

The background of the entire page is a close-up photograph of green leaves, likely from a plant like a peace lily, with several water droplets resting on their surfaces. The lighting is soft, creating a natural and fresh aesthetic.

Métodos numéricos

Handbook

Fernando Pujaico Rivera

Copyright © 2019 Fernando Pujaico Rivera

PUBLICADO POR VIRTUAL BOOKS

BOOK-WEBSITE.COM

Esta obra está licenciada com uma Licença Creative Commons Atribuição-NãoComercial-CompartilhaIgual 4.0 Internacional. Não é possível usar este arquivo excepto em conformidade com a Licença. Pode obter uma copia de la Licença em <http://creativecommons.org/licenses/by-nc-sa/4.0/>.

Primeira impressão , Março 2019

Amicum lege feliciter; vivas, gaudeas, floreas in Deo.

Fernando

Dou muitas graças a Deus

Conteúdo

Lista de símbolos	11
-------------------------	----

I	Derivadas de funções e operadores	
1	Funções e operadores notáveis	17
1.1	Operador derivada para $e(x)$, $f(x)$ e $G(x)$	17
1.2	Derivadas notáveis: Gradiente, Matriz Hessiana, Matriz Jacobiana	18
1.3	Serie de Taylor de $d(x)$, $e(x)$ e $f(x)$	19
2	Derivada de funções: $\mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$	23
2.1	Derivada de Ax	23
2.2	Derivada de $\ Ax\ ^2$	24
2.3	Derivada de $\ Ax - b\ _C^2$	24
2.4	Derivada de $\ f(x) - b\ _C^2$	25
2.5	Derivada de segundo ordem de $\ f(x) - b\ _C^2$	25
2.6	Derivada de $\ f(x) - b\ _C^2 + \alpha\ x - q\ _D^2$	26
2.7	Provas dos teoremas	27
II	Problemas de minimização de erro em funções	
3	Minimização do erro em funções: $\mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$	33
3.1	Minimização de $\ Ax - b\ _C^2$	33

3.2	Minimização de $\ f(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\ _{\mathbf{C}}^2$	33
3.3	Minimização de $\ f(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\ _{\mathbf{C}}^2 + \alpha \ \mathbf{x} - \mathbf{q}\ _{\mathbf{D}}^2$	34
3.4	Minimização de $\ f(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\ _{\mathbf{C}}^2 + \alpha \ \mathbf{x}\ _{\mathbf{D}}^2$	34
3.5	Minimização de $\ f(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\ _{\mathbf{C}}^2 + \alpha \ \mathbf{x} - \mathbf{x}_{last}\ _{\mathbf{D}}^2$	35
3.6	Provas dos teoremas	36
4	Minimização do erro em funções: $\mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$	39
4.1	Minimização de $\ h(x) - a\ ^2$	39
4.2	Minimização de $\ h(x) - a\ ^2 + \alpha \ x - b\ ^2$	41
4.3	Minimização de $\ h(x) - a\ ^2 + \alpha \ x - x_{old}\ ^2$	44
4.4	Provas dos teoremas	45

III

Problemas de achar raízes de funções

5	Raízes de funções: $\mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$	51
5.1	Raiz de $h(x)$ acotada entre a e b	51
5.1.1	Método de la falsa posición	51
5.1.2	Método de bisección	51
5.2	Raiz de $h(x)$ não acotada (Métodos iterativos)	51
5.2.1	Método de las aproximaciones sucesivas	51
5.2.2	Método de la secante	51
5.2.3	Método de Newton	51
	Bibliography	53
	Miscelânea	53
	Livros	53
	Artigos	53
	Index	55



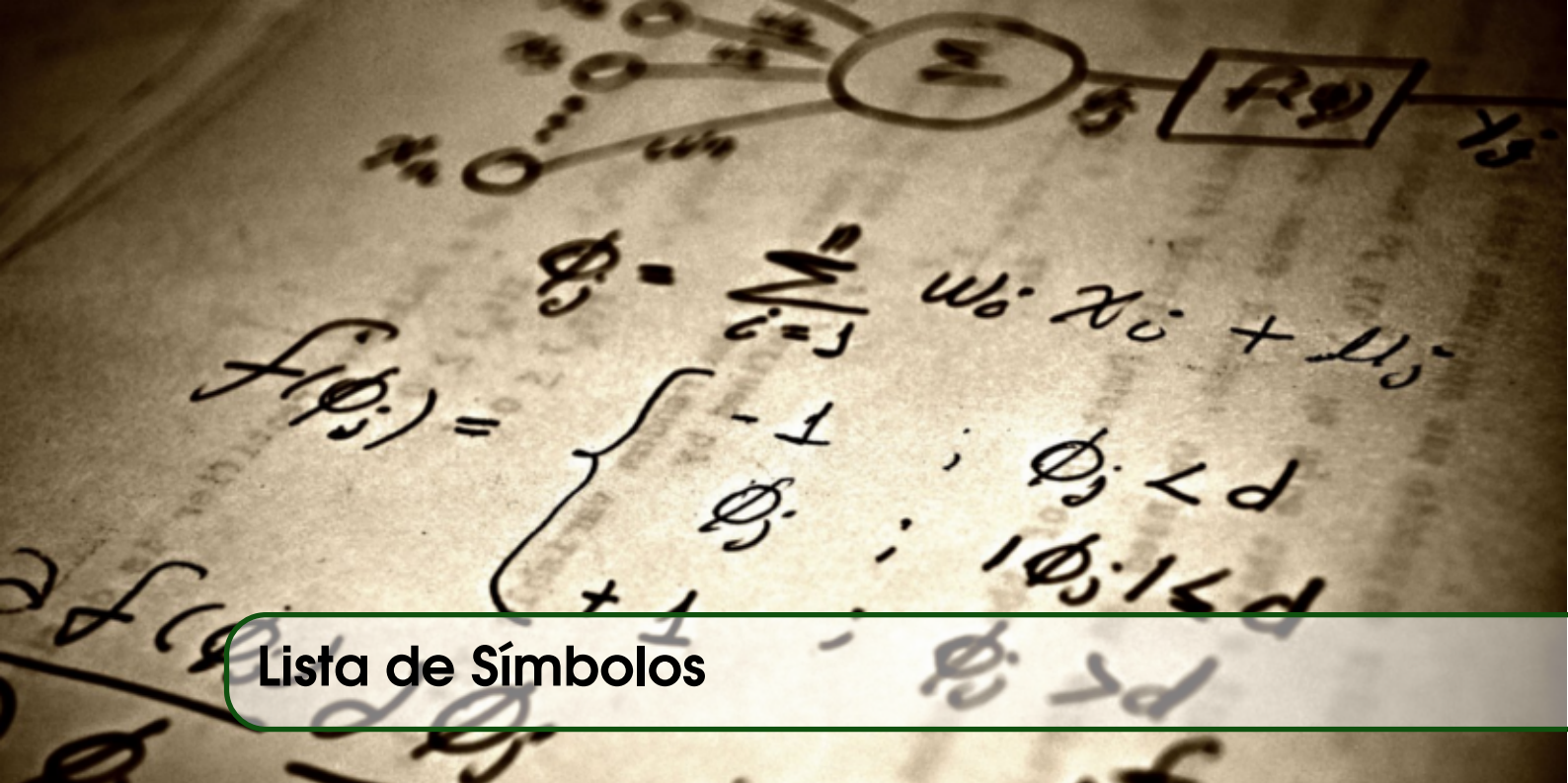
Lista de figuras

- 1.1 Aproximação da função $\cos(x)$ usando a serie de Taylor truncada. 20
- 4.1 Comportamento para $h(x) = x^2$ da equação iterativa do Teorema 4.1.1 . 41
- 4.2 Comportamento para $h(x) = x^3$ da equação iterativa do Teorema 4.1.1 . 41
- 4.3 Comportamento para $h(x) = x^2(x^2 - 1)$ da equação iterativa do Teorema 4.2.1 43
- 4.4 Comportamento para $h(x) = (x + 0.5)^3$ da equação iterativa do Teorema 4.2.1 44



Lista de tabelas

- 4.1 Convergência para $h(x) = x^2$ da equação iterativa do Teorema 4.1.1 ... 40
- 4.2 Convergência para $h(x) = x^3$ da equação iterativa do Teorema 4.1.1 ... 41
- 4.3 Convergência para $h(x) = x^2(x^2 - 1)$ da equação iterativa do Teorema 4.2.1
- 43
- 4.4 Convergência para $h(x) = (x + 0.5)^3$ da equação iterativa do Teorema 4.2.1
- 44



Lista de Símbolos

Conjuntos numéricos

Símbolo	Descrição
\mathbb{Z}	Conjunto dos números inteiros.
\mathbb{Z}^N	Espaço em N dimensões dos números inteiros.
\mathbb{N}	Conjunto dos números naturais.
\mathbb{N}^N	Espaço em N dimensões dos números naturais.
\mathbb{R}	Conjunto dos números reais.
\mathbb{R}^N	Espaço em N dimensões dos números reais.
\mathbb{C}	Conjunto dos números complexos.
\mathbb{H}	Conjunto dos quaterniones.

Tipos de Dados

Tipo	Descrição	Formatação
A, B, ..., X, Y, Z	Matriz.	Maiúsculo e negrito
a, b, ..., x, y, z	Vetor (Por falta é asumido que é um vetor coluna) ou conjunto.	Minúsculo e negrito
<i>a, b, ..., x, y, z</i>	Escalar variável.	Minúsculo
<i>A, B, ..., X, Y, Z</i>	Escalar constante.	Maiúsculo
$\alpha, \beta, ..., \chi, \psi, \omega$	Escalar variável ou constante.	Letras gregas e minúsculo

Elementos de matrizes bidimensionais

Tipo	Descrição	Formatação
a_{ij}	Escalar formado pelo elemento da linha i , coluna j da matriz A .	Minúsculo
$a_{i\cdot}$	Vetor linha formado pela linha i -essima da matriz A .	Minúsculo
$a_{\cdot i}$	Vetor coluna formado pela coluna i -essima da matriz A .	Minúsculo

Elementos de vetores ou conjuntos

Tipo	Descrição	Formatação
a_i	Elemento i -essimo do vetor ou conjunto a .	Minúsculo

Funções notáveis

Função	Descrição
$card(\mathbf{a})$	Número de elementos, cardinalidade, do vetor ou conjunto \mathbf{a} .
$card(\mathbf{A})$	Número de elementos, cardinalidade, da matriz \mathbf{A} .
$dim(\mathbf{a}, 1)$	Primeira dimensão do vetor \mathbf{a} , número de linhas.
$dim(\mathbf{a}, 2)$	Segunda dimensão do vetor \mathbf{a} , número de colunas.
$dim(\mathbf{A}, 1)$	Primeira dimensão da matriz \mathbf{A} , número de linhas.
$dim(\mathbf{A}, 2)$	Segunda dimensão da matriz \mathbf{A} , número de colunas.
$dim(\mathbf{A}, N)$	Dimensão N da matriz \mathbf{A} , se não tiver retorna 0.
$inv(\mathbf{A})$	Inversa da matriz \mathbf{A} , é equivalente a escrever \mathbf{A}^{-1} .
\mathbf{A}^{-1}	Inversa da matriz \mathbf{A} , é equivalente a escrever $inv(\mathbf{A})$.
$trans(\mathbf{a})$	Transposta do vetor \mathbf{a} , é equivalente a escrever \mathbf{a}^T .
\mathbf{a}^T	Transposta do vetor \mathbf{a} , é equivalente a escrever $trans(\mathbf{a})$.
$trans(\mathbf{A})$	Transposta da matriz \mathbf{A} , é equivalente a escrever \mathbf{A}^T .
\mathbf{A}^T	Transposta da matriz \mathbf{A} , é equivalente a escrever $trans(\mathbf{A})$.
$\ \mathbf{a}\ $	Módulo do vetor \mathbf{a} , é equivalente a escrever $\sqrt{\sum_i a_i^2}$.
$\ \mathbf{a}\ ^2$	Módulo ao quadrado do vetor \mathbf{a} , é equivalente a escrever $\sum_i a_i^2$ ou $\mathbf{a}^T \mathbf{a}$ se \mathbf{a} é um vetor coluna.
$\ \mathbf{a}\ _{\mathbf{B}}^2$	Módulo ao quadrado ponderado do vetor \mathbf{a} , é equivalente a escrever $\sum_i b_{ii} a_i^2$ ou $(\sqrt{\mathbf{B}} \mathbf{a})^T \sqrt{\mathbf{B}} \mathbf{a} \equiv \mathbf{a}^T \mathbf{B} \mathbf{a}$ se \mathbf{a} é um vetor coluna. Sendo que \mathbf{B} é uma matriz diagonal.
$vec(\mathbf{A})$	Vectorização de uma matriz, de modo que esta sofre uma transformação linear que converte à matriz num vetor coluna igual a $[a_{1,1}, \dots, a_{m,1}, a_{1,2}, \dots, a_{m,2}, \dots, a_{1,n}, \dots, a_{m,n}]^T$.
$diag(a_1, \dots, a_M)$	Matriz diagonal com elementos a_m , de modo que $m \in \mathbb{N}$, $1 \leq m \leq M$.
$blkdiag(\mathbf{A}_1, \dots, \mathbf{A}_K)$	Matriz formada colocando diagonalmente, blocos de matrizes $\mathbf{A}_k \in \mathbb{R}^{M_k \times N_k}$, com $k \in \mathbb{N}$, $1 \leq k \leq K$.
$\bigcup_{k=1}^K \mathbf{A}_k$	$blkdiag(\mathbf{A}_1, \dots, \mathbf{A}_K)$
$blkhorz(\mathbf{A}_1, \dots, \mathbf{A}_K)$	Matriz formada colocando horizontalmente, blocos de matrizes $\mathbf{A}_k \in \mathbb{R}^{M \times N_k}$, com $k \in \mathbb{N}$, $1 \leq k \leq K$.
$\bigcup_{k=1}^K \mathbf{A}_k$	$blkhorz(\mathbf{A}_1, \dots, \mathbf{A}_K)$
$blkvert(\mathbf{A}_1, \dots, \mathbf{A}_K)$	Matriz formada colocando verticalmente, blocos de matrizes $\mathbf{A}_k \in \mathbb{R}^{M_k \times N}$, com $k \in \mathbb{N}$, $1 \leq k \leq K$.
$\bigcup_{k=1}^K \mathbf{A}_k$	$blkvert(\mathbf{A}_1, \dots, \mathbf{A}_K)$

Derivadas de funções e operadores

1 Funções e operadores notáveis 17

- 1.1 Operador derivada para $e(\mathbf{x})$, $\mathbf{f}(\mathbf{x})$ e $\mathbf{G}(\mathbf{x})$
- 1.2 Derivadas notáveis: Gradiente, Matriz Hessiana, Matriz Jacobiana
- 1.3 Serie de Taylor de $d(x)$, $e(\mathbf{x})$ e $\mathbf{f}(\mathbf{x})$

2 Derivada de funções: $\mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$ 23

- 2.1 Derivada de \mathbf{Ax}
- 2.2 Derivada de $\|\mathbf{Ax}\|^2$
- 2.3 Derivada de $\|\mathbf{Ax} - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2$
- 2.4 Derivada de $\|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2$
- 2.5 Derivada de segundo ordem de $\|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2$
- 2.6 Derivada de $\|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x} - \mathbf{q}\|_{\mathbf{D}}^2$
- 2.7 Provas dos teoremas

1. Funções e operadores notáveis

1.1 Operador derivada para $e(\mathbf{x})$, $\mathbf{f}(\mathbf{x})$ e $\mathbf{G}(\mathbf{x})$

Definição 1.1.1 Se $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$ é um vetor coluna com elementos $x_n \in \mathbb{R}$ de modo que $n \in \mathbb{N}$, $1 \leq n \leq N$, a função $e(\mathbf{x}) : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}$ é um escalar, a função $\mathbf{f}(\mathbf{x}) : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$ é um vetor coluna, e a função $\mathbf{G}(\mathbf{x}) : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^{M \times L}$ é uma matriz, então definimos que:

$$\frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T} = \begin{bmatrix} \frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial x_1} & \frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial x_2} & \dots & \frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial x_n} & \dots & \frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial x_N} \end{bmatrix} = \bigcup_{n=1}^{\rightarrow N} \frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial x_n} \quad (1.1)$$

$$\frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T} = \begin{bmatrix} \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_1} & \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_2} & \dots & \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_n} & \dots & \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_N} \end{bmatrix} = \bigcup_{n=1}^{\rightarrow N} \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_n} \quad (1.2)$$

$$\frac{\partial \mathbf{G}(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T} = \begin{bmatrix} \frac{\partial \mathbf{G}(\mathbf{x})}{\partial x_1} & \frac{\partial \mathbf{G}(\mathbf{x})}{\partial x_2} & \dots & \frac{\partial \mathbf{G}(\mathbf{x})}{\partial x_n} & \dots & \frac{\partial \mathbf{G}(\mathbf{x})}{\partial x_N} \end{bmatrix} = \bigcup_{n=1}^{\rightarrow N} \frac{\partial \mathbf{G}(\mathbf{x})}{\partial x_n}. \quad (1.3)$$

Assim, $\frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T} \in \mathbb{R}^{1 \times N}$, $\frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T} \in \mathbb{R}^{M \times N}$ e $\frac{\partial \mathbf{G}(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T} \in \mathbb{R}^{M \times (LN)}$.

Definição 1.1.2 Se $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$ é um vetor coluna com elementos $x_n \in \mathbb{R}$ de modo que $n \in \mathbb{N}$, $1 \leq n \leq N$, a função $e(\mathbf{x}) : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}$ é um escalar, a função $\mathbf{f}(\mathbf{x}) : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$ é um vetor coluna, e

a função $\mathbf{G}(\mathbf{x}) : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^{M \times L}$ é uma matriz, então definimos que:

$$\frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}} = \begin{bmatrix} \frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial x_1} \\ \frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial x_2} \\ \vdots \\ \frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial x_n} \\ \vdots \\ \frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial x_N} \end{bmatrix} = \text{trans} \left(\frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T} \right) = \text{vec} \left(\frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T} \right) = \bigcup_{n=1}^N \frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial x_n} \quad (1.4)$$

$$\frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}} = \begin{bmatrix} \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_1} \\ \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_2} \\ \vdots \\ \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_n} \\ \vdots \\ \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_N} \end{bmatrix} = \text{vec} \left(\frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T} \right) = \bigcup_{n=1}^N \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_n} \quad (1.5)$$

$$\frac{\partial \mathbf{G}(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}} = \begin{bmatrix} \frac{\partial \mathbf{G}(\mathbf{x})}{\partial x_1} \\ \frac{\partial \mathbf{G}(\mathbf{x})}{\partial x_2} \\ \vdots \\ \frac{\partial \mathbf{G}(\mathbf{x})}{\partial x_n} \\ \vdots \\ \frac{\partial \mathbf{G}(\mathbf{x})}{\partial x_N} \end{bmatrix} = \bigcup_{n=1}^N \frac{\partial \mathbf{G}(\mathbf{x})}{\partial x_n} \quad (1.6)$$

Assim, $\frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}} \in \mathbb{R}^{N \times 1}$, $\frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}} \in \mathbb{R}^{(MN) \times 1}$ e $\frac{\partial \mathbf{g}(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}} \in \mathbb{R}^{(MN) \times L}$.

Corolário 1.1.1 — Igualdade das derivadas cruzadas. Se $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$ é um vetor coluna com elementos $x_n \in \mathbb{R}$ de modo que $n \in \mathbb{N}$, $1 \leq n \leq N$, a função $e(\mathbf{x}) : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}$ é um escalar, e tendo em consideração as Definições 1.1.1 e 1.1.2 e o “Teorema da igualdade das derivadas cruzadas” **[FALTA REFERENCIA!!!]**; então é fácil deduzir que:

$$\frac{\partial}{\partial \mathbf{x}} \left(\frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T} \right) \equiv \frac{\partial}{\partial \mathbf{x}^T} \left(\frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}} \right) \quad (1.7)$$

1.2 Derivadas notáveis: Gradiente, Matriz Hessiana, Matriz Jacobiana

Proposição 1.2.1 — Gradiente de $e(\mathbf{x})$. Dada uma função $e : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}$ com variável $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$ como vetor coluna com elementos $x_n \in \mathbb{R}$ de modo que $n \in \mathbb{N}$, $1 \leq n \leq N$, diferenciável em \mathbf{x} .

$\nabla e(\mathbf{x})$ é chamado gradiente [1] [FALTA REFERENCIA!!!] de $e(\mathbf{x})$, de modo que:

$$\nabla e(\mathbf{x}) \equiv \frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T} = \left[\frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial x_1} \quad \frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial x_2} \quad \cdots \quad \frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial x_n} \quad \cdots \quad \frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial x_N} \right] \quad (1.8)$$

Proposição 1.2.2 — Matriz Hessiana de $e(\mathbf{x})$. Dada uma função $e : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}$ com variável $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$ como vetor coluna com elementos $x_n \in \mathbb{R}$ de modo que $n \in \mathbb{N}$, $1 \leq n \leq N$, diferenciável em \mathbf{x} . $\mathbf{H}(\mathbf{x})$ é chamada matriz Hessiana [2] [FALTA REFERENCIA!!!] de $e(\mathbf{x})$, de modo que:

$$\mathbf{H}(\mathbf{x}) \equiv \frac{\partial}{\partial \mathbf{x}} \left(\frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T} \right) = \begin{bmatrix} \frac{\partial^2 e(\mathbf{x})}{\partial x_1 \partial x_1} & \frac{\partial^2 e(\mathbf{x})}{\partial x_1 \partial x_2} & \cdots & \frac{\partial^2 e(\mathbf{x})}{\partial x_1 \partial x_n} & \cdots & \frac{\partial^2 e(\mathbf{x})}{\partial x_1 \partial x_N} \\ \frac{\partial^2 e(\mathbf{x})}{\partial x_2 \partial x_1} & \frac{\partial^2 e(\mathbf{x})}{\partial x_2 \partial x_2} & \cdots & \frac{\partial^2 e(\mathbf{x})}{\partial x_2 \partial x_n} & \cdots & \frac{\partial^2 e(\mathbf{x})}{\partial x_2 \partial x_N} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots \\ \frac{\partial^2 e(\mathbf{x})}{\partial x_m \partial x_1} & \frac{\partial^2 e(\mathbf{x})}{\partial x_m \partial x_2} & \cdots & \frac{\partial^2 e(\mathbf{x})}{\partial x_m \partial x_n} & \cdots & \frac{\partial^2 e(\mathbf{x})}{\partial x_m \partial x_N} \\ \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots & \vdots \\ \frac{\partial^2 e(\mathbf{x})}{\partial x_M \partial x_1} & \frac{\partial^2 e(\mathbf{x})}{\partial x_M \partial x_2} & \cdots & \frac{\partial^2 e(\mathbf{x})}{\partial x_M \partial x_n} & \cdots & \frac{\partial^2 e(\mathbf{x})}{\partial x_M \partial x_N} \end{bmatrix} \quad (1.9)$$

Proposição 1.2.3 — Matriz Jacobiana de $\mathbf{f}(\mathbf{x})$. Dado um vetor coluna, como função $\mathbf{f} : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$ com variável $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$ como vetor coluna com elementos $x_n \in \mathbb{R}$ de modo que $n \in \mathbb{N}$, $1 \leq n \leq N$, diferenciável em \mathbf{x} . $\mathbf{J}(\mathbf{x})$ é chamada matriz Jacobiana [3] [FALTA REFERENCIA!!!] de $\mathbf{f}(\mathbf{x}) = [f_1(\mathbf{x}) \ f_2(\mathbf{x}) \ \cdots \ f_m(\mathbf{x}) \ \cdots \ f_M(\mathbf{x})]^T$, de modo que:

$$\mathbf{J}(\mathbf{x}) \equiv \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T} = \left[\frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_1} \quad \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_2} \quad \cdots \quad \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_n} \quad \cdots \quad \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_N} \right] \quad (1.10)$$

$$\mathbf{J}(\mathbf{x}) \equiv \begin{bmatrix} \frac{\partial f_1(\mathbf{x})}{\partial x_1} & \frac{\partial f_1(\mathbf{x})}{\partial x_2} & \cdots & \frac{\partial f_1(\mathbf{x})}{\partial x_n} & \cdots & \frac{\partial f_1(\mathbf{x})}{\partial x_N} \\ \frac{\partial f_2(\mathbf{x})}{\partial x_1} & \frac{\partial f_2(\mathbf{x})}{\partial x_2} & \cdots & \frac{\partial f_2(\mathbf{x})}{\partial x_n} & \cdots & \frac{\partial f_2(\mathbf{x})}{\partial x_N} \\ \vdots & \vdots & \cdots & \vdots & \vdots & \vdots \\ \frac{\partial f_m(\mathbf{x})}{\partial x_1} & \frac{\partial f_m(\mathbf{x})}{\partial x_2} & \cdots & \frac{\partial f_m(\mathbf{x})}{\partial x_n} & \cdots & \frac{\partial f_m(\mathbf{x})}{\partial x_N} \\ \vdots & \vdots & \cdots & \vdots & \vdots & \vdots \\ \frac{\partial f_M(\mathbf{x})}{\partial x_1} & \frac{\partial f_M(\mathbf{x})}{\partial x_2} & \cdots & \frac{\partial f_M(\mathbf{x})}{\partial x_n} & \cdots & \frac{\partial f_M(\mathbf{x})}{\partial x_N} \end{bmatrix} \quad (1.11)$$

1.3 Serie de Taylor de $d(x)$, $e(\mathbf{x})$ e $\mathbf{f}(\mathbf{x})$

Proposição 1.3.1 — Serie de Taylor de $d(x)$. Dada uma função $d : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ com variável $x \in \mathbb{R}$; infinitamente diferenciável em $a \in \mathbb{R}$; esta pode ser expressada mediante uma somatória, em

serie de Taylor [4] [FALTA REFERENCIA!!!] ao redor de a , como mostra a Eq. (1.12),

$$d(x) = d(a) + \frac{\partial d(x)}{\partial x} \Big|_{x=a} (x-a) + \frac{1}{2} \frac{\partial^2 d(x)}{\partial x^2} \Big|_{x=a} (x-a)^2 + \cdots + \frac{1}{k!} \frac{\partial^k d(x)}{\partial x^k} \Big|_{x=a} (x-a)^k + \cdots \quad (1.12)$$

A equação pode ser escrita de forma mais compacta mediante uma somatória como mostra a Eq. (1.13),

$$d(x) = \sum_{k=0}^{+\infty} \frac{\partial^k d(x)}{\partial x^k} \Big|_{x=a} \frac{(x-a)^k}{k!}. \quad (1.13)$$

É possível ver um exemplo de aproximação da função $\cos(x)$, mediante o uso da serie de Taylor da Proposição 1.3.1, truncada ate a derivada de ordem 4, 8 e 10, na Fig. 1.1.

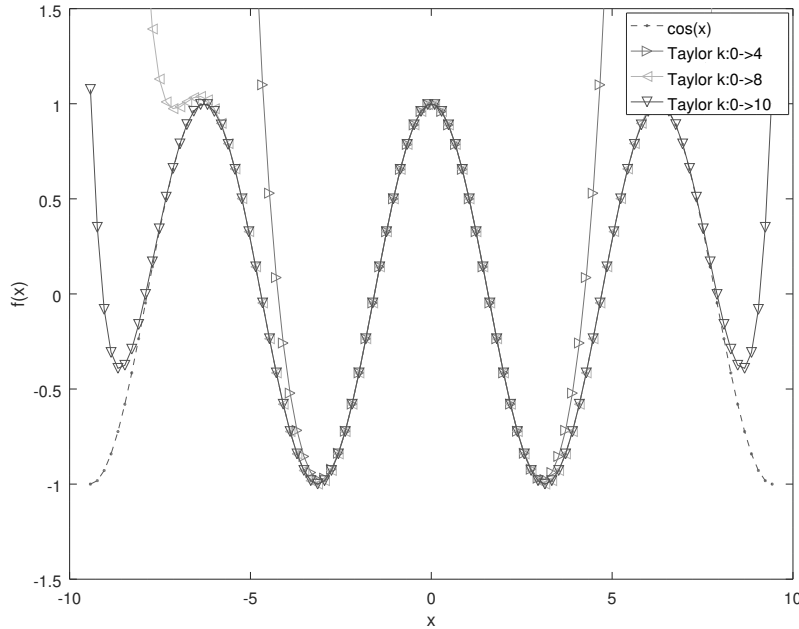


Figure 1.1: Aproximação da função $\cos(x)$ usando a serie de Taylor truncada.

Proposição 1.3.2 — Serie de Taylor de $e(\mathbf{x})$. Dada uma função $e : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}$ com variável $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$, vetor coluna; infinitamente diferenciável em $\mathbf{a} \in \mathbb{R}^N$; esta pode ser expressada mediante uma somatória, em serie de Taylor [4] [FALTA REFERENCIA!!!] ao redor de \mathbf{a} , como mostra a Eq. (1.14),

$$e(\mathbf{x}) = \sum_{k_1=0}^{\infty} \cdots \sum_{k_N=0}^{\infty} \left(\frac{\partial^{k_1+\cdots+k_N} e(\mathbf{x})}{\partial x_1^{k_1} \cdots \partial x_N^{k_N}} \right) \Big|_{\mathbf{x}=\mathbf{a}} \frac{(x_1 - a_1)^{k_1} \cdots (x_N - a_N)^{k_N}}{k_1! \cdots k_N!} \quad (1.14)$$

Outra forma alternativa de expressar a função anterior é usando vetores e matrizes, como na

Eq. (1.15).

$$e(\mathbf{x}) = e(\mathbf{a}) + \nabla e(\mathbf{a})(\mathbf{x} - \mathbf{a}) + \frac{1}{2!}(\mathbf{x} - \mathbf{a})^T \mathbf{H}(\mathbf{a})(\mathbf{x} - \mathbf{a}) + \dots \quad (1.15)$$

Onde o vector $\nabla e(\mathbf{x}) \equiv \frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T}$ (também chamado gradiente), e a matriz $\mathbf{H}(\mathbf{x}) \equiv \frac{\partial}{\partial \mathbf{x}} \left(\frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T} \right)$ (também chamada matriz Hessiana).

Proposição 1.3.3 — Serie de Taylor de $\mathbf{f}(\mathbf{x})$. Dada uma função de contra-domino vectorial $\mathbf{f}: \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$, sendo \mathbf{f} um vector coluna, com variável $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$, vector coluna; infinitamente diferenciável em $\mathbf{a} \in \mathbb{R}^N$; esta pode ser expressada mediante uma somatória, em serie de Taylor [4] [FALTA REFERENCIA!!!] ao redor de \mathbf{a} , como mostra a Eq. (1.16),

$$\mathbf{f}(\mathbf{x}) = \mathbf{f}(\mathbf{a}) + \mathbf{J}(\mathbf{a})(\mathbf{x} - \mathbf{a}) + \dots \quad (1.16)$$

Onde a matriz $\mathbf{J}(\mathbf{x}) \equiv \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T}$, também conhecido como matriz Jacobiana de $\mathbf{f}(\mathbf{x})$.



2. Derivada de funções: $\mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$

2.1 Derivada de \mathbf{Ax}

Teorema 2.1.1 Se $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$ é um vetor coluna com elementos x_n de modo que $n \in \mathbb{N}$, $1 \leq n \leq N$, e $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{M \times N}$ é uma matriz com elementos a_{mn} de modo que $m \in \mathbb{N}$, $1 \leq m \leq M$, então se cumpre que:

$$\frac{\partial \mathbf{Ax}}{\partial x_n} = a_{:n} \quad (2.1)$$

A demonstração pode ser vista na Prova 2.1.

Corolário 2.1.2 — Derivada de \mathbf{Ax} em relação ao vetor \mathbf{x}^T . Aplicando a Definição 1.1.1 junto ao Teorema 2.1.1, é fácil deduzir que:

$$\frac{\partial \mathbf{Ax}}{\partial \mathbf{x}^T} = \mathbf{A} = \begin{bmatrix} a_{:1} & a_{:2} & \cdots & a_{:N} \end{bmatrix} \quad (2.2)$$

Corolário 2.1.3 — Derivada de \mathbf{Ax} em relação ao vetor \mathbf{x} . Aplicando a Definição 1.1.2 junto ao Teorema 2.1.1, é fácil deduzir que:

$$\frac{\partial \mathbf{Ax}}{\partial \mathbf{x}} = \text{vec}(\mathbf{A}) = \begin{bmatrix} a_{:1} \\ a_{:2} \\ \vdots \\ a_{:N} \end{bmatrix} \quad (2.3)$$

Corolário 2.1.4 — Derivada de $\mathbf{a}^T \mathbf{x}$ em relação ao vetor \mathbf{x}^T . Aplicando a Definição 1.1.1

junto ao Teorema 2.1.1 e sabendo que \mathbf{a}^T é um vetor linha, é fácil deduzir que:

$$\frac{\partial \mathbf{a}^T \mathbf{x}}{\partial \mathbf{x}^T} = \mathbf{a}^T \quad (2.4)$$

Corolário 2.1.5 — Derivada de $\mathbf{a}^T \mathbf{x}$ em relação ao vector \mathbf{x} . Aplicando a Definição 1.1.2 junto ao Teorema 2.1.1 e sabendo que \mathbf{a}^T é um vetor linha, é fácil deduzir que:

$$\frac{\partial \mathbf{a}^T \mathbf{x}}{\partial \mathbf{x}} = \mathbf{a} \quad (2.5)$$

2.2 Derivada de $\|\mathbf{Ax}\|^2$

Teorema 2.2.1 Se $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$ é um vetor coluna com elementos x_n de modo que $n \in \mathbb{N}$, $1 \leq n \leq N$, e $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{M \times N}$ é uma matriz com elementos a_{mn} de modo que $m \in \mathbb{N}$, $1 \leq m \leq M$, então se cumpre que:

$$\begin{aligned} \frac{\partial \|\mathbf{Ax}\|^2}{\partial x_n} &= \frac{\partial (\mathbf{Ax})^T (\mathbf{Ax})}{\partial x_n} = 2 (\mathbf{Ax})^T a_{:,n} \\ &= 2 (a_{:,n})^T \mathbf{Ax} \end{aligned} \quad (2.6)$$

A demonstração pode ser vista na Prova 2.2.

Corolário 2.2.2 — Derivada de $\|\mathbf{Ax}\|^2$ em relação ao vector \mathbf{x}^T . Aplicando a Definição 1.1.1 junto ao Teorema 2.2.1, é fácil deduzir que:

$$\frac{\partial \|\mathbf{Ax}\|^2}{\partial \mathbf{x}^T} = 2 (\mathbf{A}^T \mathbf{Ax})^T \quad (2.7)$$

Corolário 2.2.3 — Derivada de $\|\mathbf{Ax}\|^2$ em relação ao vector \mathbf{x} . Aplicando a Definição 1.1.2 junto ao Teorema 2.2.1, é fácil deduzir que:

$$\frac{\partial \|\mathbf{Ax}\|^2}{\partial \mathbf{x}} = 2 \mathbf{A}^T \mathbf{Ax} \quad (2.8)$$

2.3 Derivada de $\|\mathbf{Ax} - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2$

Teorema 2.3.1 Se $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$ é um vetor coluna com elementos x_n de modo que $n \in \mathbb{N}$, $1 \leq n \leq N$, $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$ é um vetor coluna com elementos b_m de modo que $m \in \mathbb{N}$, $1 \leq m \leq M$, $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{M \times N}$ é uma matriz com elementos a_{mn} , e $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$ é uma matriz diagonal, então se cumpre que:

$$\begin{aligned} \frac{\partial \|\mathbf{Ax} - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial x_n} &= \frac{\partial (\mathbf{Ax} - \mathbf{b})^T \mathbf{C} (\mathbf{Ax} - \mathbf{b})}{\partial x_n} = 2 (\mathbf{Ax} - \mathbf{b})^T \mathbf{C} a_{:,n} \\ &= 2 (a_{:,n})^T \mathbf{C} (\mathbf{Ax} - \mathbf{b}) \end{aligned} \quad (2.9)$$

A demonstração pode ser vista na Prova 2.3.

Corolário 2.3.2 — Derivada de $\|\mathbf{Ax} - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2$ em relação ao vector \mathbf{x}^T . Aplicando a Definição

1.1.1 junto ao Teorema 2.3.1, é fácil deduzir que:

$$\frac{\partial \|\mathbf{Ax} - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial \mathbf{x}^T} = 2(\mathbf{Ax} - \mathbf{b})^T \mathbf{CA} \quad (2.10)$$

Corolário 2.3.3 — Derivada de $\|\mathbf{Ax} - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2$ em relação ao vector \mathbf{x} . Aplicando a Definição 1.1.2 junto ao Teorema 2.3.1, é fácil deduzir que:

$$\frac{\partial \|\mathbf{Ax} - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial \mathbf{x}} = 2\mathbf{A}^T \mathbf{C} (\mathbf{Ax} - \mathbf{b}) \quad (2.11)$$

2.4 Derivada de $\|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2$

Teorema 2.4.1 — Valor exato. Se $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$ é um vetor coluna, $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$ é um vetor coluna, $\mathbf{f} : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$ é uma função de valor vectorial, e $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$ é uma matriz diagonal, então se cumpre que:

$$\frac{\partial \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial \mathbf{x}} = 2\mathbf{J}(\mathbf{x})^T \mathbf{C} [\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}], \quad (2.12)$$

onde $\mathbf{J}(\mathbf{x})$ é a matriz Jacobiana [3] de $\mathbf{f}(\mathbf{x})$.

A demonstração pode ser vista na Prova 2.4.

Teorema 2.4.2 — Valor aproximado. Se $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$ é um vetor coluna, $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$ é um vetor coluna, $\mathbf{f} : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$ é uma função de valor vectorial, e $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$ é uma matriz diagonal, então se cumpre que:

$$\frac{\partial \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial \mathbf{x}} \approx 2\mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} [\mathbf{J}(\mathbf{p}) (\mathbf{x} - \mathbf{p}) - (\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p}))] \quad (2.13)$$

Onde é considerada a aproximação $\mathbf{f}(\mathbf{x}) \approx \mathbf{f}(\mathbf{p}) + \mathbf{J}(\mathbf{p}) (\mathbf{x} - \mathbf{p})$, usando a serie de Taylor [4] para funções multivariáveis. Sendo \mathbf{p} um ponto fixo no domínio de $\mathbf{f}(\mathbf{x})$, ao redor do qual é feita aproximação da função $\mathbf{f}(\mathbf{x})$, e $\mathbf{J}(\mathbf{p})$ é a matriz Jacobiana [3] de $\mathbf{f}(\mathbf{x})$ avaliado no ponto \mathbf{p} .

A demonstração pode ser vista na Prova 2.5.

2.5 Derivada de segundo ordem de $\|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2$

Teorema 2.5.1 — Valor exato. Se $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$ é um vetor coluna, $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$ é um vetor coluna, $\mathbf{f} : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$ é uma função de valor vectorial, $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$ é uma matriz diagonal, e definida a função $e(\mathbf{x})$,

$$e(\mathbf{x}) = \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2. \quad (2.14)$$

Então a matriz Hessiana [2] $\mathbf{H}(\mathbf{x})$ de $e(\mathbf{x})$ é igual a:

$$\mathbf{H}(\mathbf{x}) = \frac{\partial}{\partial \mathbf{x}^T} \left(\frac{\partial e(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}} \right) = 2\mathbf{B}(\mathbf{x}) + 2\mathbf{J}(\mathbf{x})^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{x}), \quad (2.15)$$

onde

$$\mathbf{B}(\mathbf{x}) = \bigcup_{n=1}^N \left\{ \frac{\partial \mathbf{J}(\mathbf{x})^T}{\partial x_n} \mathbf{C} (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}) \right\}, \quad (2.16)$$

A demonstração pode ser vista na Prova 2.6.

2.6 Derivada de $\|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x} - \mathbf{q}\|_{\mathbf{D}}^2$

Teorema 2.6.1 — Valor aproximado. Se $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$ é um vetor coluna, $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$ é um vetor coluna, $\mathbf{q} \in \mathbb{R}^N$ é um vetor coluna, $\mathbf{f}: \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$ é uma função de valor vectorial, $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$ é uma matriz diagonal, e $\mathbf{D} \in \mathbb{R}^{N \times N}$ é uma matriz diagonal, então se cumpre que:

$$\frac{\partial (\|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x} - \mathbf{q}\|_{\mathbf{D}}^2)}{\partial \mathbf{x}} \approx 2\mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} \{ \mathbf{J}(\mathbf{p}) [\mathbf{x} - \mathbf{p}] - [\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p})] \} + 2\alpha \mathbf{D} [\mathbf{x} - \mathbf{q}] \quad (2.17)$$

Onde é considerada a aproximação $\mathbf{f}(\mathbf{x}) \approx \mathbf{f}(\mathbf{p}) + \mathbf{J}(\mathbf{p}) (\mathbf{x} - \mathbf{p})$, usando a serie de Taylor [4] para funções multivariáveis. Sendo \mathbf{p} um ponto fixo no domínio de $\mathbf{f}(\mathbf{x})$, ao redor do qual é feita aproximação da função $\mathbf{f}(\mathbf{x})$, e $\mathbf{J}(\mathbf{p})$ é a matriz Jacobiana [3] de $\mathbf{f}(\mathbf{x})$ avaliado no ponto \mathbf{p} .

A demonstração pode ser vista na Prova 2.7.

2.7 Provas dos teoremas

Prova 2.1 — Prova do Teorema 2.1.1. Dados, uma matriz $\mathbf{A} = [a_{:1} \ a_{:2} \ \dots \ a_{:n} \ \dots \ a_{:N}]$ e um vetor coluna $\mathbf{x} = [x_1 \ x_2 \ \dots \ x_n \ \dots \ x_N]^T$, podemos expressar que:

$$\frac{\partial \mathbf{Ax}}{\partial x_n} = \frac{\partial \mathbf{A}}{\partial x_n} \mathbf{x} + \mathbf{A} \frac{\partial \mathbf{x}}{\partial x_n} = \mathbf{A} \frac{\partial \mathbf{x}}{\partial x_n} \quad (2.18)$$

Sabendo que $\frac{\partial \mathbf{x}}{\partial x_n}$ é igual a um vetor com um 1 na posição n e 0 em qualquer outra posição, obtemos que

$$\frac{\partial \mathbf{Ax}}{\partial x_n} = [a_{:1} \ a_{:2} \ \dots \ a_{:n} \ \dots \ a_{:N}] \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \\ \vdots \\ 1 \\ \vdots \\ 0 \end{bmatrix} = a_{:n} \quad (2.19)$$

Prova 2.2 — Prova do Teorema 2.2.1. Dados, uma matriz $\mathbf{A} = [a_{:1} \ a_{:2} \ \dots \ a_{:n} \ \dots \ a_{:N}]$ e um vetor coluna $\mathbf{x} = [x_1 \ x_2 \ \dots \ x_n \ \dots \ x_N]^T$, podemos expressar que:

$$\frac{\partial \|\mathbf{Ax}\|^2}{\partial x_n} = \frac{\partial (\mathbf{Ax})^T (\mathbf{Ax})}{\partial x_n} = \left(\frac{\partial \mathbf{Ax}}{\partial x_n} \right)^T (\mathbf{Ax}) + (\mathbf{Ax})^T \frac{\partial \mathbf{Ax}}{\partial x_n} \quad (2.20)$$

Pelo visto no Teorema 2.1.1 podemos substituir valores na Eq. (2.20) e obter:

$$\frac{\partial \|\mathbf{Ax}\|^2}{\partial x_n} = (a_{:n})^T \mathbf{Ax} + (\mathbf{Ax})^T a_{:n} \quad (2.21)$$

Como cada um dos somandos da equação anterior é um escalar, podemos aplicar o operador transposta (T) sobre qualquer somando sem alterar o resultado; de modo que temos duas possíveis forma de expressar a solução:

$$\begin{aligned} \frac{\partial \|\mathbf{Ax}\|^2}{\partial x_n} &= 2 (\mathbf{Ax})^T a_{:n} \\ &= 2 (a_{:n})^T \mathbf{Ax} \end{aligned} \quad (2.22)$$

Prova 2.3 — Prova do Teorema 2.3.1. Dados, uma matriz $\mathbf{A} = [a_{:1} \ a_{:2} \ \dots \ a_{:n} \ \dots \ a_{:N}]$, uma matriz diagonal $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$, um vetor coluna $\mathbf{x} = [x_1 \ x_2 \ \dots \ x_n \ \dots \ x_N]^T$, e um vetor coluna $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$, podemos expressar que:

$$\frac{\partial \|\mathbf{Ax} - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial x_n} = \frac{\partial (\mathbf{Ax} - \mathbf{b})^T \mathbf{C} (\mathbf{Ax} - \mathbf{b})}{\partial x_n} = \left(\frac{\partial \mathbf{Ax}}{\partial x_n} \right)^T \mathbf{C} (\mathbf{Ax} - \mathbf{b}) + (\mathbf{Ax} - \mathbf{b})^T \mathbf{C} \left(\frac{\partial \mathbf{Ax}}{\partial x_n} \right) \quad (2.23)$$

Pelo visto no Teorema 2.1.1, podemos substituir valores na Eq. (2.23) e obter:

$$\frac{\partial \|\mathbf{Ax} - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial x_n} = (a_{:n})^T \mathbf{C} (\mathbf{Ax} - \mathbf{b}) + (\mathbf{Ax} - \mathbf{b})^T \mathbf{C} a_{:n} \quad (2.24)$$

Como cada um dos somandos da equação anterior é um escalar, podemos aplicar o operador transposta (T) sobre qualquer somando sem alterar o resultado; de modo que temos duas possíveis forma de expressar a solução:

$$\begin{aligned} \frac{\partial \|\mathbf{Ax} - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial x_n} &= 2(\mathbf{Ax} - \mathbf{b})^T \mathbf{C} a_{:,n} \\ &= 2(a_{:,n})^T \mathbf{C} (\mathbf{Ax} - \mathbf{b}) \end{aligned} \quad (2.25)$$

Prova 2.4 — Prova do Teorema 2.4.1. Dados, uma função $\mathbf{f}: \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$, uma matriz diagonal $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$, um vetor coluna $\mathbf{x} = [x_1 \ x_2 \ \dots \ x_n \ \dots \ x_N]^T$, e um vetor coluna $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$; podemos expressar que:

$$\begin{aligned} \frac{\partial \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial x_n} &= \frac{\partial (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b})^T \mathbf{C} (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b})}{\partial x_n} \\ &= \left(\frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_n} \right)^T \mathbf{C} (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}) + (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b})^T \mathbf{C} \left(\frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_n} \right). \\ &= 2 \left(\frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_n} \right)^T \mathbf{C} (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}) \end{aligned} \quad (2.26)$$

Assim, usando a Definição 1.1.2 junto com a Eq. (2.26) nos obtemos:

$$\frac{\partial \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial \mathbf{x}} = 2\mathbf{J}(\mathbf{x})^T \mathbf{C} (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}) \quad (2.27)$$

Prova 2.5 — Prova do Teorema 2.4.2. Dados, uma função $\mathbf{f}: \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$, uma matriz diagonal $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$, um vetor coluna $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$, um vetor coluna $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$, e considerando a aproximação $\mathbf{f}(\mathbf{x}) \approx \mathbf{f}(\mathbf{p}) + \mathbf{J}(\mathbf{p})(\mathbf{x} - \mathbf{p})$, usando a serie de Taylor para funções multivariáveis; podemos expressar que:

$$\frac{\partial \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial \mathbf{x}} \approx \frac{\partial \|\mathbf{J}(\mathbf{p})\mathbf{x} - [\mathbf{J}(\mathbf{p})\mathbf{p} + \mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p})]\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial \mathbf{x}} \quad (2.28)$$

Pelo visto no Corolário 2.3.3, podemos substituir os valores, $\mathbf{J}(\mathbf{p})$ e $[\mathbf{J}(\mathbf{p})\mathbf{p} + \mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p})]$, da Eq. (2.28), nas variáveis \mathbf{A} e \mathbf{b} do Corolário 2.3.3, respectivamente. Assim obtemos:

$$\frac{\partial \|\mathbf{J}(\mathbf{p})\mathbf{x} - [\mathbf{J}(\mathbf{p})\mathbf{p} + \mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p})]\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial \mathbf{x}} = 2\mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} (\mathbf{J}(\mathbf{p})\mathbf{x} - \mathbf{J}(\mathbf{p})\mathbf{p} - \mathbf{b} + \mathbf{f}(\mathbf{p})) \quad (2.29)$$

Prova 2.6 — Prova do Teorema 2.5.1. Dados, uma função $\mathbf{f}: \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$, uma matriz diagonal $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$, um vetor coluna $\mathbf{x} = [x_1 \ x_2 \ \dots \ x_n \ \dots \ x_N]^T$, e um vetor coluna $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$; podemos expressar que:

$$\begin{aligned} \frac{\partial}{\partial x_n} \left(\frac{\partial \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial \mathbf{x}} \right) &= \frac{\partial 2\mathbf{J}(\mathbf{x})^T \mathbf{C} (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b})}{\partial x_n} \\ &= 2 \frac{\partial \mathbf{J}(\mathbf{x})^T}{\partial x_n} \mathbf{C} (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}) + 2\mathbf{J}(\mathbf{x})^T \mathbf{C} \frac{\partial (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b})}{\partial x_n}. \\ &= 2 \frac{\partial \mathbf{J}(\mathbf{x})^T}{\partial x_n} \mathbf{C} (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}) + 2\mathbf{J}(\mathbf{x})^T \mathbf{C} \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial x_n} \end{aligned} \quad (2.30)$$

Assim, usando a Definição 1.1.1 junto com a Eq. (2.30) nos obtemos:

$$\frac{\partial}{\partial \mathbf{x}^T} \left(\frac{\partial \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial \mathbf{x}} \right) = 2 \bigcup_{n=1}^{\rightarrow N} \left\{ \frac{\partial \mathbf{J}(\mathbf{x})^T}{\partial x_n} \mathbf{C} (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}) \right\} + 2 \mathbf{J}(\mathbf{x})^T \mathbf{C} \frac{\partial \mathbf{f}(\mathbf{x})}{\partial \mathbf{x}^T} \quad (2.31)$$

Prova 2.7 — Prova do Teorema 2.6.1. Dados, uma função $\mathbf{f} : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$, uma matriz diagonal $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$, uma matriz diagonal $\mathbf{D} \in \mathbb{R}^{N \times N}$, um vetor coluna $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$, um vetor coluna $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$, e um vetor coluna $\mathbf{q} \in \mathbb{R}^N$, podemos expressar que:

$$\frac{\partial \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x} - \mathbf{q}\|_{\mathbf{D}}^2}{\partial \mathbf{x}} = \frac{\partial \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial \mathbf{x}} + \alpha \frac{\partial \|\mathbf{x} - \mathbf{q}\|_{\mathbf{D}}^2}{\partial \mathbf{x}}. \quad (2.32)$$

Usando o Corolário 2.3.3 na Eq. (2.32) obtemos:

$$\frac{\partial \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x} - \mathbf{q}\|_{\mathbf{D}}^2}{\partial \mathbf{x}} = \frac{\partial \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2}{\partial \mathbf{x}} + \alpha 2 \mathbf{D} (\mathbf{x} - \mathbf{q}). \quad (2.33)$$

Usando o Teorema 2.4.2 na Eq. (2.33) obtemos:

$$\frac{\partial \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x} - \mathbf{q}\|_{\mathbf{D}}^2}{\partial \mathbf{x}} \approx 2 \mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} [\mathbf{J}(\mathbf{p}) (\mathbf{x} - \mathbf{p}) - (\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p}))] + 2 \alpha \mathbf{D} (\mathbf{x} - \mathbf{q}). \quad (2.34)$$

Problemas de minimização de erro em funções

3 Minimização do erro em funções: $\mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$ 33

- 3.1 Minimização de $\|\mathbf{Ax} - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2$
- 3.2 Minimização de $\|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2$
- 3.3 Minimização de $\|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x} - \mathbf{q}\|_{\mathbf{D}}^2$
- 3.4 Minimização de $\|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x}\|_{\mathbf{D}}^2$
- 3.5 Minimização de $\|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x} - \mathbf{x}_{last}\|_{\mathbf{D}}^2$
- 3.6 Provas dos teoremas

4 Minimização do erro em funções: $\mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ 39

- 4.1 Minimização de $\|h(x) - a\|^2$
- 4.2 Minimização de $\|h(x) - a\|^2 + \alpha \|x - b\|^2$
- 4.3 Minimização de $\|h(x) - a\|^2 + \alpha \|x - x_{old}\|^2$
- 4.4 Provas dos teoremas



3. Minimização do erro em funções: $\mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$

R Palavras chave: Pseudo-inversa de Moore-Penrose, regularização de Tikhonov, problema inverso, minimização do erro quadrático.

3.1 Minimização de $\|\mathbf{Ax} - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2$

Teorema 3.1.1 Dados, um vetor coluna $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$, um vetor coluna $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$, uma matriz $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{M \times N}$, uma matriz diagonal $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$, e definida a Eq. (3.1),

$$e(\mathbf{x}) = \|\mathbf{Ax} - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 \quad (3.1)$$

$$= (\mathbf{Ax} - \mathbf{b})^T \mathbf{C} (\mathbf{Ax} - \mathbf{b}). \quad (3.2)$$

Se desejamos ter o valor $\hat{\mathbf{x}}$ que minimiza o escalar $e(\hat{\mathbf{x}})$, devemos usar a Eq. (3.3),

$$\hat{\mathbf{x}} = [\mathbf{A}^T \mathbf{C} \mathbf{A}]^{-1} \mathbf{A}^T \mathbf{C} \mathbf{b}. \quad (3.3)$$

Assim, o mínimo existe só se $\mathbf{A}^T \mathbf{C} \mathbf{A}$ tem inversa.

A demonstração pode ser vista na Prova 3.1.

3.2 Minimização de $\|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2$

Teorema 3.2.1 — Solução iterativa. Dados, um vetor coluna $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$, um vetor coluna $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$,

uma função $\mathbf{f}: \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$, uma matriz diagonal $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$, e definida a Eq. (3.4),

$$e(\mathbf{x}) = \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 \quad (3.4)$$

$$= (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b})^T \mathbf{C} (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}). \quad (3.5)$$

Se desejamos ter o valor $\hat{\mathbf{x}}$ que minimiza o escalar $e(\hat{\mathbf{x}})$, este valor pode ser achado usando iterativamente a Eq. (3.6),

$$\mathbf{x}_{k+1} \leftarrow \mathbf{x}_k + [\mathbf{J}(\mathbf{x}_k)^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{x}_k)]^{-1} \mathbf{J}(\mathbf{x}_k)^T \mathbf{C} [\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{x}_k)] \quad (3.6)$$

Onde $\mathbf{J}(\mathbf{x})$ é a matriz Jacobiana [3] de $\mathbf{f}(\mathbf{x})$. A busca iterativa é considerada falida quando $\mathbf{J}(\mathbf{x}_k)^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{x}_k)$ não tem inversa.

Assim, $\hat{\mathbf{x}}$ pode ser achado iniciando a Eq. (3.6) desde um \mathbf{x}_0 qualquer, ate que \mathbf{x}_k seja muito próximo a \mathbf{x}_{k+1} , onde se declara que $\hat{\mathbf{x}} \approx \mathbf{x}_{k+1}$; porem deve ser corroborado que esse ponto tratasse de um máximo ou mínimo usando algum método, por exemplo estudando o comportamento de $e(\mathbf{x})$ ou analisando a matriz hessiana de $e(\mathbf{x})$ avaliada em $\hat{\mathbf{x}}$.

A demonstração pode ser vista na Prova 3.2.

3.3 Minimização de $\|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x} - \mathbf{q}\|_{\mathbf{D}}^2$

Teorema 3.3.1 — Solução iterativa. Sabendo que, \mathbf{x} e \mathbf{q} são vetores coluna com N elementos, sendo \mathbf{q} uma constante, $\mathbf{f}(\mathbf{x})$ e \mathbf{b} são vetores coluna de M elementos, sendo \mathbf{b} uma constante, \mathbf{C} uma matriz diagonal de $M \times M$ e \mathbf{D} uma matriz diagonal de $N \times N$. Sim se deseja achar o valor $\hat{\mathbf{x}}$ que minimiza o valor de $e(\mathbf{x})$, visto na Eq. (3.7),

$$e(\mathbf{x}) = \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x} - \mathbf{q}\|_{\mathbf{D}}^2 \quad (3.7)$$

$$= (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b})^T \mathbf{C} (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}) + \alpha (\mathbf{x} - \mathbf{q})^T \mathbf{D} (\mathbf{x} - \mathbf{q}), \quad (3.8)$$

devemos usar a seguinte equação iterativa,

$$\mathbf{x}_{k+1} \leftarrow \mathbf{x}_k + [\mathbf{J}(\mathbf{x}_k)^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{x}_k) + \alpha \mathbf{D}]^{-1} (\mathbf{J}(\mathbf{x}_k)^T \mathbf{C} [\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{x}_k)] - \alpha \mathbf{D} [\mathbf{x}_k - \mathbf{q}]) \quad (3.9)$$

Onde $\mathbf{J}(\mathbf{x})$ é a matriz Jacobiana [3] de $\mathbf{f}(\mathbf{x})$. A busca iterativa é considerada falida quando $\mathbf{J}(\mathbf{x}_k)^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{x}_k) + \alpha \mathbf{D}$ não tem inversa.

Assim, $\hat{\mathbf{x}}$ pode ser achado iniciando a Eq. (3.9) desde um \mathbf{x}_0 qualquer, ate que \mathbf{x}_k seja muito próximo a \mathbf{x}_{k+1} , onde se declara que $\hat{\mathbf{x}} \approx \mathbf{x}_{k+1}$; porem deve ser corroborado que esse ponto tratasse de um máximo ou mínimo usando algum método, por exemplo estudando o comportamento de $e(\mathbf{x})$ ou analisando a matriz hessiana de $e(\mathbf{x})$ avaliada em $\hat{\mathbf{x}}$.

A demonstração pode ser vista na Prova 3.3.

3.4 Minimização de $\|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x}\|_{\mathbf{D}}^2$

Teorema 3.4.1 — Solução iterativa. Sabendo que, \mathbf{x} é um vetor com N elementos, $\mathbf{f}(\mathbf{x})$ e \mathbf{b} são vetores coluna de M elementos, sendo \mathbf{b} uma constante, \mathbf{C} uma matriz diagonal de $M \times M$ e \mathbf{D} uma matriz diagonal de $N \times N$. Sim se deseja achar o valor $\hat{\mathbf{x}}$ que minimiza o valor de $e(\mathbf{x})$, visto na Eq. (3.10),

$$e(\mathbf{x}) = \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x}\|_{\mathbf{D}}^2 \quad (3.10)$$

$$= (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b})^T \mathbf{C} (\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}) + \alpha \mathbf{x}^T \mathbf{D} \mathbf{x}, \quad (3.11)$$

devemos usar a seguinte equação iterativa,

$$\mathbf{x}_{k+1} \leftarrow \mathbf{x}_k + [\mathbf{J}(\mathbf{x}_k)^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{x}_k) + \alpha \mathbf{D}]^{-1} [\mathbf{J}(\mathbf{x}_k)^T \mathbf{C} \{\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{x}_k)\} - \alpha \mathbf{D} \mathbf{x}_k] \quad (3.12)$$

Onde $\mathbf{J}(\mathbf{x})$ é a matriz Jacobiana [3] de $\mathbf{f}(\mathbf{x})$. A busca iterativa é considerada falida quando $\mathbf{J}(\mathbf{x}_k)^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{x}_k) + \alpha \mathbf{D}$ não tem inversa.

Assim, $\hat{\mathbf{x}}$ pode ser achado iniciando a Eq. (3.12) desde um \mathbf{x}_0 qualquer, ate que \mathbf{x}_k seja muito próximo a \mathbf{x}_{k+1} , onde se declara que $\hat{\mathbf{x}} \approx \mathbf{x}_{k+1}$; porem deve ser corroborado que esse ponto tratasse de um máximo ou mínimo usando algum método, por exemplo estudando o comportamento de $e(\mathbf{x})$ ou analisando a matriz hessiana de $e(\mathbf{x})$ avaliada em $\hat{\mathbf{x}}$.

A demonstração pode ser vista na Prova 3.4.

3.5 Minimização de $\|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x} - \mathbf{x}_{last}\|_{\mathbf{D}}^2$

Teorema 3.5.1 — Solução iterativa. Sabendo que, \mathbf{x} e \mathbf{x}_{last} são vetores coluna com N elementos, sendo \mathbf{x}_{last} uma constante que representa o ultimo valor de \mathbf{x} obtido iterativamente, $\mathbf{f}(\mathbf{x})$ e \mathbf{b} são vetores coluna de M elementos, sendo \mathbf{b} uma constante, \mathbf{C} uma matriz diagonal de $M \times M$ e \mathbf{D} uma matriz diagonal de $N \times N$. Sim se deseja achar o valor $\hat{\mathbf{x}}$ que minimiza o valor de $e(\mathbf{x})$, visto na Eq. (3.13),

$$e(\mathbf{x}) = \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x} - \mathbf{x}_{last}\|_{\mathbf{D}}^2, \quad (3.13)$$

devemos usar a seguinte equação iterativa,

$$\mathbf{x}_{k+1} \leftarrow \mathbf{x}_k + [\mathbf{J}(\mathbf{x}_k)^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{x}_k) + \alpha \mathbf{D}]^{-1} [\mathbf{J}(\mathbf{x}_k)^T \mathbf{C} \{\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{x}_k)\}] \quad (3.14)$$

Onde $\mathbf{J}(\mathbf{x})$ é a matriz Jacobiana [3] de $\mathbf{f}(\mathbf{x})$. A busca iterativa é considerada falida quando $\mathbf{J}(\mathbf{x}_k)^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{x}_k) + \alpha \mathbf{D}$ não tem inversa.

Assim, $\hat{\mathbf{x}}$ pode ser achado iniciando a Eq. (3.14) desde um \mathbf{x}_0 qualquer, ate que \mathbf{x}_k seja muito próximo a \mathbf{x}_{k+1} , onde se declara que $\hat{\mathbf{x}} \approx \mathbf{x}_{k+1}$; porem deve ser corroborado que esse ponto tratasse de um máximo ou mínimo usando algum método, por exemplo estudando o comportamento de $e(\mathbf{x})$ ou analisando a matriz hessiana de $e(\mathbf{x})$ avaliada em $\hat{\mathbf{x}}$.

A demonstração pode ser vista na Prova 3.5.

3.6 Provas dos teoremas

Prova 3.1 — Prova do Teorema 3.1.1. Dados, um vetor coluna $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$, um vetor coluna $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$, uma matriz $\mathbf{A} \in \mathbb{R}^{M \times N}$, uma matriz diagonal $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$, e definida a Eq. (3.15),

$$e(\mathbf{x}) = \|\mathbf{Ax} - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2. \quad (3.15)$$

Para achar o valor $\hat{\mathbf{x}}$ que gere o menor valor de $e(\hat{\mathbf{x}})$, é aplicado o critério que um ponto de inflexão pode ser achado quando $\frac{\partial e(\hat{\mathbf{x}})}{\partial \mathbf{x}} = [0 \ 0 \ \dots \ 0]^T$. Assim, usando o Corolário 2.3.3 podemos rescrever esta igualdade como a Eq. (3.16),

$$2\mathbf{A}^T \mathbf{C} (\mathbf{A}\hat{\mathbf{x}} - \mathbf{b}) = [0 \ 0 \ \dots \ 0]^T, \quad (3.16)$$

de modo que pode ser obtido:

$$\hat{\mathbf{x}} = (\mathbf{A}^T \mathbf{C} \mathbf{A})^{-1} \mathbf{A}^T \mathbf{C} \mathbf{b}. \quad (3.17)$$

Dado que a solução é única e a função $e(\mathbf{x})$ é sempre positiva, então o valor de $\hat{\mathbf{x}}$ é um mínimo.

Prova 3.2 — Prova do Teorema 3.2.1. Dados, um vetor coluna $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$, um vetor coluna $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$, uma função $\mathbf{f}: \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$, uma matriz diagonal $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$, e definida a Eq. (3.18),

$$e(\mathbf{x}) = \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2. \quad (3.18)$$

Para achar o valor $\hat{\mathbf{x}}$ que gere o menor valor de $e(\hat{\mathbf{x}})$, é aplicado o critério que um ponto de inflexão pode ser achado quando $\frac{\partial e(\hat{\mathbf{x}})}{\partial \mathbf{x}} = [0 \ 0 \ \dots \ 0]^T$. Assim, usando o Teorema 2.4.2 podemos rescrever esta igualdade como a Eq. (3.19),

$$2\mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} [\mathbf{J}(\mathbf{p}) (\hat{\mathbf{x}} - \mathbf{p}) - (\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p}))] \approx \frac{\partial e(\hat{\mathbf{x}})}{\partial \mathbf{x}} = [0 \ 0 \ \dots \ 0]^T, \quad (3.19)$$

de modo que pode ser aproximado $\hat{\mathbf{x}}$ como:

$$\hat{\mathbf{x}} \approx \mathbf{p} + [\mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{p})]^{-1} \mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} (\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p})). \quad (3.20)$$

Assim, quanto mais próximo seja $\hat{\mathbf{x}}$ ao valor escolhido \mathbf{p} ; a Eq. (3.20) fica mais próximo a uma igualdade e $[\mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{p})]^{-1} \mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} (\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p})) \approx 0$. Isto implica duas possibilidades, a primeira é que $\mathbf{b} \approx \mathbf{f}(\mathbf{p})$, que é um mínimo absoluto de $e(\mathbf{x})$, e a segunda que $\mathbf{J}(\mathbf{p}) \approx 0$

Assim, um bom critério para procurar um mínimo ou máximo é seguir a seguinte equação iterativa,

$$\mathbf{p}_k \leftarrow \mathbf{p}_{k-1} + [\mathbf{J}(\mathbf{p}_{k-1})^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{p}_{k-1})]^{-1} \mathbf{J}(\mathbf{p}_{k-1})^T \mathbf{C} (\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p}_{k-1})), \quad (3.21)$$

iniciando desde um \mathbf{p}_0 qualquer, ate que \mathbf{p}_k seja muito próximo a \mathbf{p}_{k-1} , onde se declara que $\hat{\mathbf{x}} \approx \mathbf{p}_k$; porem deve ser corroborado que esse ponto tratasse de um máximo ou mínimo usando algum método, por exemplo estudando o comportamento de $e(\mathbf{x})$ ou analisando a matriz hessiana de $e(\mathbf{x})$

avaliada em $\hat{\mathbf{x}}$.

Prova 3.3 — Prova do Teorema 3.3.1. Dados, um escalar $\alpha \in \mathbb{R}$, um vetor coluna $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$, um vetor coluna $\mathbf{q} \in \mathbb{R}^N$, um vetor coluna $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$, uma função $\mathbf{f} : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$, uma matriz diagonal $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$, uma matriz diagonal $\mathbf{D} \in \mathbb{R}^{N \times N}$, e definida a Eq. (3.22),

$$e(\mathbf{x}) = \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x} - \mathbf{q}\|_{\mathbf{D}}^2. \quad (3.22)$$

Para achar o valor $\hat{\mathbf{x}}$ que gere o menor valor de $e(\hat{\mathbf{x}})$, é aplicado o critério que um mínimo ou máximo pode ser achado quando $\frac{\partial e(\hat{\mathbf{x}})}{\partial \mathbf{x}} = [0 \ 0 \ \dots \ 0]^T$. Assim, usando o Teorema 2.6.1 podemos rescrever esta igualdade como a Eq. (3.23),

$$2\mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} \{\mathbf{J}(\mathbf{p}) [\hat{\mathbf{x}} - \mathbf{p}] - [\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p})]\} + 2\alpha \mathbf{D} [\mathbf{x} - \mathbf{q}] \approx \frac{\partial e(\hat{\mathbf{x}})}{\partial \mathbf{x}} = [0 \ 0 \ \dots \ 0]^T, \quad (3.23)$$

de modo que pode ser aproximado $\hat{\mathbf{x}}$ como:

$$\hat{\mathbf{x}} \approx \mathbf{p} + [\mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{p}) + \alpha \mathbf{D}]^{-1} \{\mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} [\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p})] - \alpha \mathbf{D} [\mathbf{p} - \mathbf{q}]\}. \quad (3.24)$$

Assim, quanto mais próximo seja a $\hat{\mathbf{x}}$ o valor escolhido \mathbf{p} , a Eq. (3.24) fica mais próximo a uma igualdade. Por outro lado, a equação nos indica que dado um ponto \mathbf{p} qualquer, $\mathbf{p} + [\mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{p}) + \alpha \mathbf{D}]^{-1} \{\mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} [\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p})] - \alpha \mathbf{D} [\mathbf{p} - \mathbf{q}]\}$ é um ponto próximo de \mathbf{p} na direção de um mínimo ou máximo de $e(\mathbf{x})$. Assim, um bom critério para procurar um mínimo ou máximo é seguir a seguinte equação iterativa,

$$\mathbf{p}_k \leftarrow \mathbf{p}_{k-1} + [\mathbf{J}(\mathbf{p}_{k-1})^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{p}_{k-1}) + \alpha \mathbf{D}]^{-1} \{\mathbf{J}(\mathbf{p}_{k-1})^T \mathbf{C} [\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p}_{k-1})] - \alpha \mathbf{D} [\mathbf{p}_{k-1} - \mathbf{q}]\}, \quad (3.25)$$

iniciando desde um \mathbf{p}_0 qualquer, ate que \mathbf{p}_k seja muito próximo a \mathbf{p}_{k-1} , onde se declara que $\hat{\mathbf{x}} \approx \mathbf{p}_k$; porem deve ser corroborado que esse ponto tratasse de um máximo ou mínimo usando algum método, por exemplo estudando o comportamento de $e(\mathbf{x})$ ou analisando a matriz hessiana de $e(\mathbf{x})$ avaliada em $\hat{\mathbf{x}}$.

Prova 3.4 — Prova do Teorema 3.4.1. Dados, um escalar $\alpha \in \mathbb{R}$, um vetor coluna $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$, um vetor coluna $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$, uma função $\mathbf{f} : \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$, uma matriz diagonal $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$, uma matriz diagonal $\mathbf{D} \in \mathbb{R}^{N \times N}$, e definida a Eq. (3.26),

$$e(\mathbf{x}) = \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x}\|_{\mathbf{D}}^2. \quad (3.26)$$

Para achar o valor $\hat{\mathbf{x}}$ que gere o menor valor de $e(\hat{\mathbf{x}})$, é aplicado o critério que um mínimo ou máximo pode ser achado quando $\frac{\partial e(\hat{\mathbf{x}})}{\partial \mathbf{x}} = [0 \ 0 \ \dots \ 0]^T$. Assim, usando a Prova 3.3 para o caso de $\mathbf{q} = 0$, sabemos que um bom critério para procurar um mínimo ou máximo é seguir a seguinte equação iterativa,

$$\mathbf{p}_k \leftarrow \mathbf{p}_{k-1} + [\mathbf{J}(\mathbf{p}_{k-1})^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{p}_{k-1}) + \alpha \mathbf{D}]^{-1} \{\mathbf{J}(\mathbf{p}_{k-1})^T \mathbf{C} [\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p}_{k-1})] - \alpha \mathbf{D} \mathbf{p}_{k-1}\}, \quad (3.27)$$

iniciando desde um \mathbf{p}_0 qualquer, ate que \mathbf{p}_k seja muito próximo a \mathbf{p}_{k-1} , onde se declara que $\hat{\mathbf{x}} \approx \mathbf{p}_k$;

porem deve ser corroborado que esse ponto tratasse de um máximo ou mínimo usando algum método, por exemplo estudando o comportamento de $e(\mathbf{x})$ ou analisando a matriz hessiana de $e(\mathbf{x})$ avaliada em $\hat{\mathbf{x}}$.

Prova 3.5 — Prova do Teorema 3.5.1. Dados, um escalar $\alpha \in \mathbb{R}$, um vetor coluna $\mathbf{x} \in \mathbb{R}^N$, um vetor coluna $\mathbf{x}_{last} \in \mathbb{R}^N$ (constante), um vetor coluna $\mathbf{b} \in \mathbb{R}^M$, uma função $\mathbf{f}: \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^M$, uma matriz diagonal $\mathbf{C} \in \mathbb{R}^{M \times M}$, uma matriz diagonal $\mathbf{D} \in \mathbb{R}^{N \times N}$, e definida a Eq. (3.28),

$$e(\mathbf{x}) = \|\mathbf{f}(\mathbf{x}) - \mathbf{b}\|_{\mathbf{C}}^2 + \alpha \|\mathbf{x} - \mathbf{x}_{last}\|_{\mathbf{D}}^2. \quad (3.28)$$

Para achar o valor $\hat{\mathbf{x}}$ que gere o menor valor de $e(\hat{\mathbf{x}})$, é aplicado o critério que um mínimo ou máximo pode ser achado quando $\frac{\partial e(\hat{\mathbf{x}})}{\partial \mathbf{x}} = [0 \ 0 \ \dots \ 0]^T$. Assim, usando o Teorema 2.6.1 podemos rescrever esta igualdade como a Eq. (3.29),

$$2\mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} \{\mathbf{J}(\mathbf{p}) [\hat{\mathbf{x}} - \mathbf{p}] - [\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p})]\} + 2\alpha \mathbf{D} [\mathbf{x} - \mathbf{x}_{last}] \approx \frac{\partial e(\hat{\mathbf{x}})}{\partial \mathbf{x}} = [0 \ 0 \ \dots \ 0]^T, \quad (3.29)$$

de modo que pode ser aproximado $\hat{\mathbf{x}}$ como:

$$\hat{\mathbf{x}} \approx \mathbf{p} + [\mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{p}) + \alpha \mathbf{D}]^{-1} \{\mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} [\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p})] - \alpha \mathbf{D} [\mathbf{p} - \mathbf{x}_{last}]\}. \quad (3.30)$$

Assim, quanto mais próximo seja a $\hat{\mathbf{x}}$ o valor escolhido \mathbf{p} , a Eq. (3.30) fica mais próximo a uma igualdade. Por outro lado, a equação nos indica que dado um ponto \mathbf{p} qualquer, $\mathbf{p} + [\mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{p}) + \alpha \mathbf{D}]^{-1} \{\mathbf{J}(\mathbf{p})^T \mathbf{C} [\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p})] - \alpha \mathbf{D} [\mathbf{p} - \mathbf{x}_{last}]\}$ é um ponto próximo de \mathbf{p} na direção de um mínimo ou máximo de $e(\mathbf{x})$. Assim, igualando $\mathbf{p}_k = \mathbf{x}_{last}$, um bom critério para procurar um mínimo ou máximo é seguir a seguinte equação iterativa,

$$\mathbf{p}_k \leftarrow \mathbf{p}_{k-1} + [\mathbf{J}(\mathbf{p}_{k-1})^T \mathbf{C} \mathbf{J}(\mathbf{p}_{k-1}) + \alpha \mathbf{D}]^{-1} \{\mathbf{J}(\mathbf{p}_{k-1})^T \mathbf{C} [\mathbf{b} - \mathbf{f}(\mathbf{p}_{k-1})]\}, \quad (3.31)$$

iniciando desde um \mathbf{p}_0 qualquer, ate que \mathbf{p}_k seja muito próximo a \mathbf{p}_{k-1} , onde se declara que $\hat{\mathbf{x}} \approx \mathbf{p}_k$; porem deve ser corroborado que esse ponto tratasse de um máximo ou mínimo usando algum método, por exemplo estudando o comportamento de $e(\mathbf{x})$ ou analisando a matriz hessiana de $e(\mathbf{x})$ avaliada em $\hat{\mathbf{x}}$.



4. Minimização do erro em funções: $\mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$

4.1 Minimização de $\|h(x) - a\|^2$

Teorema 4.1.1 — Solução iterativa. Dados, um escalar $x \in \mathbb{R}$, um escalar $a \in \mathbb{R}$, uma função $h : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, e definida a Eq. (4.1),

$$e(x) = \|h(x) - a\|^2. \quad (4.1)$$

Se desejamos ter o valor \hat{x} que minimiza o escalar $e(\hat{x})$, este valor pode ser achado usando iterativamente a Eq. (4.2), onde $h'(x) \equiv \frac{\partial h(x)}{\partial x}$.

$$x_{k+1} \leftarrow x_k - \frac{h(x_k) - a}{h'(x_k)}, \quad (4.2)$$

Assim, \hat{x} pode ser achado iniciando a Eq. (4.2) desde um x_0 qualquer,

- ate que x_k seja muito próximo a x_{k-1} (convergência de x_k) ou
- ate que $h(x_k)$ seja muito próximo a a , se conhecemos que esta igualdade é possível,

onde pode ser declarado que $\hat{x} \approx x_k$.

No processo de busca, podemos ter 3 diferentes casos:

- **Quando x_k converge:** Se a Eq. (4.2), converge a um valor \hat{x} , então este se trata de um mínimo absoluto de $e(x)$, ou seja $\hat{x} \approx x_k \approx x_{k-1}$, ver Prova 4.1 e Exemplos 4.1 e 4.2.
- **Quando x_k diverge:** Acontece quando se tem passado por um valor de x_k com $0 < |h'(x_k)| < \lim_{\varepsilon \rightarrow +0} \varepsilon$. Esta característica da Eq. (4.2) é um problema, quando o mínimo valor de $e(x)$ coincide com um lugar onde $h'(x) = 0$, ver Exemplo 4.1; pois quando se está perto da solução a busca diverge.

- **Quando é não computável:** Sim se obtêm um ponto x_k onde $h'(x_k) = 0$, deve ser verificado se $e(x_k)$ é um mínimo, um máximo, relativo ou absoluto, ou um ponto de inflexão.

Para reconhecer o tipo de ponto crítico de $e(x)$, e saber se a busca deve ser continuada desde outro ponto, podemos seguir vários procedimentos; por exemplo, estudar o comportamento de $e(x_k)$ e/ou analisar $\frac{\partial^2 e(x)}{\partial x^2}$ avaliada em x_k .

Uma forma de iterar, como a vista na Eq (4.2) é conhecida como método de Newton, porem pela forma de como esta expressão foi deduzida também poderíamos ligar esta ao método de regularização de Tikhonov. A demonstração da Eq (4.2) pode ser vista na Prova 4.1.

■ **Exemplo 4.1** A Fig. 4.1a nos mostra o processo de busca de um mínimo de $e(x) = (h(x) - a)^2$, quando $h(x) = x^2$ e $a = 1$. A busca inicia em $x_0 = -1.5$, todos os valores x_k podem ser vistos na segunda coluna da Tabela 4.1. Neste caso a Eq. (4.2) **converge** sem problemas em $\hat{x} = -1$ com $e(\hat{x}) = 0$, pois no caminho não foi achado nenhum ponto x_k com $h(x_k) \cong 0$.

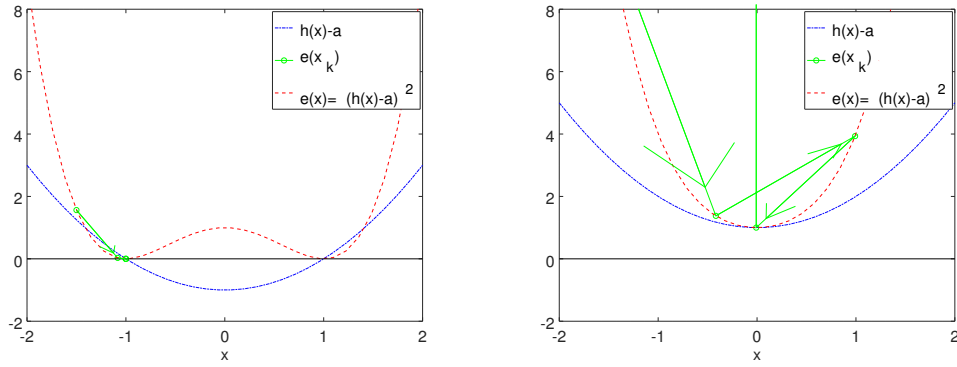
Por outro lado, a Fig. 4.1b nos mostra o processo de busca de um mínimo de $e(x) = (h(x) - a)^2$, quando $h(x) = x^2$ e $a = -1$. A busca inicia em $x_0 = -1.5$, todos os valores x_k podem ser vistos na terceira coluna da Tabela 4.1. Neste caso a Eq. (4.2) **diverge** em $\hat{x} = 0$ com $e(\hat{x}) = 0$ que é o mínimo; ao principio os valores de x_k tendem a procurar o mínimo; porem, perto de este valor se cumpre que $h(x_k) \cong 0$, e o valor de x_k diverge a um valor muito longe do mínimo; é fácil de observar, que neste caso se produz uma especie de efeito sanfona, onde x_k se aproxima ao mínimo $e(x)$, e quando está perto do mínimo o valor volta divergir. ■

	$e(x) = (x^2 - 1)^2$	$e(x) = (x^2 + 1)^2$
k	x_k	x_k
0	-1.5000	-1.5000
1	-1.0833	-0.41667
2	-1.0032	+0.99167
3	-1.0000	-0.0083683
4	-1.0000	+59.745

Table 4.1: Convergência para $h(x) = x^2$ da equação iterativa do Teorema 4.1.1

■ **Exemplo 4.2** A Fig. 4.2a nos mostra o processo de busca de um mínimo de $e(x) = (h(x) - a)^2$, quando $h(x) = x^3$ e $a = 1$; A busca inicia em $x_0 = -1.5$, todos os valores x_k podem ser vistos na segunda coluna da Tabela 4.2. Neste caso a Eq. (4.2) **diverge** em valores de x_k próximos a 0, pois provocam valores $h'(x_k) \cong 0$, este valor corresponde com um ponto de inflexão de $e(x)$.

Por outro lado, a Fig. 4.2b nos mostra o processo de busca de um mínimo de $e(x) = (h(x) - a)^2$, quando $h(x) = x^3$ e $a = -1$. A busca inicia em $x_0 = -1.5$, todos os valores de x_k podem ser vistos na terceira coluna da Tabela 4.2. Neste caso a Eq. (4.2) **converge** em $\hat{x} = -1$ com $e(\hat{x}) = 0$, sendo este um mínimo absoluto. ■

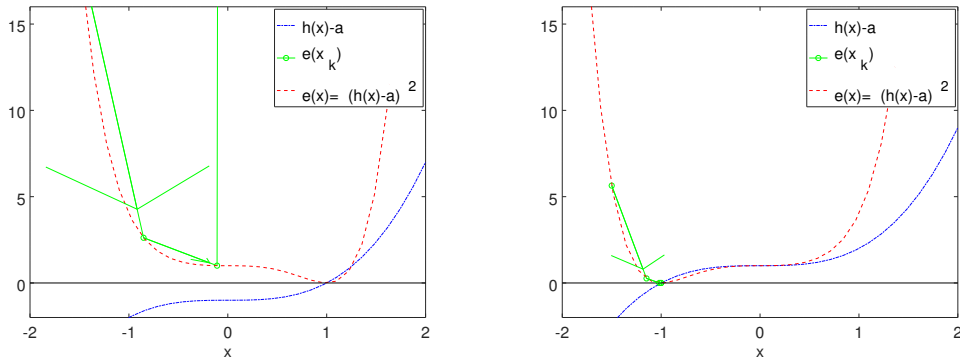


(a) Usando $h(x) = x^2$ e $a = 1$, as iterações convergem (b) Usando $h(x) = x^2$ e $a = -1$, as iterações divergem

Figure 4.1: Comportamento para $h(x) = x^2$ da equação iterativa do Teorema 4.1.1

	$e(x) = (x^3 - 1)^2$	$e(x) = (x^3 + 1)^2$
k	x_k	x_k
0	-1.50000	-1.5000
1	-0.85185	-1.1481
2	-0.10854	-1.0183
3	28.21988	-1.0003
4	18.81368	-1.0000

Table 4.2: Convergência para $h(x) = x^3$ da equação iterativa do Teorema 4.1.1



(a) Usando $h(x) = x^3$ e $a = 1$, as iterações divergem (b) Usando $h(x) = x^3$ e $a = -1$, as iterações convergem

Figure 4.2: Comportamento para $h(x) = x^3$ da equação iterativa do Teorema 4.1.1

4.2 Minimização de $\|h(x) - a\|^2 + \alpha\|x - b\|^2$

Teorema 4.2.1 — Solução iterativa. Dados, um escalar $\alpha \in \mathbb{R} | \alpha > 0$, um escalar $x \in \mathbb{R}$, um escalar $a \in \mathbb{R}$, uma função $h : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, e definida a Eq. (4.3),

$$e(x) = \|h(x) - a\|^2 + \alpha\|x - b\|^2. \quad (4.3)$$

Se desejamos ter o valor \hat{x} que minimiza o escalar $e(\hat{x})$, este valor pode ser achado usando iterativamente a Eq. (4.4), onde $h'(x) \equiv \frac{\partial h(x)}{\partial x}$,

$$x_{k+1} \leftarrow x_k - \frac{h'(x_k)[h(x_k) - a] + \alpha[x_k - b]}{[h'(x_k)]^2 + \alpha} \quad (4.4)$$

Assim, \hat{x} pode ser achado iniciando a Eq. (4.4) desde um x_0 qualquer,

- ate que x_k seja muito próximo a x_{k-1} (convergência de x_k) ou
- ate que $h(x_k)$ seja muito próximo a a , se conhecemos que esta igualdade é possível,

onde pode ser declarado que $\hat{x} \approx x_k$.

No processo de busca, podemos ter 3 diferentes casos:

- **Quando x_k converge:** Se a Eq. (4.4), converge a um valor \hat{x} , então este se trata de um mínimo, relativo ou absoluto, ou ponto de inflexão de $e(x)$. Ver Prova 4.2 e Exemplo 4.3. É importante ressaltar que quanto maior seja o valor de α maior será a diferencia do ponto mínimo de $e(x)$ e $(h(x) - a)^2$.
- **Quando x_k diverge:** Acontece quando $h'(x) \approx 0$ e o fator $0 < \alpha < \lim_{\varepsilon \rightarrow +0} \varepsilon$, ver Exemplo 4.4; pois quando se está perto de um ponto crítico a busca diverge.

Para reconhecer o tipo de ponto crítico de $e(x)$, e souber se a busca deve ser continuada desde outro ponto, podemos seguir vários procedimentos; por exemplo, estudar o comportamento de $e(x_k)$ e/ou analisar $\frac{\partial^2 e(x)}{\partial x^2}$ avaliada em x_k .

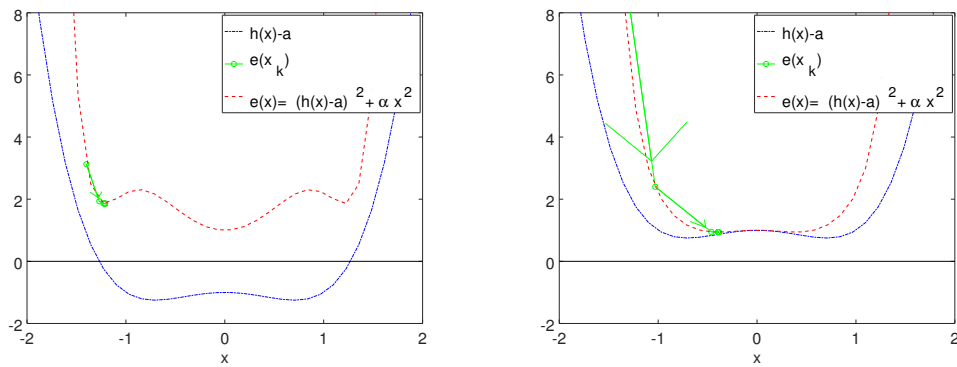
Uma forma de iterar, como a vista na Eq (4.4) é conhecida como método de regularização de Tikhonov. A demonstração pode ser vista na Prova 4.2.

■ **Exemplo 4.3** A Fig. 4.3a nos mostra o processo de busca de um mínimo de $e(x) = (h(x) - a)^2 + \alpha(x - b)^2$, quando $h(x) = x^2(x^2 - 1)$, $a = 1$, $b = 0$ e $\alpha = 1.2$. A busca inicia em $x_0 = -1.4$, todos os valores x_k podem ser vistos na segunda coluna da Tabela 4.3. Neste caso a Eq. (4.4) **converge** sem problemas em $\hat{x} = -1.21239$ com $e(\hat{x}) = 1.85954$; porem, este valor de x está longe do mínimo absoluto de $e(x)$ que está em $e(x = 0) = 1.0$; por outro lado, este valor de x está perto do mínimo absoluto de $(h(x) - a)^2$, que está em $x = \pm \sqrt{\frac{1+\sqrt{5}}{2}} \approx \pm 1.2720$. Isto é consequência do uso do fator $\alpha > 0$, pelo qual é de esperar que quanto maior seja o valor de α maior será a diferencia do mínimo absoluto de $e(x)$ e de $(h(x) - a)^2$.

A Fig. 4.3b nos mostra o processo de busca de um mínimo de $e(x) = (h(x) - a)^2 + \alpha(x - b)^2$, quando $h(x) = x^2(x^2 - 1)$, $a = -1$, $b = 0$ e $\alpha = 1.2$. A busca inicia em $x_0 = -1.4$, todos os valores x_k podem ser vistos na terceira coluna da Tabela 4.3. Neste caso a Eq. (4.4) **converge** em $\hat{x} = -0.39349$ com $e(\hat{x}) = 0.94120$ que é o mínimo absoluto de $e(x)$; porem, este valor de x_k está um pouco distante do mínimo de $(h(x) - a)^2$, localizado em $x = \pm \frac{\sqrt{2}}{2} \approx \pm 0.70711$. Novamente, isto é consequência do uso do fator $\alpha > 0$, assim, quanto maior seja o valor de α maior será a diferencia do mínimo absoluto de $e(x)$ e de $(h(x) - a)^2$.

■

	$e(x) = (x^2(x^2 - 1) - 1)^2 + 1.2x^2$	$e(x) = (x^2(x^2 - 1) + 1)^2 + 1.2x^2$
k	x_k	x_k
0	-1.4000	-1.40000
1	-1.2694	-1.02908
2	-1.2258	-0.46252
3	-1.2153	-0.38498
4	-1.2130	-0.39259
5	-1.2125	-0.39341
6	-1.2124	-0.39348
7	-1.2124	-0.39349

Table 4.3: Convergência para $h(x) = x^2(x^2 - 1)$ da equação iterativa do Teorema 4.2.1

(a) Usando $h(x) = x^2(x^2 - 1)$, $a = 1$, $b = 0$ e $\alpha = 1.2$, as iterações convergem
 (b) Usando $h(x) = x^2(x^2 - 1)$, $a = -1$, $b = 0$ e $\alpha = 1.2$, as iterações convergem

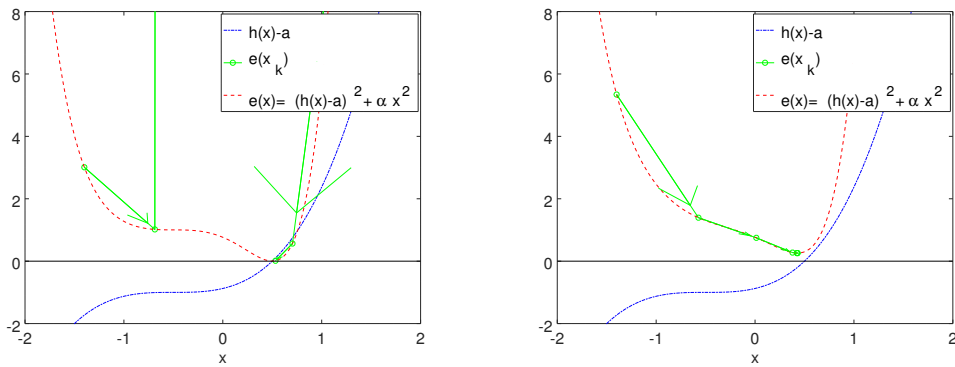
Figure 4.3: Comportamento para $h(x) = x^2(x^2 - 1)$ da equação iterativa do Teorema 4.2.1

■ **Exemplo 4.4** A Fig. 4.4a nos mostra o processo de busca de um mínimo de $e(x) = (h(x) - a)^2 + \alpha(x - b)^2$, quando $h(x) = (x + 0.5)^3$, $a = 1$, $b = 0$ e $\alpha = 0.01$. A busca inicia em $x_0 = -1.4$, todos os valores x_k podem ser vistos na segunda coluna da Tabela 4.4. Neste caso a Eq. (4.4) num principio **diverge** em pontos próximos a $x = -0.5$, apos a divergência, as iterações continuam desde $x = +4.665$ e estas **convergem** sem problemas em $\hat{x} = +0.53255$ com $e(\hat{x}) \approx 0.013$; este valor de x está perto do mínimo absoluto de $(h(x) - a)^2$, que está em $x = +0.5$. Isto é consequência do uso do fator $\alpha > 0$ e pequeno, pelo qual é de esperar que quanto maior seja o valor de α maior será a diferencia do mínimo absoluto de $e(x)$ e de $(h(x) - a)^2$.

A Fig. 4.4b nos mostra o processo de busca de um mínimo de $e(x) = (h(x) - a)^2 + \alpha(x - b)^2$, quando $h(x) = (x + 0.5)^3$, $a = 1$, $b = 0$ e $\alpha = 1.2$. A busca inicia em $x_0 = -1.4$, todos os valores x_k podem ser vistos na terceira coluna da Tabela 4.4. Neste caso a Eq. (4.4) **converge** em $\hat{x} = +0.428757$ com $e(\hat{x}) \approx 0.26$, que é o mínimo absoluto de $e(x)$; porem, este valor de x_k está um pouco distante do mínimo de $(h(x) - a)^2$, localizado em $x = +0.5$. Novamente, isto é consequência do uso do fator $\alpha > 0$ e grande.

■

	$e(x) = ((x+0.5)^3 - 1)^2 + 0.01x^2$	$e(x) = ((x+0.5)^3 + 1)^2 + 1.2x^2$
k	x_k	x_k
0	-1.40000	-1.40000
1	-0.68731	-0.572195
2	+4.66500	+0.012916
3	+2.95583	+0.378950
4	+1.83178	+0.422950
5	+1.11578	+0.427972
6	+0.70475	+0.428660
7	+0.53255	+0.428757

Table 4.4: Convergência para $h(x) = (x+0.5)^3$ da equação iterativa do Teorema 4.2.1

(a) Usando $h(x) = (x+0.5)^3$, $a = 1$ e $\alpha = 0.01$, as iterações divergem e logo convergem
 (b) Usando $h(x) = (x+0.5)^3$, $a = 1$ e $\alpha = 1.2$, as iterações convergem no mínimo absoluto

Figure 4.4: Comportamento para $h(x) = (x+0.5)^3$ da equação iterativa do Teorema 4.2.1

4.3 Minimização de $\|h(x) - a\|^2 + \alpha\|x - x_{old}\|^2$

Teorema 4.3.1 — Solução iterativa. Dados, um escalar $\alpha \in \mathbb{R} | \alpha > 0$, um escalar $x \in \mathbb{R}$, um escalar $a \in \mathbb{R}$, uma função $h : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, e definida a Eq. (4.5),

$$e(x) = \|h(x) - a\|^2 + \alpha\|x - x_{old}\|^2. \quad (4.5)$$

Se desejamos ter o valor \hat{x} que minimiza o escalar $e(\hat{x})$, este valor pode ser achado usando iterativamente a Eq. (4.6),

$$x_{k+1} \leftarrow x_k + \frac{h'(x_k)[a - h(x_k)]}{[h'(x_k)]^2 + \alpha} \quad (4.6)$$

Onde $h'(x) = \frac{\partial h(x)}{\partial x}$. Assim, \hat{x} pode ser achado iniciando a Eq. (4.6) desde um x_0 qualquer, ate que x_k seja muito próximo a x_{k+1} , onde se declara que $\hat{x} \approx x_{k+1}$; porem deve ser corroborado que esse ponto tratasse de um máximo ou mínimo usando algum método, por exemplo estudando o comportamento de $e(x)$ ou analisando $\frac{\partial^2 e(x)}{\partial x^2}$ avaliada em \hat{x} .

[FALTA PROVA!!!] A demonstração pode ser vista na Prova ??.

4.4 Provas dos teoremas

Prova 4.1 — Prova do Teorema 4.1.1. Dados, um escalar $x \in \mathbb{R}$, um escalar $a \in \mathbb{R}$, uma função $h : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, e definida a Eq. (4.7),

$$e(x) = \|h(x) - a\|^2. \quad (4.7)$$

Para achar o valor \hat{x} que gere o menor valor de $e(x)$, é aplicado o critério que um ponto crítico (máximo, mínimo ou ponto de inflexão) de $e(x)$ pode ser achado quando $\left. \frac{\partial e(x)}{\partial x} \right|_{x=\hat{x}} \equiv e'(\hat{x}) = 0$. Assim, usando o Teorema 2.4.1 podemos rescrever esta igualdade como a Eq. (4.8),

$$2h'(x) [h(x) - a] = e'(x) = 0, \quad (4.8)$$

Da Eq. (4.8), observamos que existem duas formas de achar um ponto crítico em $e(x)$,

- a primeira é achando um valor x^* tal que $h'(x^*) = 0$, e
- a segunda forma é achando um valor \hat{x} tal que $h(\hat{x}) - a = 0$;

de isto se deduz que, um valor x^* que provoque $h'(x^*) = 0$, representa um ponto crítico de $e(x)$ e $h(x)$; porem, um ponto \hat{x} que provoque $h(\hat{x}) - a = 0$, representa um ponto crítico de $e(x)$, mas não necessariamente de $h(x)$. Assim, dada a natureza positiva de $e(x)$, os pontos críticos diferente dos existentes em $h(x)$, são obrigatoriamente mínimos absolutos, pois provocam $e(\hat{x})=0$.

Por outro lado, usando o Teorema 2.4.2 podemos rescrever a Eq. (4.8) de forma aproximada como a Eq. (4.9),

$$2h'(p) [(h(p) - a) + h'(p)(\hat{x} - p)] \approx e'(\hat{x}) = 0. \quad (4.9)$$

de modo que, se consideramos $h'(p) \neq 0$, a equação pode ser rescrita como:

$$\hat{x} \approx p - \frac{(h(p) - a)}{h'(p)}. \quad (4.10)$$

Isto quer dizer que a Eq. 4.10, **serve só para achar pontos críticos de $e(x)$ que não pertençam a $h(x)$** . Sendo este obrigatoriamente um ponto onde $h(\hat{x}) - a \approx 0$, equivalente a um mínimo absoluto.

Assim, quanto mais próximo a \hat{x} seja o valor p , a Eq. (4.10) fica mais próximo a uma igualdade. Por outro lado, a equação nos indica que dado um ponto p qualquer, $p - [h'(p)]^{-1}(h(p) - a)$ é um ponto próximo de p na direção de um mínimo de $e(x)$. De modo que, um bom critério para procurar um mínimo é seguir a seguinte equação iterativa,

$$p_k \leftarrow p_{k-1} - \frac{(h(p_{k-1}) - a)}{h'(p_{k-1})}, \quad (4.11)$$

iniciando desde um p_0 qualquer, ate que p_k seja muito próximo a p_{k-1} , onde se declara que $\hat{x} \approx p_k$.

porem deve-se ter cuidado com valores de p_k que provoquem $0 < |h'(p_k)| < \lim_{\varepsilon \rightarrow +0} \varepsilon$, pois estes valores tendem a divergir. Por outro lado sim se acha um valor de p_k com $h'(p_k) = 0$, deve ser corroborado se este ponto tratasse de um máximo ou mínimo, relativo ou absoluto, ou ponto de inflexão; usando algum método, por exemplo estudando o comportamento de $e(x)$ ou analisando a

matriz hessiana de $e(x)$ avaliada em p_k .

Prova 4.2 — Prova do Teorema 4.2.1. Dados, um escalar $x \in \mathbb{R}$, um escalar $a \in \mathbb{R}$, um escalar $\alpha \in \mathbb{R}^+$, um escalar $b \in \mathbb{R}$, uma função $h : \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, e definida a Eq. (4.12),

$$e(x) = \|h(x) - a\|^2 + \alpha \|x - b\|^2. \quad (4.12)$$

Para achar o valor \hat{x} que gere o menor valor de $e(x)$, é aplicado o critério que um ponto crítico (máximo, mínimo ou ponto de inflexão) de $e(x)$ pode ser achado quando $\left. \frac{\partial e(x)}{\partial x} \right|_{x=\hat{x}} \equiv e'(\hat{x}) = 0$. Assim, usando o Teorema 2.4.1 e 2.3.1 podemos rescrever esta igualdade como a Eq. (4.13),

$$2h'(x)[h(x) - a] + 2\alpha(x - b) = e'(x) = 0, \quad (4.13)$$

Da Eq. (4.13), observamos que existem duas formas de achar um ponto crítico em $e(x)$,

- a primeira é sim $h'(x)$ tem um fator $(x - b)$ tal que $h'(b) = 0$, e
- a segunda forma é achando um valor \hat{x} tal que $e'(\hat{x}) = 0$;

de isto se deduz que se $h'(x)$ tem um fator $(x - b)$ então, $x = b$ representa um ponto crítico de $e(x)$ e $h(x)$; porem, existe um ponto \hat{x} que provoca $e'(\hat{x}) = 0$, representa um ponto crítico de $e(x)$, exclusivamente. Assim, dada a natureza positiva de $e(x)$, este é obrigatoriamente um mínimo absoluto de $e(x)$.

Por outro lado, usando o Teorema 2.6.1 podemos rescrever a Eq. (4.13) de forma aproximada como a Eq. (4.14),

$$2h'(p)[(h(p) - a) + h'(p)(\hat{x} - p)] \approx e'(\hat{x}) = 0. \quad (4.14)$$

de modo que, se consideramos $h'(p) \neq 0$, a equação pode ser rescrita como:

$$\hat{x} \approx p - \frac{(h(p) - a)}{h'(p)}. \quad (4.15)$$

Isto quer dizer que a Eq. 4.15, **serve só para achar pontos críticos de $e(x)$ que não pertençam a $h(x)$** . Sendo este obrigatoriamente um ponto onde $h(\hat{x}) - a \approx 0$, equivalente a um mínimo absoluto.

Assim, quanto mais próximo a \hat{x} seja o valor p , a Eq. (4.15) fica mais próximo a uma igualdade. Por outro lado, a equação nos indica que dado um ponto p qualquer, $p - [h'(p)]^{-1}(h(p) - a)$ é um ponto próximo de p na direção de um mínimo de $e(x)$. De modo que, um bom critério para procurar um mínimo é seguir a seguinte equação iterativa,

$$p_k \leftarrow p_{k-1} - \frac{(h(p_{k-1}) - a)}{h'(p_{k-1})}, \quad (4.16)$$

iniciando desde um p_0 qualquer, ate que p_k seja muito próximo a p_{k-1} , onde se declara que $\hat{x} \approx p_k$.

porem deve-se ter cuidado com valores de p_k que provoquem $0 < |h'(p_k)| < \lim_{\varepsilon \rightarrow +0} \varepsilon$, pois estes valores tendem a divergir. Por outro lado sim se acha um valor de p_k com $h'(p_k) = 0$, deve ser corroborado se este ponto tratasse de um máximo ou mínimo, relativo ou absoluto, ou ponto de inflexão; usando algum método, por exemplo estudando o comportamento de $e(x)$ ou analisando a

matriz hessiana de $e(x)$ avaliada em p_k .



Problemas de achar raízes de funções

5	Raízes de funções: $\mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$	51
5.1	Raiz de $h(x)$ acotada entre a e b	
5.2	Raiz de $h(x)$ não acotada (Métodos iterativos)	
	Bibliography	53
	Miscelânea	
	Livros	
	Artigos	
	Index	55



5. Raíces de funções: $\mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$

5.1 Raiz de $h(x)$ acotada entre a e b

5.1.1 Método de la falsa posición

5.1.2 Método de bisección

5.2 Raiz de $h(x)$ não acotada (Métodos iterativos)

5.2.1 Método de las aproximaciones sucesivas

5.2.2 Método de la secante

5.2.3 Método de Newton



Bibliografia

Miscelânea

- [1] *Gradient. Encyclopedia of Mathematics*. URL: <http://www.encyclopediaofmath.org/index.php?title=Gradient&oldid=28205> (cited on page 19).
- [2] *Hessian of a function. L.D. Ivanov (originator), Encyclopedia of Mathematics*. URL: http://www.encyclopediaofmath.org/index.php?title=Hessian_of_a_function&oldid=19311 (cited on pages 19, 26).
- [3] *Jacobian. Encyclopedia of Mathematics*. URL: <http://www.encyclopediaofmath.org/index.php?title=Jacobian&oldid=28782> (cited on pages 19, 25, 26, 34, 35).
- [4] *Taylor series. Encyclopedia of Mathematics*. URL: http://www.encyclopediaofmath.org/index.php?title=Taylor_series&oldid=31211 (cited on pages 20, 21, 25, 26).

Livros

Artigos



Index

G

Gradiente 19, 21

S

Serie de Taylor 19, 25, 26

M

Matriz Hessiana 19, 21, 26

Matriz Jacobiana 19, 21, 25

Minimização do erro quadrático

 Linear 33

 Não linear 34, 35, 40

Minimização, métodos

 Método de Newton 40

 Regularização de Tikhonov ... 34, 35, 40

P

Problema inverso

 Linear 33

 Não linear 34, 35, 40

Pseudo-inversa de Moore-Penrose 33