Сингулярное разложение матриц

1. Матричные разложения

Спектральное разложение

Представление матрицы в виде произведения некоторых других, обладающих определенными свойствми, называется матричным разложением. Примером матричного разложения может служить спектральное разложение симметричной матрицы X. По теорема о приведении самосопряженных опреаторов к диагональному виду:

$$X = S^T \cdot D \cdot S,$$

где S — ортогональная матрица, а $D = \operatorname{diag}(\lambda_1, ..., \lambda_i)$ — диагональная матрица из собственных значений матрицы X.

Часто в приложениях встречаются так называемые квадратичные формы, то есть функции вида $f(y) = y^T X y$, где X — симметричная матрица. С помощью спектрального разложения матрицы X можно привести квадратичную форму к более простому виду:

$$f(y) = y^T \cdot S^T \cdot D \cdot S \cdot y = (S \cdot y)^T \cdot D \cdot (S \cdot y) = z^T \cdot D \cdot z = \sum_{i=1}^{n} \lambda_i z_i^2,$$

где была введена естественная замена $z = S \cdot y$.

Сингулярное разложение

В случае произвольной матрицы X имеет место так называемое сингулярное разложение. Пусть X — произвольная матрица, тогда существуют такие ортогональные матрицы U и V, а также диагональная матрица D, что:

$$X = U \cdot D \cdot V.$$

Сингулярное разложение раскрывает геометрическую структуру линейного преобразования, задаваемого матрицей X: представляет его в виде последовательных вращения, рястяжения по осям и еще одного вращения.

Сингулярное разложение имеет множество практических приложений. В том числе и в области анализа данных.

2. Приближение матрицей меньшего ранга

Оценка ранга произведения матриц

Рангом (строчным и столбцовым) матрицы называется соответственно максимальное количество линейно независимых строк или столбцов. Одним из ключевых результатов линейной алгебры является то, что строчный ранг совпадает со столбцовым рангом и равен максимальному размеру невырожденной подматрицы. То есть ранг матрицы $X \in \mathbb{R}^{n \times m}$ размера $n \times m$ не может превосходить ни число строк, ни число столбцов в этой матрице:

$$X \in \mathbb{R}^{n \times m} \implies \operatorname{rg}(X) \leq \min(n, m).$$

Пусть теперь матрица $X \in \mathbb{R}^{n \times m}$ представляет собой произведение матриц $A \in \mathbb{R}^{n \times k}$ и $B \in \mathbb{R}^{k \times m}$, причем причем $k < \min(n, m)$. В таком случае $\operatorname{rg}(A) \leq k,\ \operatorname{rg}(B) \leq k$, а следовательно и для ранга матрицы $X = AB$ будет верна оценка $\operatorname{rg}(X) \leq k$.

Ранг матрицы и сжатие без потерь

Более того, всякую матрицу $X \in \mathbb{R}^{n \times m}$ ранга k можно представить в виде произведения матриц A и B размеров $n \times k$ и $k \times m$ соответственно.

Доказательство: Поскольку $\operatorname{rg} X = k$, в матрице X существует система из k линейно независимых столбцов и всякий столбец матрицы X представим в виде линейной комбинации столбцов этой системы.

Пусть теперь матрица B составлена из коэффициентов разложения произвольного столбца матрицы X, а матрица A — из вышеупомянутой системы столбцов. Тогда по построению:

$$X = AB, \qquad A \in \mathbb{R}^{n\times k}, \qquad B \in \mathbb{R}^{k\times m}.$$

Это и есть искомое матричное разложение. И поскольку по матрицам A и B исходная матрица X восстанавливается точно, говорят, что происходит сжатие без потерь. Именно поэтому о ранге можно говорить как о мере информационной наполненности матрицы.

Аппроксимация матрицей меньшего ранга

В практических задачах данные всегда измеряются вместе с шумом и поэтому не вся информация, содержащаяся в матрице с данными представляет ценность для исследователя. Таким образом, ставится задача о нахождении лучшей аппроксимации исходной матрицы X некоторой матрицой, ранг которой не превосходит $r < k$. Любая матрица ранга r может быть представлена как произведение следующих матриц:

$$U \cdot V^T, \qquad U \in \mathbb{R}^{m\times k}, \quad V \in \mathbb{R}^{n\times k}.$$

Поэтому удобно переформулировать задачу: требуется найти такие матрицы $U \in \mathbb{R}^{m\times k}$ и $V \in \mathbb{R}^{n\times k}$, что матрица X и UV^T будут отличаться не сильно. Для оценки степени близости объектов используется понятие нормы. Для оценки близости матриц обычно используется так называется норма Фробениуса:

$$\|A\|_2 = \sqrt{\sum_{i,j} |a_{ij}|^2}.$$

В конечном итоге, задача приближения матрицы матрицей меньшего ранга примет вид:

$$U, V = \underset{U\in\mathbb{R}^{m\times k}, V\in\mathbb{R}^{n\times k}}{\operatorname{argmin}} \sum_{i,j} \left(x_{ij} - u_i v_j^T\right)^2,$$

а искомой матрицей, дающей наилучшее приближение при заданном ранге, будет матрица UV^T.

Преобразование признаков

Пусть X — матрица признаков объектов. Пусть для X построено наилучшее приближение матрицей UV^T ранга $k < n$, где n — количество признаков в исходной задаче.

Матрица U может быть проинтерпретирована как матрица новых признаков тех же объектов. При этом размерность пространства признаков уменьшается — происходит сжатие с потерями, причем теряется минимум полезной информации.

Задача рекомендации

Пусть X — матрица с оценками, которые поставил или поставил бы пользователь под номером i фильму под номером j. Поскольку далеко не все пользователи смотрели все фильмы и выставили оценку, известны не все элементы этой матрицы.

Чтобы спрогнозировать неизвестные данные, можно попытаться приблизить исходную матрицу с помощью матрицы меньшего ранга. В таком случае в качестве нормы следует использовать норму Фробениуса, где суммирование идет только по известным элементам матрицы X. После того, как наилучшее приближение по известным данным было найдено, эту матрицу можно использовать, чтобы спрогнозировать еще не известные данные.

3. Сингулярное разложение и низкоранговое приближение

Пусть задана матрица X. Требуется найти такую матрицу, ранг которой $\operatorname{rg} \hat{X} \leq k$, которая наилучшим образом приближает исходную:

$$\hat{X} = \underset{\operatorname{rg} \hat{X} \leq k}{\operatorname{argmin}} \left\| X - \hat{X} \right\|$$

SVD для исходной матрицы имеет вид:

$$X = U \cdot D \cdot V^T,$$

где U и V — ортогональные (то есть и невырожденные) матрицы, а D — диагональная матрица ранга $\operatorname{rg} X$. Можно сделать естественную замену искомой матрицы $\hat{X}$ на матрицу $\hat{D}$ (не обязательно диагональную, поэтому это тождественное преобразование):

$$\hat{X} = U \cdot \hat{D} \cdot V^T.$$

Задача перепишется в виде:

$$\hat{X} = \underset{\operatorname{rg} \hat{D} \le k}{\operatorname{argmin}} \left\| U \cdot (D - \hat{D}) \cdot V^T \right\| = \underset{\operatorname{rg} \hat{D} \le k}{\operatorname{argmin}} \left\| D - \hat{D} \right\|.$$

Поскольку матрица D — диагональная, все недиагональные элементы в матрице $\hat{D}$ должны быть равными нулю (в ином случае это может только увеличить норму разницы). В матрице $\hat{D}$ может быть максимум k ненулевых элементов (по условию на ранг $\hat{X}$). Поэтому чтобы обеспечить минимум $\left\| D - \hat{D} \right\|$ выберем $\hat{D}$ равной матрице D, в которой все кроме k наибольших по модулю диагональных элементов заменены нулями.

Таким образом, наилучшим приближением матрицы X матрицей ранга k будет

$$\hat{X} = U \cdot \hat{D} \cdot V^T,$$

где матрица $\hat{D}$ — это матрица D, в которой все кроме k наибольших по модулю диагональных элементов заменены нулями.

Следует отметить, что и матричное разложение $X = AB$ определено неоднозначно. В первом случае для любой невырожденной матрицы R нужного размера можно записать:

$$X = AB = AIB = AR^{-1}RB = A'B'.$$

A' и B' тоже будут образовывать некоторое другое разложение матрицы X. Это создает целый ряд проблем при решении задач рекомендаций и подробно будет обсуждаться в соответствующем курсе.