mathbb{R}^N$ в случае одной популяции, где N — количество точек на сетке.
- F выдает то же самое что и ϕ, поэтому результат это вектор $\mathbb{R}^{N^P}$ или $\mathbb{R}^N$ в случае одной популяции.

Тогда можем сделать следующие выводы по размерностям производных:

- $\frac{\mathrm{d}h}{\mathrm{d}\theta}$ размерность $\mathbb{R}^{1\times M}$
- $\frac{\partial h}{\partial \phi}$ размерность $\mathbb{R}^{1\times N}$
- $\frac{\partial F}{\partial \phi}$ размерность $\mathbb{R}^{N\times N}$
- $\frac{\partial \phi}{\partial \theta}$ размерность $\mathbb{R}^{N\times M}$
- $\frac{\partial F}{\partial \theta}$ размерность $\mathbb{R}^{N\times M}$

Легко видеть что тогда для получения корректного результата λ должна иметь размерность $\mathbb{R}^{1\times N}$. Давайте выберем λ, так чтобы множитель занулился и нам не пришлось бы считать $\frac{\partial \phi}{\partial \theta}$. Как именно его выбрать? Пусть $A := \frac{\partial F}{\partial \phi}, b = \frac{\partial h}{\partial \phi}$. Тогда:

$$\lambda A = -b \implies A^T \lambda^T = -b^T$$

Таким образом наш вектор λ это просто решение понятной системы уравнений. Теперь нам нужно посчитать три производные:

- $\boxed{\dfrac{\partial h}{\partial \theta}}$

  Считать градиент от $n+1$ произведения не очень хочется, так как производная произведения это не произведение производных и там все очень страшно разрастается.

Тогда можем заметить, что у функции и логарифма одинаковые промежутки монотонности, следовательно можно найти градиент логарифма и это будет то что нам нужно. Тогда получаем следующее равенство:

$$\frac{\mathrm{d}\log h}{\mathrm{d}\phi} = \sum_{i=0}^{n} \frac{\mathrm{d}M[i]}{\mathrm{d}\phi} \cdot \left(\frac{S[i]}{M[i]} - 1\right)$$

Свели задачу к нахождению $\frac{\mathrm{d}M[i]}{\mathrm{d}\phi}$ при фиксированном i. Следующим шагом проталкиваем градиент внутрь M:

$$\frac{\mathrm{d}M[i]}{\mathrm{d}\phi} = \int_0^1 \binom{n}{i} x^i (1-x)^{n-i}\,\mathrm{d}x$$

Тогда значение АЧС в клетке можно вычислить приближенно через метод трапеций:

$$\frac{\mathrm{d}M[i]}{\mathrm{d}\phi} = \binom{n}{i} \sum_{k=0}^{N-1} \frac{x_{k+1}-x_k}{2} \cdot \left(x_k^i (1-x_k)^{n-i} + x_{k+1}^i (1-x_{k+1})^{n-i}\right)$$

То есть эта часть решения свелась к нахождению какой-то фиксированной константы, равной численному значению такого интеграла.

- $\boxed{\dfrac{\partial F}{\partial \phi}}$ Посмотрим на определение F из основной статьи:

$$F = \frac{1}{2}\sum_{i=1}^{P} \frac{\partial^2}{\partial^2 x_i} \frac{x_i(1-x_i)}{\nu_i}\phi - \sum_{i=1}^{P} \frac{\partial}{\partial x_i}\left(\gamma_i x_i (1-x_i) + \sum_{j=1}^{P} M_{i\leftarrow j}(x_j - x_i)\right)\phi - \frac{\partial}{\partial \tau}\phi$$

Тогда, сразу воспользовавшись тем что популяция у нас пока одна:

$$\frac{\partial F}{\partial \phi} = -\frac{1}{\nu} - \gamma(1-2x)$$

- $\boxed{\dfrac{\partial F}{\partial \theta}}$

Если рассмотреть численную схему вычисления φ, то получим следующее тождество:

$$A\varphi^{t+1} = \varphi^t + C$$

Где C — какая-то константа домноженная на базисный вектор, отвечающая за мутации, A — наша трехдиагональная матрица перехода, а φ — это вектора, отвечающие за значения функции на сетке в моментах времени $t+1$ и t. Распишем подробнее что же такое A и C в случае одной популяции:

  –
$$C = \frac{\Delta t}{x_1} \cdot \frac{\theta}{x_2 - x_0} \cdot \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 0 \\ \vdots \\ 0 \end{pmatrix}$$

  – Для подсчета матрицы A посмотрим на вывод трехдиагональной системы:

$$\frac{\phi_j^{t+1} - \phi_j^t}{\Delta t} = \frac{1}{\Delta_j}\left(F_{j+1/2}^{t+1} - F_{j-1/2}^{t+1}\right)$$
$$\phi_j^{t+1} - \frac{\Delta t}{\Delta_j}\left(F_{j+1/2}^{t+1} - F_{j-1/2}^{t+1}\right) = \phi_j^t$$

  При этом:

$$F_{j+1/2}^{t+1} = \frac{1}{x_{j+1}-x_j}\frac{1}{2\nu}\left(x_{j+1}(1-x_{j+1})\phi_{j+1}^{t+1} - x_j(1-x_j)\phi_j^{t+1}\right) - \frac{\gamma}{2}\frac{(x_j + x_{j+1})}{2}\left(1 - \frac{x_j + x_{j+1}}{2}\right)(\phi_j^{t+1} + \phi_{j+1}^{t+1})$$
$$F_{j-1/2}^{t+1} = \frac{1}{x_j - x_{j-1}}\frac{1}{2\nu}\left(x_j(1-x_j)\phi_j^{t+1} - x_{j-1}(1-x_{j-1})\phi_{j-1}^{t+1}\right) - \frac{\gamma}{2}\frac{(x_{j-1}+x_j)}{2}\left(1 - \frac{x_{j-1}+x_j}{2}\right)(\phi_{j-1}^{t+1} + \phi_j^{t+1})$$

Распишем их разницу в удобном формате:

$$
\begin{aligned}
F_{j+1/2}^{t+1} - F_{j-1/2}^{t+1} = \phi_{j-1}^{t+1} &\left(\frac{x_{j-1}(1-x_{j-1})}{2\nu(x_j - x_{j-1})} + \frac{\gamma}{2}\frac{x_{j-1}+x_j}{2}\left(1 - \frac{x_{j-1}+x_j}{2}\right)\right) \\
&+ \phi_j^{t+1}\left(-\frac{x_j(1-x_j)}{2\nu}\left(\frac{1}{x_{j+1}-x_j} + \frac{1}{x_j - x_{j-1}}\right)\right) \\
&+ \phi_j^{t+1}\left(\frac{\gamma}{2}\frac{x_{j-1}+x_j}{2}\left(1 - \frac{x_{j-1}+x_j}{2}\right) - \frac{\gamma}{2}\frac{x_j + x_{j+1}}{2}\left(1 - \frac{x_j + x_{j+1}}{2}\right)\right) \\
&+ \phi_{j+1}^{t+1}\left(\frac{x_{j+1}(1-x_{j+1})}{2\nu(x_{j+1}-x_j)} - \frac{\gamma}{2}\frac{x_j + x_{j+1}}{2}\left(1 - \frac{x_j + x_{j+1}}{2}\right)\right)
\end{aligned}
$$

Тогда, домножив это на $-\frac{\Delta t}{\Delta_j}$ и добавив 1 к коэффициенту при ϕ_j^{t+1} мы получаем следующие коэффициенты в трехдиагональной марице:

$$
\boxed{a_j} = -\frac{\Delta t}{\Delta_j}\left(\frac{x_{j-1}(1-x_{j-1})}{2\nu(x_j - x_{j-1})} + \frac{\gamma}{2}\frac{x_{j-1}+x_j}{2}\left(1 - \frac{x_{j-1}+x_j}{2}\right)\right)
$$

$$
\boxed{b_j} = 1 + \frac{\Delta t}{\Delta_j}\left(\frac{x_j(1-x_j)}{2\nu}\frac{\Delta_j}{(x_{j+1}-x_j)(x_j - x_{j-1})} - \frac{\gamma}{2}\frac{x_{j-1}+x_j}{2}\left(1 - \frac{x_{j-1}+x_j}{2}\right) + \frac{\gamma}{2}\frac{x_j + x_{j+1}}{2}\left(1 - \frac{x_j + x_{j+1}}{2}\right)\right)
$$

$$
\boxed{c_j} = \frac{\Delta t}{\Delta_j}\left(\frac{\gamma}{2}\frac{x_j + x_{j+1}}{2}\left(1 - \frac{x_j + x_{j+1}}{2}\right) - \frac{x_{j+1}(1-x_{j+1})}{2\nu(x_{j+1}-x_j)}\right)
$$

Производные коэффициентов по θ очевидны. Все формулы совпадают с исходным кодом $\partial a \partial i$.

В граничных точках получается следующая ситуация: $a_0 = c_G = 0$. При это c_0 и a_G совпадают с формулами выше. Осталось посмотреть на код и понять что происходит с коэффициентами b:

$$
b_0 = 1 + \frac{\Delta t}{\Delta_j}\left(\frac{x_0(1-x_0)}{2\nu(x_1 - x_0)} + \frac{\gamma}{2}\frac{x_0 + x_1}{2}\left(1 - \frac{x_0 + x_1}{2}\right)\right)
$$

$$
b_G = 1 + \frac{\Delta t}{\Delta_j}\left(\frac{x_G(1-x_G)}{2\nu(x_G - x_{G-1})} - \frac{\gamma}{2}\frac{x_{G-1}+x_G}{2}\left(1 - \frac{x_{G-1}+x_G}{2}\right)\right) + \frac{\Delta t}{\Delta_j}\left(\frac{1}{\nu} + \gamma \cdot x_G \cdot (1 - x_G)\right)
$$

Производная будет считаться следующим образом:

$$
\frac{\mathrm{d}\phi^{t+1}}{\mathrm{d}\theta} = \frac{\mathrm{d}A^{-1}}{\mathrm{d}\theta}(\phi^t + C) + A^{-1}\left(\frac{\mathrm{d}\phi^t}{\mathrm{d}\theta} + \frac{\mathrm{d}C}{\mathrm{d}\theta}\right)
$$