ESPACIOS MÉTRICOS. ORTONORMALIZACIÓN.

Dr. Roberto Eduardo Vieytes rvieytes@itba.edu.ar

Métodos Numéricos Avanzados, 93,75, 2^{do}C 2022





TEMARIO

- ESPACIOS NORMADOS
- ESPACIOS MÉTRICOS
- ORTOGONALIDAD Y COLINEALIDAD
 - Coordenadas de un Vector en una Base Ortonormal
 - Proyectores Ortogonales

- MÉTODO DE ORTOGONALIZACIÓN: GRAMD-SCHMIDT
- APROXIMACIÓN DE FUNCIONES
 POR POLINOMIOS ORTOGONALES
 - Bases Ortogonales en Espacios de Polinomios
 - Aproximación de Una Exponencial

PRODUCTO INTERNO EN UN ESPACIO VECTORIAL

* Un producto interno o escalar definido sobre $\mathbb V$ es una aplicación entre el conjunto de todos los pares de vectores $(\vec u, \vec v)$ y $\mathbb K$, cuyo resultado es un escalar; denotado por $\langle u, v \rangle$, que satisface las siguientes propiedades para todo $\vec u, \vec v, \vec w \in \mathbb V$ y todo escalar $\alpha \in \mathbb K$; ($\mathbb K = \mathbb R$ o $\mathbb C$):

$$\langle \cdot; \cdot \rangle \, \mathbb{V} \times \mathbb{V} \to \mathbb{K}$$

$$\mid \langle \vec{u} + \vec{v}; \vec{w} \rangle = \langle \vec{u}; \vec{w} \rangle + \langle \vec{v}; \vec{w} \rangle$$

$$|| \langle \alpha \vec{u}; \vec{v} \rangle = \alpha \langle \vec{u}; \vec{v} \rangle$$

III $\langle \vec{u}; \vec{v} \rangle = \langle \vec{v}; \vec{u} \rangle^*$ Donde * denota el conjugado del número complejo.

$$\forall \ \langle \vec{u}; \vec{u} \rangle \in \mathbb{R} \ y \ \langle \vec{u}; \vec{u} \rangle \geqslant 0; \ \text{la igualdad se da solo si} \ \vec{u} = 0$$

* Producto interno canónico en \mathbb{R}^n . Sean \vec{u} y \vec{v} dos vectores de \mathbb{R}^n , se define al producto interno canónico como:

$$\langle \vec{u}; \vec{v} \rangle = \sum_{i=1}^n u_i v_i$$

* Sea $V = \mathbb{R}_1[x]$ y definimos el producto interno:

$$\langle (a_0 + a_1 x); (b_0 + b_1 x) \rangle = a_0 b_0 + 2a_1 b_1$$

Verificar que cumple con las propiedades de un producto interno.

* Sean $p(x) = a_0 + a_1 x; \quad q(x) = b_0 + b_1 x; \quad t(x) = c_0 + c_1 x \in \mathbb{R}_1[x]$

$$egin{aligned} \langle (p+q);t
angle &= (a_0+b_0)c_0 + 2(a_1+b_1)c_1 \ &= a_0c_0 + b_0c_0 + 2a_1c_1 + 2b_1c_1 \ &= (a_0c_0 + 2a_1c_1) + b_0c_0 + 2b_1c_1) = \langle p;t
angle + \langle q;t
angle \end{aligned}$$

II)

$$\langle \alpha p; q \rangle = (\alpha a_0)b_0 + 2(\alpha a_1)b_1$$

= $\alpha(a_0b_0 + 2a_1b_1) = \alpha \langle p; q \rangle$

III Es trivial ya que los coeficientes son reales. iV)

$$\langle p; p \rangle = a_0^2 + 2a_1^2$$

es la suma de números positivos, la única posibilidad de que sea nulo es que ambos sumandos lo sean.

- Un mismo espacio vectorial puede tener varios productos internos
- st Sea $\mathbb{V}=\mathbb{R}_1[x]$ y definimos el producto interno para $p(x),q(x)\in\mathbb{R}_1[x]$

$$\langle (a_0 + a_1 x); (b_0 + b_1 x) \rangle = \int_{\infty}^{\infty} (a_0 + a_1 x)(b_0 + b_1 x)e^{-x^2} dx$$

Verifica que cumple con las propiedades de un producto interno. (DIY)

Sea $\mathbb V$ es espacio vectorial de funciones reales periódicas en el intervalo $[0;2\pi]$ Se define el producto interno para $f_1,f_2\in\mathbb V$ como

$$\langle f_1; f_2 \rangle = \int\limits_0^{2\pi} f_1(x) f_2(x) dx$$

ESPACIOS NORMADOS CON NORMA INDUCIDA

Sea V un espacio vectorial sobre un cuerpo K; se define una norma sobre V a una función | | | : V → R₀⁺ que cumple:

$$\begin{array}{l} \mid \text{ si } \vec{u} \in \mathbb{V}; \|\vec{u}\| \geqslant 0; \|\vec{u}\| = 0 \text{ sii } \vec{u} = 0_{\mathbb{V}}. \\ \mid \mid \text{ si } \alpha \in \mathbb{K} \text{ y } \vec{u} \in \mathbb{V} \text{ } \|\alpha\vec{u}\| = |\alpha| \|\vec{u}\|. \end{array}$$

III Si \vec{u} y $\vec{v} \in \mathbb{V}$, $\|\vec{u} + \vec{v}\| \leqslant \|\vec{u}\| + \|\vec{v}\|$ (designaldad triangular).

Dado el espacio vectorial V con el producto interno ⟨.;.⟩ este induce la norma en V según:

$$\|\vec{u}\|_2 = \sqrt{\langle \vec{u}; \vec{u} \rangle}.$$

- * Dado un espacio vectorial V, normado, se define la distancia entre dos vectores como:
- * La distancia entre \vec{u} y $\vec{v} \in \mathbb{V}$ como:

$$d(\vec{u}; \vec{v}) = \|\vec{u} - \vec{v}\|$$

Usualmente se utiliza $\|\cdot\|_2$ como norma y verifica:

- **DI.1** $d(\vec{u}; \vec{v}) \geqslant 0$
- **DI.2** Se verifica la igualdad solo si $\vec{u} = \vec{v}$.
- **DI.3** $d(\vec{u}; \vec{v}) = d(\vec{v}; \vec{u})$
- **DI.4** $d(\vec{u}; \vec{w}) \leqslant d(\vec{u}; \vec{v}) + d(\vec{v}; \vec{w})$ (Designaldad triangular en distancia)
- **DI.5** Dado dos vectores \vec{u} y \vec{v} de un espacio vectorial normado se verifica que: $|\langle \vec{u}; \vec{v} \rangle| \leqslant \|\vec{u}\| \|\vec{v}\|$ (Desigualdad de Cauchy–Schwarz)

- Calculemos la distancia entre p(x) = 1 y $q(x) = 1 + 2x \in \mathbb{R}_1[x]$ que derivan de las normas definidas en los ejercicios 1 y 2.
- * q(x) p(x) = 2x
- Para la norma del ejemplo $1\langle 2x;2x\rangle=22^2=8$ por lo tanto la distancia queda $d(2x;2x)=\sqrt{8}$.
- Con la norma definida en el ejemplo 2

$$d(2x,2x) = \sqrt{\int\limits_{-\infty}^{\infty} 2xe^{-x^2} dx} = 0$$

ESPACIOS MÉTRICOS: ÁNGULO ENTRE DOS VECTORES REALES

* Sea V;un espacio vectorial real, con un producto interno $\langle \cdot \rangle$ y la norma que él induce $\| \cdot \|$. Se define el ángulo entre los vectores \vec{u} y \vec{v} de ese espacio como:

$$\cos\theta_{\vec{u}\vec{v}} = \frac{\langle \vec{u}; \vec{v} \rangle}{\|\vec{u}\| \|\vec{v}\|}$$

La desigualdad de Cauchy-Schwarz establece que $-1\leqslant\cos heta_{ec{u}ec{v}}\leqslant+1$

* Si el espacio no es real, $\theta_{\vec{u}\vec{v}}$ podría ser complejo y su tratamiento cae fuera de este curso.

- * ¿Cuál es el ángulo entre los polinomios p(x) = 1 y q(x) = 1 + 2x con el producto interno definido en el ejemplo 1?
- * $\langle p; q \rangle = 1 \cdot 1 + 2 \cdot 0 \cdot 2 = 1$
- * $\|p\| = \sqrt{1^2 + 2 \cdot 0^2} = 1$; $\|a\| = \sqrt{1^2 + 2 \cdot 2^2} = 3$
- $*\cos\theta_{pq} = \frac{2}{1.2} = \frac{2}{2}$
- * ¿Cuál es el ángulo entre las funciones sen(x) y cos(x) con el producto interno definido para funciones periódicas en el ejemplo 2?
- * $\langle \operatorname{sen}(x); \cos(x) \rangle = \int_0^{2\pi} \operatorname{sen}(x) \cos(x) dx = 0$ Por lo tanto el ángulo buscado es $\pi/2$.

- Al tener definido el ángulo entre dos vectores, se puede definir dos conceptos importantes: Ortogonalidad y Colinealidad.
- * Se dice que los vectores \vec{u} y \vec{v} de un espacio vectorial real, son ortogonales si $\langle \vec{u}; \vec{v} \rangle = 0$ y se notará $\vec{u} \perp \vec{v}$.
- * Se dice que dos vectores \vec{u} y $\vec{v} \in \mathbb{V}$ son colineales si existe un escalar $\alpha \in \mathbb{K}$ tal que $\vec{u} = \alpha \vec{v}$. Se notará que dos vectores son colineales con $\vec{u} \parallel \vec{v}$.
- * Un conjunto $B=\{\vec{b}_1;\ldots;\vec{b}_n\}$ de vectores se llamará ortogonal si $\left<\vec{b}_i;\vec{b}_j\right>=0\, orall i,j.$
- * Si son linealmente independientes, formarán una base ortogonal.
- st Y si, ademas $\left\langle ec{b}_{i};ec{b}_{i}
 ight
 angle =1$ el conjunto/base se llamará ortonormal.

Coordenadas de un Vector en una Base Ortonormal

- Si la base en la cual queremos conocer un vector es ortonormal, obtener sus coordenadas es inmediato.
- * En efecto sea $B=\{\vec{v}_1;\cdots;\vec{v}_n\}$ una base ortonormal de $\mathbb V$ y sea $\vec{u}\in\mathbb V$, entonces

 $\vec{u} = \sum_{i=1}^n \alpha_1 \vec{v}_i$; tomando producto interno con cada uno de los elementos de la base

$$\langle \vec{v}_j; \vec{u} \rangle = \sum_{i=1}^n \alpha_1 \langle \vec{v}_j; \vec{v}_i \rangle = \alpha_j$$

- * Encontremos las coordenadas del vector $\vec{u}=(3;2)'$ (expresado en la base canónica) en la base $\{\frac{1}{\sqrt{5}}(1;2)';\frac{1}{\sqrt{5}(2};-1)'\}$
- * $\vec{u} = (3;2)' = \frac{\alpha_1}{\sqrt{5}}(1;2)' + \frac{\alpha_2}{\sqrt{5}(}2;-1)'$
- * $\alpha_1 = \langle (3;2)'; (1;2)' \rangle = 3 \cdot 1 + 2 \cdot 2 = 7;$
- * $\alpha_2 = \langle (3;2)'; (2;-1)' \rangle = 3 \cdot 2 + 2 \cdot (-1) = 4$

RVIEYTES ESPACIOS MÉTRICOS 12 / 29

- * Sean \mathbb{S}_1 y \mathbb{S}_2 subespacios de \mathbb{V} ; B_1 una base ortogonal de \mathbb{S}_1 y B_2 una base ortogonal de \mathbb{S}_2 ; se dirán que son \mathbb{S}_1 y \mathbb{S}_2 son ortogonales si $B_1 \cup B_2$ es un conjunto ortogonal (no necesariamente una base de \mathbb{V}). Si la unión de las bases generan \mathbb{V} a \mathbb{S}_2 se lo denomina complemento ortogonal de \mathbb{S}_1 .
- Nos resultará muy útil en lo que sigue lograr descomponer un vector \vec{u} en dos subespacios ortogonales; es decir escribir:

$$\vec{u} = \vec{v} + \vec{w}$$
 con $\vec{v} \in \mathbb{S}_1$ y $\vec{w} \in \mathbb{S}_2$

EJEMPLO 5

- * Se tiene el subespacio vectorial $\Pi \subset \mathbb{R}^3$ definido por $\{\vec{x} \in \mathbb{R}^3/3x_1 + 2x_2 3x_3 = 0\}$. Hallemos una base Π y una de su complemento ortogonal L.
- ¿Qué dimensión tiene Π? (dimensión del espacio que lo contiene número de ecuaciones que lo definen =2, se trata de un plano).
- * La ecuación del plano la podemos escribir como $\langle (3;2;-3)';\vec{x}\rangle=0$. Lo cual indica que el complemento ortogonal a Π , una recta, es generada por (3;2;-3)'
- * Para hallar la base de Π debemos encontrar dos soluciones independientes de $3x_1+2x_2-3x_3=0$ que pueden ser (1;0;1)' y $0(0;\frac{3}{2};1)'$

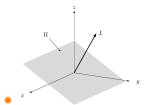


FIGURA: Plano y recta ortogonales en \mathbb{R}^3

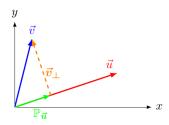
PROYECTORES ORTOGONALES

- * ¿Dado $\vec{v} \in \mathbb{R}^3$ como hallar "su parte" en L y su parte en Π ?.
- * Para esto tenemos que introducir la idea de Proyector de un vector \vec{v} , en una dirección prefijada \vec{u} : $\mathbb{P}_{\vec{u}}(\vec{v})$ definido por:

$$\mathbb{P}_{\vec{u}}(\vec{v}) = \frac{\langle \vec{u}; \vec{v} \rangle}{\|\vec{u}\|^2} \vec{u} \tag{1}$$

Esta expresión nos da la parte en L del vector, la parte en Π se obtiene por diferencia (pues Π es el complemento ortogonal a L).

$$\vec{v}_{\perp} = \vec{v} - \mathbb{P}_{\vec{u}}(\vec{v})$$



* Un proyector puede pensarse como una transformación lineal y su matriz es idempotente, es decir $\mathbb{P}^2 = \mathbb{P}$.

EJEMPLO 6

- Encontremos la base ortogonal de II a partir de la encontrada en el ejemplo 5.
- * Π : $Gen\{(1;0;1)';(0;\frac{3}{2};1)'\}$ Tomamos el primer vector como \vec{u} y calculamos

$$\mathbb{P}_{\vec{u}}(\vec{v}) = \frac{\left\langle (1;0;1)'; (0;\frac{3}{2};1)' \right\rangle}{\left\langle (1;0;1)'; (1;0;1)' \right\rangle} (1;0;1)' = \frac{1}{2} (1;0;1)'$$

* Ahora calculamos $ec{v}_{\perp}$

$$\vec{v}_{\perp} = (0; \frac{3}{2}; 1)' - \frac{1}{2}(1; 0; 1)' = \left(-\frac{1}{2}; \frac{3}{2}; \frac{1}{2}\right)'$$

- y como son combinación lineal de los elementos de una base, general el mismo subespacio.
- Si quisiéramos una base ortonormal, nos restaría dividir a cada vector por su norma:

$$B_{ortonormal} = \left\{ \frac{1}{\sqrt{2}} (1;0;1)'; \frac{1}{\sqrt{11}} (-1;3;1)' \right\}$$

- * ¿Y si tenemos "muchos vectores"?
- SNU Octave tiene el comando orth (A) que nos entrega una matriz cuyas columnas forman un conjunto ortonormal de vectores que generan el mismo subespacio que las columnas de A.

RVIEYTES ESPACIOS MÉTRICOS 16/

Ortonormalización de Conjuntos Finitos de Vectores

- El procedimiento que se presenta a continuación, denominado Método de Gramd-Schmidt Clásico nos permitirá lograr el objetivo.
- * El primer paso es elegir un vector de $B \in \mathbb{R}^n$ y asignamos a \hat{q}_1 el versor correspondiente. $\hat{q}_1 \longleftarrow \frac{\vec{u}_1}{\|\vec{u}_1\|}$
- * Elegimos \vec{q}_2 como el vector complementario $\vec{q}_2 = \vec{u}_2 \mathbb{P}_{\hat{q}_1}(\vec{u}_2) = \vec{u}_2 \langle \hat{q}_1; \vec{u}_2 \rangle \, \hat{q}_1$
- st y lo normalizamos $\hat{q}_2 \longleftarrow rac{ec{q}_2}{\|ec{q}_2\|}$
- * para q_3 tendremos $ec{q}_3 = ec{u}_3 \mathbb{P}_{\hat{q}_1}(ec{u}_3) \mathbb{P}_{\hat{q}_2}(ec{u}_3) = ec{u}_3 \langle \hat{q}_1; ec{u}_3 \rangle \, \hat{q}_1 \langle \hat{q}_2; ec{u}_3 \rangle \, \hat{q}_2$ $\hat{q}_3 \longleftarrow \frac{ec{q}_3}{\|ec{q}_3\|}$
- * y así seguimos hasta agotar los vectores del conjunto B $\vec{q}_p = \vec{u}_p \sum_{l=1}^{p-1} \mathbb{P}_{\hat{q}_l}(\vec{u}_l) = \vec{u}_p \sum_{l=1}^{p-1} \left\langle \hat{q}_l; \vec{u}_l \right\rangle \hat{q}_l$ $\hat{q}_p \longleftarrow \frac{\vec{q}_p}{\|\vec{q}_p\|}$
- * El guión en GNU Octave CLGRSCH(V) que figura en los apuntes permite realizar este procedimiento.

PROBLEMAS DEL MÉTODO CLÁSICO

- * Una forma de verificar el trabajo realizado por el método de Gramd-Schimidt, es armar la matriz $\boldsymbol{Q} \in \mathbb{R}^{n \times p}$ colocando como columnas los vectores ortonormalizados y calculando $\boldsymbol{Q}'\boldsymbol{Q} \in \mathbb{R}^{p \times p}$
- * Esta cuenta es equivalente a calcular los productos escalares entre las columnas de ${\bf g}$ que al ser ortonormales daría $\mathbb{I}_{p \times p}$
- una medida sería

$$e = \| \boldsymbol{Q}' \boldsymbol{Q} - \mathbb{I}_{p \times p} \|$$

- st Si $e\ll 1$ el método es correcto, pero de lo contrario no.
- * Analicemos qué ocurre si aplicamos CLGRSCH(V a la matriz

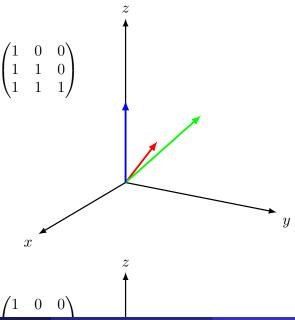
$$\mathbf{V} = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 \\ 10^{-8} & 0 & 0 \\ 0 & 10^{-8} & 0 \\ 0 & 0 & 10^{-8} \end{pmatrix}$$

Notemos que los vectores son casi paralelos

```
* >> format long
 >> e= 1e-8;
 >> V=[ 1 1 1; e 0 0; 0 e 0; 0 0 e]
 V =
    1.00000...e+00 1.00000,,,e+00 1.00000...e+00
    1.00000...e-08 0.00000...e+00 0.00000...e+00
    0.00000...e+00 1.00000...e-08 0.00000...e+00
    0.00000...e+00 0.00000...e+00 1.00000...e-08
  >> q=CLGRSCH(V)
 q =
    1.00000...e+00 0.00000...e+00 0.00000...e+00
    1.00000...e-08 -7.07106...e-01 -7.07106...e-01
    0.00000...e+00 7.07106...e-01 0.00000...e+00
    0.00000...e+00 0.00000...e+00 7.07106...e-01
  >> norm(q'*q-eye(3),'fro')
 ans = 7.071067811865476e-01
  ¡Un error monstruosamente grande!
```

- Veamos la ortogonalidad de los vectores encontrados
- * >> q(:,1)'*q(:,2)
 ans = -7.071067811865475e-09
 >> q(:,1)'*q(:,3)
 ans = -7.071067811865475e-09
 >> q(:,2)'*q(:,3)
 ans = 4.9999999999999e-01
- * Observamos que la primer columna (q(:,1)) es perpendicular con un error aceptable tanto a q(:,2) como a q(:,3)
- * Sin embargo q(:,2) y q(:,3) no pueden considerarse ortogonales.
- El método arrastra muchos errores de truncamiento.

ANIMACIÓN GS CLÁSICO



RVIEYTE

- El núcleo del problema está en que se proyecta el vector original sobre la base ortonormal encontrada
- for i = 1:n
 v=V(:,i);
 for k = 1:i-1
 v = v (q(:,k)'*V(:,i))*q(:,k);
 endfor
 q(:,i)=v/norm(v);
 endfor
- se puede ganar estabilidad si se proyecta el último vector generado
- for i = 1:n
 q(:,i) = V(:,i);
 for k = 1:i-1
 q(:, i) = q(:, i)-q(:, k)'*q(:, i)*q(:, k);
 endfor
 q(:, i) = q(:, i)/norm(q(:, i));
 endfor

- En el método de Gramd-Schmidt clásico (CLGRSCH), tomamos cada vector, uno a la vez, y lo hacemos ortogonal a todos los vectores anteriores. En Gramd-Schmidt modificado (MOGRSCH), tomamos cada vector y modificamos todos los vectores siguientes para que sean ortogonales a él.
- Experimento numérico

```
>> n=200;
>> A=1e-6*eye(n)+hilb(n);
>> Q=CLGRSCH(A);
>> norm(Q'*Q-eye(n))
ans = 179.85
>> [Q e]=MOGRSCH(A);
>> e
e = 4.0074e-10
>> Q=orth(A);
>> norm(Q'*Q-eye(n))
ans = 7.4384e-15
```

- * La función orth () usa un mejor algoritmo para ortonormalizar las columnas de la matriz **A** ¿Cual será?
- Respuesta Clase 11.

BASES ORTOGONALES EN ESPACIOS DE POLINOMIOS

* Sea $\mathbb{R}_2[t]$ el conjunto de polinomios de grado menor o igual a dos con coeficientes reales en el intervalo [0;1]. Una base para este espacio podría ser $B=\{1;t;t^2\}$. Encontremos una base ortonormal para este espacio con el producto interno definido por

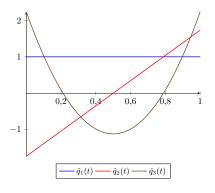
$$\langle p;q \rangle = \int\limits_0^1 p(t) \, q(t) \, dt$$

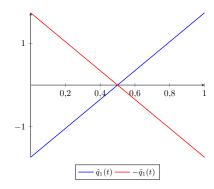
st Aplicaremos el método de Gramd–Schmidt para generar los \hat{q}_i :

$$egin{aligned} q_1(t) &= 1 & \hat{q}_1(t) &= 1 \ & q_2(t) &= t - \mathbb{P}_{\hat{q}_1}(t) &= t - \left(\int\limits_0^1 t \, 1 \, dt
ight) \, 1 &= t - rac{1}{2} \ & \langle q_2(t); q_2(t)
angle &= \int\limits_0^1 (t - rac{1}{2})^2 \, dt &= rac{1}{12} & \hat{q}_2(t) &= \sqrt{12} \left(t - rac{1}{2}
ight) \end{aligned}$$

RVIEYTES ESPACIOS MÉTRICOS 24/2

Cualquier polinomio de grado menor o igual que 2, se escribirá exactamente como combinación lineal de los $\hat{q}_i(t)$.





* Ortogonales no significa lo mismo que perpendiculares.

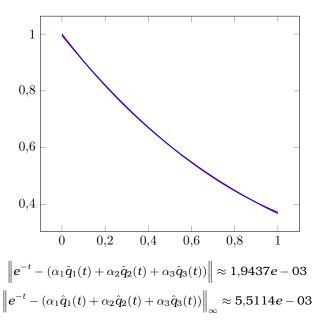
APROXIMACIÓN DE FUNCIONES POR POLINOMIOS ORTOGONALES

- * ¿Y si queremos aproximar e^{-t} en el intervalo [0; 1]?
- La exponencial no es un polinomio de grado finito.
- st Podemos encontrar una aproximación si la "proyectamos" en $\mathbb{R}_2[x]$
- Para ello utilizamos la base ortonormal encontrada y

$$e^{-t} \approx \alpha_1 \hat{q}_1 + \alpha_2 \hat{q}_2 + \alpha_3 \hat{q}_3$$

* con $\alpha_i = \int_0^1 e^{-t} \hat{q}_i \, dt$

$$\begin{split} &\alpha_1 = 1 - e^{-1} = 0,6321...\\ &\alpha_2 = \sqrt{3} \left(1 - 3e^{-1} \right) = -0,1795...\\ &\alpha_3 = \sqrt{5} \left(7 - 19e^{-1} \right) = 0,0230... \end{split}$$



LICENCIA DE DISTRIBUCIÓN

Este documento fue realizado en <u>ETE</u>X con la clase beamer. Muchas de las figuras se realizaron con Tikz con el editor KTikz, los cálculos y simulaciones con GNU Octave y GNU Maxima.



Esta obra se distribuye bajo licencia: Atribución – Compartir Igual (by-nc-sa):

- * by: para usar una obra en cualquier tipo de medio es imprescindible citar al autor de forma explícita.
- nc: El beneficiario de la licencia tiene el derecho de copiar, distribuir, exhibir y representar la obra y hacer obras derivadas para fines no comerciales.
- sa: se puede usar una obra para crear otra, siempre y cuando esta se publique con la misma licencia que la obra original.