从线性代数到张量计算

Tensor Computing: An Algebraic Perspective

陈新宇

程展鸿

赵熙乐

发布时间：2022 年 12 月

更新时间：2022 年 12 月

目录

前言

在过去的数十年间，随着信号处理、机器学习与数值计算等领域的快速发展，张量计算已从以线性代数为支撑的矩阵计算中逐步拓展开来，相关研究贯穿信号处理、机器学习等众多领域。随着大量张量计算算法涌现出来，我们不难发现：这些算法大多建立在张量分解的基础上。本文以张量计算这一概念为核心，将从线性代数出发，讲述张量计算相关的一系列内容。为了提高读者的阅读体验，笔者进行了以下尝试：

- **化繁为简**。将线性代数以及张量计算的范畴限定在实空间中。另外，严格来说，向量和矩阵属于低阶张量，为区分概念，我们默认常提到的张量特指高阶张量（阶数大于或等于 3）。
- **由浅入深**。从基本的线性代数内容展开，通过循序渐进的方式引出一系列矩阵分解与张量分解技术，使读者体会到线性代数的巨大价值。
- **熟能生巧**。本文在撰写过程中尽可能考虑初学者的学习历程，在全文中设计一系列难度适中的例题让读者更直观理解一系列理论，并通过练习熟练掌握相应内容。

笔者深感自身才疏学浅，对于线性代数和张量计算的认识具有一定的局限性，请广大读者批评指正。另外，全文内容设置的合理性也有待考究，需要等待读者的检验。尽管如此，笔者愿竭心力，在后续版本中逐步更新与完善本文，如有建议或疑问，请在 GitHub 开源项目`https://github.com/xinychen/tensor-book`的问答区与笔者进行互动交流。

作者声明：

- 撰写本文的初衷在于传播知识，为感兴趣的读者提供参考素材。
- 禁止将本文放在其他网站上供人下载，唯一下载网站为`https://xinychen.github.io/books/tensor_book.pdf`。
- 禁止将本文用于任何形式的商业活动。

第一章　代数结构

长期以来，线性代数一直作为机器学习中最为重要的数学工具之一，被人们广泛用于开发各类机器学习算法。线性代数本质上是以向量与矩阵为基本代数结构，本书要讨论的张量分解等模型则主要以张量为基本代数结构。在过去的数十年间，借助线性代数这一基本数学工具，机器学习中涌现出了很多经典的代数模型，这其中不乏矩阵分解、主成分分析，而张量分解在某种程度上可看作是矩阵分解的一种衍生物。

近年来，张量分解在机器学习的众多问题中得到了很好的应用，但关于张量的一些计算与我们所熟悉的线性代数却大相径庭，同时，张量计算相比以矩阵计算为主导的线性代数更为抽象，这使得很多与张量分解相关的内容看起来晦涩难懂。实际上，向量与矩阵都是张量的特例，可以被定义为低阶张量。一般而言，向量是第 1 阶张量，英文表述为 first-order tensor；矩阵是第 2 阶张量，英文表述为 second-order tensor；第 3 阶或者更高阶数的张量被称为高阶张量，英文表述为 higher-order tensor。在各类文献中，通常提到的张量都是特指高阶张量，当然，这在本书的叙述中也不例外。需要注意的是，在各类程序语言中，人们更愿意将张量称为多维数组。

在一个矩阵中，某一元素的位置可以说是“第 i 行、第 j 列”，即要描述某一元素的位置需用到行和列索引构成的组合 (i,j)。类似地，在一个第 3 阶张量中，描述某一元素的位置需用到三个索引构成的组合，例如 (i,j,k)。在处理稀疏矩阵或稀疏张量时，用索引来标记元素的位置会节省下一些不必要的存储开支。

1.1　向量与矩阵

1.2　张量

1.3　特殊代数结构

1.3.1　循环矩阵

循环矩阵 (circulant matrix) 是一种特殊的代数结构，广泛应用于信号处理等。从定义出发，给定任意向量 $\boldsymbol{x}=(x_1,x_2,\cdots,x_T)^\top\in\mathbb{R}^T$，其对应的循环矩阵可写作如下形式：

$$\mathcal{C}(\boldsymbol{x})\triangleq\begin{bmatrix}x_1 & x_T & \cdots & x_2\\ x_2 & x_1 & \cdots & x_3\\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots\\ x_T & x_{T-1} & \cdots & x_1\end{bmatrix}\in\mathbb{R}^{T\times T}\tag{1.1}$$

其中，$\mathcal{C}:\mathbb{R}^T\to\mathbb{R}^{T\times T}$ 表示循环算子 (circulant operator)。该循环矩阵的第一列为向量 $\boldsymbol{x}$ 本身，对角线元素均为 x_1。

例 1. 给定任意向量 $\boldsymbol{x}=(x_1,x_2,x_3,x_4,x_5)^\top\in\mathbb{R}^5$，试写出其对应的循环矩阵。

解. 向量 $\boldsymbol{x}$ 对应的循环矩阵为

$$\mathcal{C}(\boldsymbol{x})=\begin{bmatrix} x_1 & x_5 & x_4 & x_3 & x_2 \\ x_2 & x_1 & x_5 & x_4 & x_3 \\ x_3 & x_2 & x_1 & x_5 & x_4 \\ x_4 & x_3 & x_2 & x_1 & x_5 \\ x_5 & x_4 & x_3 & x_2 & x_1 \end{bmatrix}\in\mathbb{R}^{5\times 5} \tag{1.2}$$

例 2. 给定任意向量 $\boldsymbol{x}=(x_1,x_2,\cdots,x_T)^\top\in\mathbb{R}^T$ 与 $\boldsymbol{y}=(y_1,y_2,\cdots,y_T)^\top\in\mathbb{R}^T$，若两者之间的循环卷积 *(circular convolution)* 为 $\boldsymbol{z}=\boldsymbol{x}\star\boldsymbol{y}\in\mathbb{R}^T$，其中，符号 $\star$ 表示卷积运算，则向量 $\boldsymbol{z}$ 的任意元素为

$$z_t=\sum_{k=1}^{T}x_{t-k+1}y_k,\forall t\in\{1,2,\ldots,T\} \tag{1.3}$$

其中，当 $t+1\leq k$ 时，则令 $x_{t-k+1}=x_{t-k+1+T}$。试根据循环矩阵的定义写出循环卷积。

解. 在这里，循环卷积可写作如下形式：

$$\boldsymbol{z}=\boldsymbol{x}\star\boldsymbol{y}=\begin{bmatrix} x_1y_1+x_Ty_2+\cdots+x_2y_T \\ x_2y_1+x_1y_2+\cdots+x_3y_T \\ \vdots \\ x_Ty_1+x_{T-1}y_2+\cdots+x_1y_T \end{bmatrix}=\begin{bmatrix} x_1 & x_T & \cdots & x_2 \\ x_2 & x_1 & \cdots & x_3 \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ x_T & x_{T-1} & \cdots & x_1 \end{bmatrix}\begin{bmatrix} y_1 \\ y_2 \\ \vdots \\ y_T \end{bmatrix}=\mathcal{C}(\boldsymbol{x})\boldsymbol{y} \tag{1.4}$$

第二章 Kronecker 分解

Kronecker 分解是一种以 Kronecker 积为基础的分解形式，又被称为 Kronecker 积分解、Kronecker 积逼近 (Kronecker product approximation)、最近 Kronecker 积 (nearest Kronecker product) 等，它是矩阵计算与张量计算中十分重要的逼近问题。本章主要讲述 Kronecker 分解的一般形式、逼近问题、求解过程等。

2.1 朴素 Kronecker 分解

2.1.1 定义

一般而言，给定任意矩阵 $\boldsymbol{X}\in\mathbb{R}^{(mp)\times(nq)}$，若 $\boldsymbol{A}\in\mathbb{R}^{m\times n},\boldsymbol{B}\in\mathbb{R}^{p\times q}$ 为朴素 Kronecker 分解中的待定参数，则可将分解过程描述为如下优化问题：

$$\min_{\boldsymbol{A},\boldsymbol{B}}\|\boldsymbol{X}-\boldsymbol{A}\otimes\boldsymbol{B}\|_F^2 \tag{2.1}$$

其中，我们建模的目标是寻找最佳的矩阵 $\boldsymbol{A},\boldsymbol{B}$ 使得损失函数最小化。

为便于理解该优化问题，不妨用一组小矩阵一窥究竟，令 $m=3,n=p=q=2$，则此时的目标函数为

$$\|\boldsymbol{X}-\boldsymbol{A}\otimes\boldsymbol{B}\|_F^2=\left\|\left[\begin{array}{cc|cc}x_{11}&x_{12}&x_{13}&x_{14}\\x_{21}&x_{22}&x_{23}&x_{24}\\\hline x_{31}&x_{32}&x_{33}&x_{34}\\x_{41}&x_{42}&x_{43}&x_{44}\\\hline x_{51}&x_{52}&x_{53}&x_{54}\\x_{61}&x_{62}&x_{63}&x_{64}\end{array}\right]-\begin{bmatrix}a_{11}&a_{12}\\a_{21}&a_{22}\\a_{31}&a_{32}\end{bmatrix}\otimes\begin{bmatrix}b_{11}&b_{12}\\b_{21}&b_{22}\end{bmatrix}\right\|_F^2 \tag{2.2}$$

2.1.2 引入 permute 概念

在这里，我们引入 permute 概念是为了对矩阵的维度按照特定规则进行调整，这一做法最早是由 Van Loan 和 Pitsianis 于 1993 年提出的[1]。在公式(2.2)中，首先使用分块矩阵表示矩阵 $\boldsymbol{X}\in\mathbb{R}^{6\times 4}$：

$$\left[\begin{array}{cc|cc}x_{11}&x_{12}&x_{13}&x_{14}\\x_{21}&x_{22}&x_{23}&x_{24}\\\hline x_{31}&x_{32}&x_{33}&x_{34}\\x_{41}&x_{42}&x_{43}&x_{44}\\\hline x_{51}&x_{52}&x_{53}&x_{54}\\x_{61}&x_{62}&x_{63}&x_{64}\end{array}\right]=\begin{bmatrix}\boldsymbol{X}_{11}&\boldsymbol{X}_{12}\\\boldsymbol{X}_{21}&\boldsymbol{X}_{22}\\\boldsymbol{X}_{31}&\boldsymbol{X}_{32}\end{bmatrix} \tag{2.3}$$

[1]C. Van Loan, N. Pitsianis (1993). Approximation with Kronecker products. Linear Algebra for Large Scale and Real-Time Applications, 232: 293-314.

其中，分块矩阵分别为

$$\begin{aligned}\boldsymbol{X}_{11}&=\begin{bmatrix}x_{11}&x_{12}\\x_{21}&x_{22}\end{bmatrix}&\boldsymbol{X}_{12}&=\begin{bmatrix}x_{13}&x_{14}\\x_{23}&x_{24}\end{bmatrix}\\\boldsymbol{X}_{21}&=\begin{bmatrix}x_{31}&x_{32}\\x_{41}&x_{42}\end{bmatrix}&\boldsymbol{X}_{22}&=\begin{bmatrix}x_{33}&x_{34}\\x_{43}&x_{44}\end{bmatrix}\\\boldsymbol{X}_{31}&=\begin{bmatrix}x_{51}&x_{52}\\x_{61}&x_{62}\end{bmatrix}&\boldsymbol{X}_{32}&=\begin{bmatrix}x_{53}&x_{54}\\x_{63}&x_{64}\end{bmatrix}\end{aligned}\tag{2.4}$$

有了这些分块矩阵之后，需要对这些分块矩阵进行向量化，得到的向量依次为

$$\operatorname{vec}(\boldsymbol{X}_{11})=\begin{bmatrix}x_{11}\\x_{21}\\x_{12}\\x_{22}\end{bmatrix}\quad\operatorname{vec}(\boldsymbol{X}_{21})=\begin{bmatrix}x_{31}\\x_{41}\\x_{32}\\x_{42}\end{bmatrix}\quad\cdots\quad\operatorname{vec}(\boldsymbol{X}_{32})=\begin{bmatrix}x_{53}\\x_{63}\\x_{54}\\x_{64}\end{bmatrix}\tag{2.5}$$

最后，使用这些向量构造如下矩阵：

$$\tilde{\boldsymbol{X}}=\begin{bmatrix}\operatorname{vec}(\boldsymbol{X}_{11})^\top\\\operatorname{vec}(\boldsymbol{X}_{21})^\top\\\operatorname{vec}(\boldsymbol{X}_{31})^\top\\\operatorname{vec}(\boldsymbol{X}_{12})^\top\\\operatorname{vec}(\boldsymbol{X}_{22})^\top\\\operatorname{vec}(\boldsymbol{X}_{32})^\top\end{bmatrix}\in\mathbb{R}^{6\times 4}\tag{2.6}$$

在这里，将矩阵 $\boldsymbol{X}$ 构造成矩阵 $\tilde{\boldsymbol{X}}$ 的过程通常被称为 permute。

由于

$$\begin{aligned}\operatorname{vec}(\boldsymbol{X}_{11})&=a_{11}\cdot\operatorname{vec}(\boldsymbol{B})\\\operatorname{vec}(\boldsymbol{X}_{21})&=a_{21}\cdot\operatorname{vec}(\boldsymbol{B})\\&\vdots\\\operatorname{vec}(\boldsymbol{X}_{32})&=a_{32}\cdot\operatorname{vec}(\boldsymbol{B})\end{aligned}\tag{2.7}$$

此时，Kronecker 分解的优化问题可写作如下形式：

$$\arg\min_{\boldsymbol{A},\boldsymbol{B}}\ \|\boldsymbol{X}-\boldsymbol{A}\otimes\boldsymbol{B}\|_F^2=\arg\min_{\boldsymbol{A},\boldsymbol{B}}\|\tilde{\boldsymbol{X}}-\operatorname{vec}(\boldsymbol{A})\operatorname{vec}(\boldsymbol{B})^\top\|_F^2\tag{2.8}$$

实际上，向量化之后的待定参数 $\operatorname{vec}(\boldsymbol{A})$ 和 $\operatorname{vec}(\boldsymbol{B})$ 构成了一个标准的矩阵分解问题。

2.1.3 求解过程

对于公式(2.1)中 Kronecker 分解的优化问题，可根据 Eckhart-Young 定理对如下优化问题进行求解：

$$\min_{\boldsymbol{A},\boldsymbol{B}}\ \|\tilde{\boldsymbol{X}}-\operatorname{vec}(\boldsymbol{A})\operatorname{vec}(\boldsymbol{B})^\top\|_F^2\tag{2.9}$$

若 $\tilde{\boldsymbol{X}}$ 的奇异值分解为 $\tilde{\boldsymbol{X}}=\sum_{r=1}^{\min\{mn,pq\}}\sigma_r\boldsymbol{u}_r\boldsymbol{v}_r^\top$，其中，奇异值为 $\sigma_1\geq\sigma_2\geq\cdots\geq\sigma_{\min\{mn,pq\}}$，则矩阵 $\boldsymbol{A}$ 与 $\boldsymbol{B}$ 的最优解为

$$\begin{cases}\operatorname{vec}(\hat{\boldsymbol{A}})=\sqrt{\sigma_1}\cdot\boldsymbol{u}_1\\\operatorname{vec}(\hat{\boldsymbol{B}})=\sqrt{\sigma_2}\cdot\boldsymbol{v}_1\end{cases}\tag{2.10}$$

这里的最优解恰好是秩为 1 的逼近问题。

例 3. 给定矩阵 $\boldsymbol{A}=\begin{bmatrix}1&2\\3&4\end{bmatrix}$ 与 $\boldsymbol{B}=\begin{bmatrix}5&6&7\\8&9&10\end{bmatrix}$，试写出两者之间的 *Kronecker* 积 $\boldsymbol{X}=\boldsymbol{A}\otimes\boldsymbol{B}$，并求 *Kronecker* 分解 $\hat{\boldsymbol{A}},\hat{\boldsymbol{B}}=\underset{\boldsymbol{A},\boldsymbol{B}}{\arg\min}\ \|\boldsymbol{X}-\boldsymbol{A}\otimes\boldsymbol{B}\|_F^2$。

解. 矩阵 $\boldsymbol{A}$ 与 $\boldsymbol{B}$ 之间的 *Kronecker* 积为

$$\boldsymbol{X}=\boldsymbol{A}\otimes\boldsymbol{B}=\begin{bmatrix}1\times\begin{bmatrix}5&6&7\\8&9&10\end{bmatrix}&2\times\begin{bmatrix}5&6&7\\8&9&10\end{bmatrix}\\3\times\begin{bmatrix}5&6&7\\8&9&10\end{bmatrix}&4\times\begin{bmatrix}5&6&7\\8&9&10\end{bmatrix}\end{bmatrix}=\begin{bmatrix}5&6&7&10&12&14\\8&9&10&16&18&20\\15&18&21&20&24&28\\24&27&30&32&36&40\end{bmatrix}\tag{2.11}$$

令矩阵 $\boldsymbol{X}$ 由如下 *4* 个分块矩阵构成：

$$\begin{aligned}\boldsymbol{X}_{11}&=\begin{bmatrix}5&6&7\\8&9&10\end{bmatrix}\quad \boldsymbol{X}_{12}=\begin{bmatrix}10&12&14\\16&18&20\end{bmatrix}\\\boldsymbol{X}_{21}&=\begin{bmatrix}15&18&21\\24&27&30\end{bmatrix}\quad \boldsymbol{X}_{22}=\begin{bmatrix}20&24&28\\32&36&40\end{bmatrix}\end{aligned}\tag{2.12}$$

对这些分块矩阵分别进行向量化：

$$vec(\boldsymbol{X}_{11})=\begin{bmatrix}5\\8\\6\\9\\7\\10\end{bmatrix}\quad vec(\boldsymbol{X}_{21})=\begin{bmatrix}15\\24\\18\\27\\21\\30\end{bmatrix}\quad vec(\boldsymbol{X}_{12})=\begin{bmatrix}10\\16\\12\\18\\14\\20\end{bmatrix}\quad vec(\boldsymbol{X}_{22})=\begin{bmatrix}20\\32\\24\\36\\28\\40\end{bmatrix}\tag{2.13}$$

有了这些向量之后，构造如下矩阵：

$$\tilde{\boldsymbol{X}}=\begin{bmatrix}vec(\boldsymbol{X}_{11})^\top\\vec(\boldsymbol{X}_{21})^\top\\vec(\boldsymbol{X}_{12})^\top\\vec(\boldsymbol{X}_{22})^\top\end{bmatrix}=\begin{bmatrix}5&8&6&9&7&10\\15&24&18&27&21&30\\10&16&12&18&14&20\\20&32&24&36&28&40\end{bmatrix}\tag{2.14}$$

由此，*Kronecker* 分解的优化问题等价于

$$\hat{\boldsymbol{A}},\hat{\boldsymbol{B}}=\underset{\boldsymbol{A},\boldsymbol{B}}{\arg\min}\ \|\tilde{\boldsymbol{X}}-vec(\boldsymbol{A})vec(\boldsymbol{B})^\top\|_F^2\tag{2.15}$$

对矩阵 $\tilde{\boldsymbol{X}}$ 进行奇异值分解，则矩阵 $\hat{\boldsymbol{A}}$ 与 $\hat{\boldsymbol{B}}$ 分别为

$$\begin{aligned}\hat{\boldsymbol{A}}&=\begin{bmatrix}-1.85471325&-3.7094265\\-5.56413975&-7.418853\end{bmatrix}\\\hat{\boldsymbol{B}}&=\begin{bmatrix}-2.69583452&-3.23500142&-3.77416832\\-4.31333523&-4.85250213&-5.39166904\end{bmatrix}\end{aligned}\tag{2.16}$$

在这里，矩阵 $\hat{\boldsymbol{A}}$ 与 $\hat{\boldsymbol{B}}$ 的所有元素均为负数，可将这些元素全部写成相反数。

2.2 广义 Kronecker 分解

在《Convolutional neural network compression through generalized Kronecker product decomposition》中，作者给出了一种广义 Kronecker 分解。形式上说，给定任意矩阵 $\boldsymbol{X}\in$

$\mathbb{R}^{(mp)\times(nq)}$，若 $\boldsymbol{A}_r\in\mathbb{R}^{m\times n},\boldsymbol{B}_r\in\mathbb{R}^{p\times q},r=1,2,\ldots,R$ 为广义 Kronecker 分解中的待定参数，则可将分解过程描述为如下逼近问题：

$$\min_{\{\boldsymbol{A}_r,\boldsymbol{B}_r\}_{r=1}^R}\left\|\boldsymbol{X}-\sum_{r=1}^R\boldsymbol{A}_r\otimes\boldsymbol{B}_r\right\|_F^2 \tag{2.17}$$

其中，我们的建模目标是寻找最佳的矩阵 $\{\boldsymbol{A}_r,\boldsymbol{B}_r\}_{r=1}^R$ 使得损失函数最小化。

与朴素 Kronecker 分解类似，可先将广义 Kronecker 分解的逼近问题写作如下形式：

$$\underset{\{\boldsymbol{A}_r,\boldsymbol{B}_r\}_{r=1}^R}{\arg\min}\left\|\boldsymbol{X}-\sum_{r=1}^R\boldsymbol{A}_r\otimes\boldsymbol{B}_r\right\|_F^2=\underset{\{\boldsymbol{A}_r,\boldsymbol{B}_r\}_{r=1}^R}{\arg\min}\left\|\boldsymbol{X}-\sum_{r=1}^R\operatorname{vec}(\boldsymbol{A}_r)\operatorname{vec}(\boldsymbol{B}_r)^\top\right\|_F^2 \tag{2.18}$$

其中，矩阵 $\tilde{\boldsymbol{X}}$ 是由矩阵 $\boldsymbol{X}$ 进行 permute 构造得到。

根据 Eckhart-Young 定理对上述优化问题进行求解，若矩阵 $\tilde{\boldsymbol{X}}$ 的奇异值分解为 $\tilde{\boldsymbol{X}}=\sum_{r=1}^{\min\{mn,pq\}}\sigma_r\boldsymbol{u}_r\boldsymbol{v}_r^\top$，其中，奇异值为 $\sigma_1\geq\sigma_2\geq\cdots\geq\sigma_{\min\{mn,pq\}}$，则矩阵 $\boldsymbol{A}_r$ 和 $\boldsymbol{B}_r$ 的最优解为

$$\begin{cases}\operatorname{vec}(\hat{\boldsymbol{A}}_r)=\sqrt{\sigma_r}\boldsymbol{u}_r\\ \operatorname{vec}(\hat{\boldsymbol{B}}_r)=\sqrt{\sigma_r}\boldsymbol{v}_r\end{cases} \tag{2.19}$$

2.3 模型参数压缩

Kronecker 分解的一个重要用途是压缩模型参数。以多元线性回归 (multivariate linear regression) 为例，给定输入、输出数据为 $\mathcal{D}=\{(\boldsymbol{x}_1,\boldsymbol{y}_1),\cdots,(\boldsymbol{x}_N,\boldsymbol{y}_N)\}\in\mathbb{R}^{nq}\times\mathbb{R}^{mp}$，则多元线性回归的优化问题为

$$\min_{\boldsymbol{W}}\ \frac{1}{2}\sum_{n=1}^N\|\boldsymbol{y}_n-\boldsymbol{W}\boldsymbol{x}_n\|_2^2 \tag{2.20}$$

令

$$\boldsymbol{X}=\begin{bmatrix}| & & |\\ \boldsymbol{x}_1 & \cdots & \boldsymbol{x}_N\\ | & & |\end{bmatrix}\in\mathbb{R}^{nq\times N} \tag{2.21}$$

$$\boldsymbol{Y}=\begin{bmatrix}| & & |\\ \boldsymbol{y}_1 & \cdots & \boldsymbol{y}_N\\ | & & |\end{bmatrix}\in\mathbb{R}^{mp\times N}, \tag{2.22}$$

则此时多元线性回归的等价优化问题为

$$\min_{\boldsymbol{W}}\ \frac{1}{2}\|\boldsymbol{Y}-\boldsymbol{W}\boldsymbol{X}\|_F^2 \tag{2.23}$$

不妨假设这里的系数矩阵 $\boldsymbol{W}\in\mathbb{R}^{(mp)\times(nq)}$ 存在一个广义 Kronecker 分解，且由 R 个成分构成，则基于广义 Kronecker 分解的多元线性回归可写作如下形式：

$$\min_{\{\boldsymbol{A}_r,\boldsymbol{B}_r\}_{r=1}^R}\ \frac{1}{2}\left\|\boldsymbol{Y}-\sum_{r=1}^R(\boldsymbol{A}_r\otimes\boldsymbol{B}_r)\boldsymbol{X}\right\|_F^2 \tag{2.24}$$

将优化问题改写为如下形式即可得到一个标准的广义 Kronecker 分解：

$$\min_{\{\boldsymbol{A}_r,\boldsymbol{B}_r\}_{r=1}^R}\ \frac{1}{2}\left\|\boldsymbol{Y}\boldsymbol{X}^\dagger-\sum_{r=1}^R(\boldsymbol{A}_r\otimes\boldsymbol{B}_r)\right\|_F^2 \tag{2.25}$$

从而可根据广义 Kronecker 分解的求解方法对该多元线性回归问题进行求解。

例 4 (矩阵自回归模型[2]). 对于多维时间序列 *(multidimensional time series)*，若任意时刻 t 对应的观测数据为矩阵 $\boldsymbol{X}_t \in \mathbb{R}^{M\times N}$，则矩阵自回归的表达式为

$$\boldsymbol{X}_t = \boldsymbol{A}\boldsymbol{X}_{t-1}\boldsymbol{B}^\top + \boldsymbol{E}_t, t = 2, 3, \ldots, T \tag{2.26}$$

其中，$\boldsymbol{A} \in \mathbb{R}^{M\times M}$ 与 $\boldsymbol{B} \in \mathbb{R}^{N\times N}$ 为自回归过程的系数矩阵 *(coefficient matrix)*；矩阵 $\boldsymbol{E}_t \in \mathbb{R}^{M\times N}$ 为自回归过程的残差矩阵 *(residual matrix)*。

[2]`http://www.stat.rutgers.edu/home/rongchen/publications/20JoE_Matrix_AR.pdf`

第三章　低秩线性回归

线性回归是机器学习中的一个基本模型，常用于各类回归问题，其建模思路是采用线性方程对给定的变量建立线性关系。本章以线性回归模型为基础，将介绍低秩线性回归模型、低秩自回归模型、时变低秩自回归模型等，这些模型的核心是借助矩阵分解或张量分解对模型参数进行压缩。

3.1　低秩线性回归

3.2　高维向量自回归

3.3　时变低秩向量自回归