

Студент: Вячеслав Головин
Направление: Машинное обучение и анализ данных
Филиал: НИУ ВШЭ – Санкт-Петербург
Дата: 6 июня 2022 г.

Контрольная работа №2 (вариант 11)

Задача 1 Найти наилучшее приближение A_1 ранга 2 матрицы A по норме $\|\cdot\|_2$ и вычислить $\|A - A_1\|_2$, где

$$A = \begin{pmatrix} -8 & -42 & 9 & 40 \\ 10 & 48 & -54 & -2 \\ -67 & -12 & 36 & -22 \end{pmatrix}.$$

Сначала выполним сингулярное разложение $A = U\Sigma V^T$. Матрица V состоит из собственных векторов $A^T A$.

$$A^T A = \begin{pmatrix} 4653 & 1620 & -3024 & 1134 \\ 1620 & 4212 & -3402 & -1512 \\ -3024 & -3402 & 4293 & -324 \\ 1134 & -1512 & -324 & 2088 \end{pmatrix} \quad V = \frac{1}{11} \begin{pmatrix} -6 & -6 & 7 & 0 \\ -6 & 6 & 0 & 7 \\ 7 & 0 & 6 & 6 \\ 0 & -7 & -6 & 6 \end{pmatrix} \quad \lambda = (9801, 4356, 1089, 0)$$

Корни из собственных значений λ будут лежать на главной диагонали матрицы Σ

$$\Sigma = \begin{pmatrix} 99 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 66 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 33 & 0 \end{pmatrix}$$

Далее, воспользовавшись соотношением $AV = U\Sigma$, рассчитаем U

$$U = \frac{1}{3} \begin{pmatrix} 1 & -2 & -2 \\ -2 & 1 & -2 \\ 2 & 2 & -1 \end{pmatrix}$$

Теперь, воспользовавшись теоремой Эккарта–Янга, найдём A_1

$$A_1 = U\Sigma_r V^T = U \begin{pmatrix} 99 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 66 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{pmatrix} V^T = \begin{pmatrix} 6 & -42 & 21 & 28 \\ 24 & 48 & -42 & -14 \\ -60 & -12 & 42 & -28 \end{pmatrix}$$

Погрешность приближения

$$\|A - A_1\|_2 = \|\Sigma - \Sigma_r\|_2 = 33$$

Задача 2 Оценить относительную погрешность приближенного решения $(1, 1)$ системы $Ax = b$ по нормам $\|\cdot\|_1$ и $\|\cdot\|_2$ с помощью числа обусловленности матрицы A , где

$$A = \begin{pmatrix} 4.99 & 0.02 \\ -4.83 & -8.01 \end{pmatrix}, \quad b = \begin{pmatrix} 5.0 \\ -12.98 \end{pmatrix}$$

Очевидно, что решение $\hat{x} = (1, 1)$ получается при округлении A и b до целочисленных значений. Таким образом

$$\hat{A} = \begin{pmatrix} 5 & 0 \\ -5 & -8 \end{pmatrix} \quad \varepsilon_A = \hat{A} - A = \begin{pmatrix} 0.01 & -0.02 \\ -0.17 & 0.01 \end{pmatrix} \quad \hat{b} = \begin{pmatrix} 5 \\ -13 \end{pmatrix} \quad \Delta b = \hat{b} - b = \begin{pmatrix} 0 \\ -0.02 \end{pmatrix}$$

Погрешность решения относительно некоторой нормы $\|\cdot\|$ определяется выражением

$$\delta x \leq \frac{\kappa(A)}{1 - \kappa(A)\delta A}(\delta A + \delta b),$$

где $\kappa(A) = \|A\| \|A^{-1}\|$ – число обусловленности матрицы A ; $\delta A = \|\varepsilon_A\|/\|A\|$, $\delta b = \|\Delta b\|/\|b\|$. Обратная матрица

$$A^{-1} = \frac{1}{|A|} \begin{pmatrix} -8.01 & -0.02 \\ 4.83 & 4.99 \end{pmatrix} = \frac{1}{39.87} \begin{pmatrix} 8.01 & 0.02 \\ -4.83 & -4.99 \end{pmatrix}$$

Погрешность по норме $\|\cdot\|_1$:

$$\delta x \leq \frac{9.82 \cdot 0.32}{1 - 9.82 \cdot 0.32 \cdot (0.18/9.82)} \left(\frac{0.18}{9.82} + \frac{0.02}{17.98} \right) = \frac{3.16}{1 - 3.16 \cdot 0.018} (3.16 + 0.001) = 0.065$$

Погрешность по норме $\|\cdot\|_2$ (наибольшее сингулярное число):

$$\delta x \leq \frac{9.79 \cdot 0.25}{1 - 9.79 \cdot 0.25 \cdot (0.17/9.78)} \left(\frac{0.17}{9.78} + \frac{0.02}{13.91} \right) = 0.047$$

Задача 3 Найти приближенно обратную матрицу к матрице A и оценить погрешность приближения относительно равномерной нормы $\|\cdot\|_1$ если элементы матрицы A известны с абсолютной погрешностью 0.01.

$$A \approx \begin{pmatrix} 2 & -3 \\ 8 & -7 \end{pmatrix}$$

Если погрешность элементов матрицы A равна 0.01, то $\|\varepsilon_A\|_1 = 0.02$. Приближенное значение обратной матрицы, число обусловленности и относительное возмущение:

$$A^{-1} = \frac{1}{10} \begin{pmatrix} -7 & 3 \\ -8 & 2 \end{pmatrix} \quad \kappa(A) = \|A\|_1 \|A^{-1}\|_1 = 10 \cdot \frac{15}{10} = 15 \quad \delta A = \frac{\|\varepsilon_A\|_1}{\|A\|_1} = 0.002$$

Погрешность приближения

$$\delta A^{-1} = \frac{\kappa(A)\delta A}{1 - \kappa(A)\delta A} = \frac{15 \cdot 0.002}{1 - 15 \cdot 0.002} = \frac{0.03}{0.97} = 0.031$$

Задача 4 Найти самую влиятельную вершину в ориентированном графе с помощью алгоритма PageRank с коэффициентом ослабления $1 - \beta = 0.85$, где матрица смежности графа равна

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 1 & 1 & 1 \end{pmatrix}$$

...

Задача 5 Найти значение $f(A)$ функции $f(l) = e^{l+2}$, где

$$A = \begin{pmatrix} -24 & 7 & -6 \\ -84 & 24 & -20 \\ 36 & -10 & 10 \end{pmatrix}$$

...

Задача 6 Найти собственные значения методом вращений (метод Якоби) для матрицы

$$A = \begin{pmatrix} 4 & 1 & 1 \\ 1 & 8 & 3 \\ 1 & 3 & 8 \end{pmatrix}$$

...

Задача 7 Решить задачу линейного программирования и найти “теневые цены”, отвечающие каждому ограничению.

$$\begin{aligned} 16x_1 + 108x_2 + 24x_3 &\rightarrow \min \\ \begin{cases} -10x_1 + 6x_2 + 8x_3 \geq 4 \\ 4x_1 + 6x_2 - 7x_3 \geq 2 \\ x_1 \geq 0; x_2 \geq 0; x_3 \geq 0 \end{cases} \end{aligned}$$

...

Задача 8 Решить систему линейных уравнений методом итераций, преобразовав, если нужно, систему.

$$\begin{cases} 22x + 5y + 4z = 2 \\ 2x + 26y + 2z = 9 \\ 1x + 4y + 23z = 1 \end{cases}$$

Определить номер итерации, после которой погрешность приближения по каждой координате не превосходит 0.01 и найти соответствующее приближенное решение. За нулевое приближение принять вектор $x_0 = [0, 0, 0]^T$.

Преобразуем нашу систему к виду $X = PX + b$ (здесь и далее $X = (x, y, z)^T$). Для этого выразим x , y и z из 1, 2 и 3 уравнения, соответственно.

$$\begin{cases} x = -\frac{5}{22}y - \frac{2}{11}z + \frac{1}{11} \\ y = -\frac{1}{13}x - \frac{1}{13}z + \frac{9}{26} \\ z = -\frac{1}{23}x - \frac{4}{23}y + \frac{1}{23} \end{cases} \quad P = \begin{pmatrix} 0 & -5/22 & -2/11 \\ -1/13 & 0 & -1/13 \\ -1/23 & -4/23 & 0 \end{pmatrix} \quad b = \begin{pmatrix} 1/11 \\ 9/26 \\ 1/23 \end{pmatrix}$$

Нетрудно заметить, что $\|P\|_1 < 1$, соответственно итерационный метод должен сходиться к истинному решению системы. В случае произвольной матричной нормы, согласованной с векторной, число итераций определяется выражением

$$k = \left\lceil \ln \left(\frac{1 - \|P\|}{|X_1 - X_0| \varepsilon} \right) / \ln \|P\| \right\rceil,$$

где $\varepsilon = |X_k - \hat{X}|$, а $X_1 - X_0 = b$ при $X_0 = (0, 0, 0)^T$.

Очевидно, что если погрешность приближения по 1-норме не превосходит 0.01, то и приближение по каждой координате ≤ 0.01 . Тогда число итераций

$$k_1 = \left\lceil \ln \left(\frac{1 - 0.401}{0.481} 0.01 \right) / \ln 0.401 \right\rceil = \lceil 4.8 \rceil = 5$$

Но такое же утверждение справедливо и для 2-нормы, при этом число необходимых итераций

$$k_2 = \left\lceil \ln \left(\frac{1 - 0.328}{0.361} 0.01 \right) / \ln 0.328 \right\rceil = \lceil 3.6 \rceil = 4$$

оказывается меньше.

В таблице представлены полученные с помощью итерационного метода результаты. Видно, что после 4 итераций действительно достигается требуемая точность.

| № итерации k | x_k | y_k | z_k |
|----------------|-------|-------|--------|
| 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1 | 0.091 | 0.346 | 0.043 |
| 2 | 0.004 | 0.336 | -0.021 |
| 3 | 0.018 | 0.347 | -0.015 |
| 4 | 0.015 | 0.345 | -0.017 |
| ... | | | |
| 100 | 0.015 | 0.346 | -0.017 |

Задача 9 Найти неявное выражение кривой $f(x, y) = 0$ по данной параметризации

$$x = \frac{t}{t^2 + 2} \quad y = \frac{t^2 + 1}{t^3 - t^2 + 1}$$

...