# Sprawozdanie nr. 3 - Metody numeryczne i optymailzacja

Jakub Andryszczak 259519, Jakub Żak 244255, Maciej Cierpisz 249163

# Spis treści

1	Zadanie nr. 1	3
2	Zadanie nr. 2	4
3	Zadanie nr. 3	5
4	Zadanie nr. 4	6
5	Zadanie nr. 5	9
6	Zadanie nr. 6	11
7	Zadanie nr. 7	13
8	Wnioski	20

Znajdź "ręcznie" przybliżone rozwiązania w sensie kryterium najmniejszych kwadratów dla poniższych układów równań sprzecznych:

(a) 
$$\begin{cases} 3x_1 - x_2 = 4 \\ x_1 + 2x_2 = 0 \\ 2x_1 + x_2 = 1 \end{cases}$$
 (b) 
$$\begin{cases} 3x_1 + x_2 + x_3 = 6 \\ 2x_1 + 3x_2 - x_3 = 1 \\ 2x_1 - x_2 + x_3 = 0 \\ 3x_1 - 3x_2 + 3x_3 = 8 \end{cases}$$
 (1)

Przykład a:

$$AX = B \tag{2}$$

$$A = \begin{bmatrix} 3 & -1 \\ 1 & 2 \\ 2 & 1 \end{bmatrix} \quad B = \begin{bmatrix} 4 \\ 0 \\ 1 \end{bmatrix} \tag{3}$$

Obliczamy przybliżone wartości wektora X metodą najmniejszych kwadratów:

$$X = (A^T A)^{-1} * (A^T B)$$
 (4)

$$(A^T A)^{-1} = \begin{bmatrix} \frac{6}{83} & -\frac{1}{83} \\ -\frac{1}{83} & \frac{14}{83} \end{bmatrix}$$
 (5)

$$(A^T B) = \begin{bmatrix} 14 \\ -3 \end{bmatrix} \tag{6}$$

$$X = \begin{bmatrix} \frac{6}{83} & -\frac{1}{83} \\ -\frac{1}{83} & \frac{14}{83} \end{bmatrix} * \begin{bmatrix} 14 \\ -3 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \frac{87}{83} \\ -\frac{56}{83} \end{bmatrix}$$
 (7)

Przykład b:

$$AX = B \tag{8}$$

$$A = \begin{bmatrix} 3 & 1 & 1 \\ 2 & 3 & -1 \\ 2 & -1 & 1 \\ 3 & -3 & 3 \end{bmatrix} \quad B = \begin{bmatrix} 6 \\ 1 \\ 0 \\ 8 \end{bmatrix} \tag{9}$$

Obliczamy przybliżone wartości wkektora  ${\bf X}$ metodą najmniejszych kwadratów:

$$X = (A^T A)^{-1} * (A^T B)$$
(10)

$$(A^T A)^{-1} = \begin{bmatrix} \frac{2}{3} & -\frac{5}{6} & -\frac{3}{2} \\ -\frac{5}{6} & \frac{7}{6} & 2 \\ -\frac{3}{2} & 2 & \frac{43}{12} \end{bmatrix}$$
 (11)

$$(A^T B) = \begin{bmatrix} 44 \\ -15 \\ 29 \end{bmatrix} \tag{12}$$

$$X = \begin{bmatrix} \frac{2}{3} & -\frac{5}{6} & -\frac{3}{2} \\ -\frac{5}{6} & \frac{7}{6} & 2 \\ -\frac{3}{2} & 2 & \frac{43}{12} \end{bmatrix} * \begin{bmatrix} 44 \\ -15 \\ 29 \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} -\frac{196}{71} \\ \frac{293}{71} \\ \frac{685}{71} \end{bmatrix}$$
(13)

Znajdź parametry funkcji  $a_0 + a_1 x^2 + a_2 \sin \frac{\pi * x}{2}$ , która aproksymuje poniższy zbiór punktów na płaszczyźnie w sensie kryterium najmniejszych kwadratów: (0,3), (1,0), (1,-1), (-1,2)

Poniżejimplementacja zadania w języku Python:

```
import numpy as np

# Definicja wektorów y i x
y = np.array([3, 0, -1, 2])
x = np.array([0, 1, 1, -1])

# Transpozycja dwóch wektorów
y = y.reshape(-1, 1)
x = x.reshape(-1, 1)

# Tworzenie macierzy A
A = np.hstack((np.ones_like(x), x**2, np.sin(np.pi * x / 2)))

# Obliczenie z1
z1 = np.linalg.inv(A.T @ A) @ A.T @ y

print(z1)
```

Otrzymane wartości współczynników a:

$$\begin{cases}
 a_0 = 3 \\
 a_1 = -2, 25 \\
 a_2 = -1, 25
\end{cases}$$
(14)

## 3 Zadanie nr. 3

Pocisk jest wystrzeliwany z terytorium wroga, a jego położenie w locie jest obserwowane przez radarowe urządzenia śledzące w następujących pozycjach:

$x_i[km]$	0	250	500	750	1000	
y <sub>i</sub> [km]	0	8	15	19	20	

Załóżmy, że nasze źródła wywiadowcze wskazują, że wrogie pociski są zaprogramowane do poruszania się po parabolicznym torze lotu. Oblicz jak daleko od punktu wystrzału spadnie pocisk.

Z założeń wcześniej postawionych możemy wywnioskować że wzór dla danego pocisku będzie prezentować się następująco:

$$y_i = ax_i^2 + bx_i + c (15)$$

Dla podanych wartości wyliczono macierz A:

$$\begin{bmatrix}
0 & 0 & 1 \\
62500 & 250 & 1 \\
250000 & 500 & 1 \\
562500 & 750 & 1 \\
1000000 & 1000 & 1
\end{bmatrix}$$
(16)

Oraz wektor wynikowy:

$$\begin{bmatrix}
0 \\
8 \\
15 \\
19 \\
20
\end{bmatrix}$$
(17)

Następnie wykonano kod w Python, który wyliczał współczynniki aproksymacji z podanych wartości:

```
import numpy as np
# Dane z radarów
xi = np.array([0, 250, 500, 750, 1000])
yi = np.array([0, 8, 15, 19, 20])
```

```
# Tworzenie macierzy A
A = np.vstack([xi**2, xi, np.ones(len(xi))]).T
print(A)
# Rozwiązanie równań normalnych
params = np.linalg.lstsq(A, yi, rcond=None)[0]
# Współczynniki aproksymacji
a, b, c = params
```

Wyniki obliczeń prezentują się następująco

$$a = -1.94286 * 10^{-5}$$

$$b = 0.03982$$

$$c = 0.228571$$
(18)

Kolejno wyżej obliczone wartości podstawiono do wzoru na zasięg:

$$Z = \frac{-b - (b^2 - 4ac)^{\frac{1}{2}}}{2a} = 2044.245[km]$$
 (19)

# 4 Zadanie nr. 4

Używając kryterium najmniejszych kwadratów dopasuj modele (a) i (b) do danych:

X	-5	-4	-3	-2	-1	0	1	2	3	4	5
y	2	7	9	12	13	14	14	13	10	8	4

(a) 
$$y = a_0 + a_1 x, (20)$$

(b) 
$$y = a_0 + a_1 x + a_2 x^2. (21)$$

Określ, który model lepiej dopasowuje się do danych na podstawie normy 2l błędu dopasowania:

Dla obu podpunktów wektor wynikowy wygląda tak samo

$$b = \begin{bmatrix} 2 \\ 7 \\ 9 \\ 12 \\ 13 \\ 14 \\ 14 \\ 13 \\ 10 \\ 8 \\ 4 \end{bmatrix}$$
(22)

Dla podpunktu a) macierz A prezentuje się następująco:

$$A = \begin{bmatrix} -5 & 1 \\ -4 & 1 \\ -3 & 1 \\ -2 & 1 \\ -1 & 1 \\ 0 & 1 \\ 1 & 1 \\ 2 & 1 \\ 3 & 1 \\ 4 & 1 \\ 5 & 1 \end{bmatrix}$$

$$(23)$$

Wykonano kod w Python który oblicza współczynniki oraz wyznacza normę 21 błędu dopasowania:

```
import numpy as np

# Dane
x = np.array([-5, -4, -3, -2, -1, 0, 1, 2, 3, 4, 5])
y = np.array([2, 7, 9, 12, 13, 14, 14, 13, 10, 8, 4])

# Model (a): y = ax + b
A_a = np.vstack([x, np.ones(len(x))]).T
print(A_a)
params_a = np.linalg.lstsq(A_a, y, rcond=None)[0]
a, b = params_a
y_pred_a = np.dot(A_a, params_a)
12_error_a = np.linalg.norm(y - y_pred_a)
```

Współczynniki aproksymacji dla modelu (a):

a: 0.1818181818181818b: 9.636363636363638

Norma L2 błędu dopasowania dla modelu (a): 12.763584563479451

W przypadku podpunktu b) macierz A wynosi:

$$A = \begin{bmatrix} 25 & -5 & 1\\ 16 & -4 & 1\\ 9 & -3 & 1\\ 4 & -2 & 1\\ 1 & -1 & 1\\ 0 & 0 & 1\\ 1 & 1 & 1\\ 4 & 2 & 1\\ 9 & 3 & 1\\ 16 & 4 & 1\\ 25 & 5 & 1 \end{bmatrix}$$

$$(24)$$

Kod do wyliczania współczynników i normy 21:

```
A_b = np.vstack([x**2, x, np.ones(len(x))]).T
print(A_b)
params_b = np.linalg.lstsq(A_b, y, rcond=None)[0]
y_pred_b = np.dot(A_b, params_b)
12_error_b = np.linalg.norm(y - y_pred_b)
print("Współczynniki aproksymacji dla modelu (b):")
print("a:", params_b[0])
print("b:", params_b[1])
print("c:", params_b[2])
print("Norma L2 łębdu dopasowania dla modelu (b):", 12_error_b)
```

Współczynniki aproksymacji dla modelu (b):

a: -0.4335664335664337

b: 0.181818181818166

 $c\colon 13.972027972027968$ 

Norma L2 błędu dopasowania dla modelu (b): 1.2737258819611161

Model (b) lepiej dopasowuje się do danych.

Dopasuj szereg funkcji kosinusowych  $g(x) = \sum_{j=0}^n c_j \cos jx$  do funkcji kwadratowej  $f(x) = \pi^2 - x^2$  w taki sposób, aby minimalizować błąd:  $||f(x) - g(x)||_2$  wprzedziale  $[0, \pi]$  Oceń błąd dla n = 1, 2, 3, ..., 10.

Poniżej implementacja rozwiązania w języku Python:

```
import numpy as np
import matplotlib.pyplot as plt
# Funkcja f(x)
def f(x):
 return np.pi**2 - x**2
# Funkcja g(x)
def g(x, n, c):
 sum = 0
 for j in range(n+1):
   sum += c[j] * np.cos(j*x)
 return sum
# Minimalizacja bledu
def minimize_error(n):
  # Wspolczynniki c
 c = np.zeros(n+1)
  # Macierz A
  A = np.zeros((n+1, n+1))
 for i in range(n+1):
   for j in range(n+1):
     A[i, j] = np.cos(i*j)
  # Wektor b
 b = np.zeros(n+1)
 for i in range(n+1):
   b[i] = f(i*np.pi/n)
  # Rozwiązanie ukladu równań
  c = np.linalg.solve(A, b)
  # Obliczenie bledu
  error = 0
 for i in range(n+1):
   error += (f(i*np.pi/n) - g(i*np.pi/n, n, c))**2
 return error
for n in range(1, 11):
```

```
# Wspolczynniki c
 c = np.zeros(n+1)
 # Macierz A
 A = np.zeros((n+1, n+1))
 for i in range(n+1):
   for j in range(n+1):
     A[i, j] = np.cos(i*j)
 # Wektor b
 b = np.zeros(n+1)
 for i in range(n+1):
   b[i] = f(i*np.pi/n)
 # Rozwiązanie łukadu równań
 c = np.linalg.solve(A, b)
# Bledy
for n in range(1, 11):
 error = minimize_error(n)
 print(f"n={n}, ibad={error}")
```

Wyniki obliczeń błędów dla zadanych wartości n:

```
n=1, błąd=1093.6208242606874

n=2, błąd=50.775736296527654

n=3, błąd=0.3461194363741739

n=4, błąd=168.28383001616405

n=5, błąd=269.63899806641734

n=6, błąd=726.4190934879125

n=7, błąd=422.91932245222927

n=8, błąd=310.09312416292926

n=9, błąd=248.57234583963657

n=10, błąd=215.05265655243966
```

Dla macierzy

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 2 & 3 \\ 4 & 5 & 6 \\ 7 & 8 & 9 \\ 10 & 11 & 12 \\ 13 & 14 & 15 \end{pmatrix}$$

Oraz dokładnego rozwiązania

$$x = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 3 \end{pmatrix}$$

wyznacz wektor danych dla modelu: Ax=b, a następnie:

- (a) dla N = 10, wyznacz błąd rozwiązania  $||x-x_*||$  oraz błąd residualny  $||b-Ax||_2$  w funkcji parametru regularyzacji stosując: (i) standardową regularyzację Tichnowa, (ii) TSVD.
  - (b) oszacuj rank(A) i cond(A) oraz  $A^+$ ,
- $(\mathbf{c})$ wyznacz krzywą L i oszacuj optymalną wartość parametru regularyzacji dla obu metod.

Napisano skrypt:

```
#Obliczenie wskaźnika uwarunkowania macierzy A
cond_A = np.linalg.cond(A)
#Wyznaczenie rzedu macierzy A
Rank_A = round(np.linalg.matrix_rank(A), 0)
x0 = np.dot(pseudo_inv_A, B)
#Obliczenie wartosci bledów
U, S, Vt = np.linalg.svd(A, full_matrices=False)
y1 = np.matmul(U.T, B)
S_inv = np.diag(1/S)
y2 = np. Matmul(S_inv, y1)
x1 = np.matmul(Vt.T, y2)
#Obliczenie wartosci bledu rozwiązania
blad_rozw = np.linalg.norm(x0 {x1, ord=2)
#Obliczenie wartosci bledu residualnego
blad_resi = np.linalg.norm(B {x1.dot(pseudo_inv_A), ord=2)
#Regularyzacja Tichnowa
L = np.linsapce(0.00001, 1, 5)
blad_tich = np. Zeros(5)
X_tich = np.zeros(5)
```

```
For i in range(len(L)):
    x_tich[i] = np.linalg.norm(x1.dot(np.linalg.pinv(A)) - B, ord=2) +
        L[i]
    blad=tich[i] = np.linalg.norm(x1 {x_tich[i]})
```

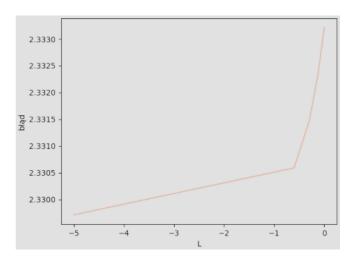
Otrzymano następujące wartości:

Błąd rozwiązania: 1.368774871883577e-15

Błąd residualny: 123.349910

Błąd regularyzacji Tichnowa: 215.385005 Cond(A): 3.5681136352506475e+16

Rank(A): 2 Krzywa L:



## 7 Zadanie nr. 7

Niech c =  $[0\ 1\ ...\ N-1]^T$  należy do  $R^N$  będzie pierwszą kolumną, a r= $[0\ -1\ ...\ -N+1]$  należy do  $R^N$  pierwszym wierszem macierzy Toeplitza. Niech:

- (A)  $\mathbf{x}^* = [1 \ 2 \dots N]^T$  należy do  $\mathbb{R}^N$ ,
- (B) x \* N(0,1) należy do  $R^N$  (rozkład normalny).

Wykonaj projekcję "w przód" obu rozwiązań: Ax\*=b, a następnie:

- (a) dla N = 10, wyznacz błąd rozwiązania  $||x-x_{\ast}||$ oraz błąd residualny
- $||b-Ax||_2$ w funkcji parametru regularyzacji stosując: (i) standardową regularyzację Tichnowa, (ii) TSVD.
  - (b) dla N = 10 przedstaw krzywe L, oddzielnie dla danych (A) i (B).
  - (c) oszacuj rank(A) i cond(A) dla N = 5, 10, 50, 100.
- (d) przedstaw wykres zależności optymalnego parametru regularyzacji w funkcji wymiaru N dla danych (A) i (B),

(e) Uzasadnij dlaczego błąd rozwiązania jest dużo mniejszy dla danych typu (A) niż dla danych (B).

Ponizej kod realizujacy zadanie:

```
import numpy as np
import matplotlib.pyplot as plt
from scipy.linalg import toeplitz
def multiply_matrix_vector(A, x):
   return A.dot(x)
def calculate_errors(x_approx, x_exact, A, b):
   solution_error = np.linalg.norm(x_approx - x_exact)
   residual_error = np.linalg.norm(b - A.dot(x_approx))
   return solution_error, residual_error
def perform_regularizations(A, b, x_exact, lambda_tikhonov, k_tsvd):
   # Tikhonov Regularization
   A_tilde = np.vstack((A, lambda_tikhonov * np.eye(A.shape[1])))
   b_tilde = np.concatenate((b, np.zeros(A.shape[1])))
   x_tikhonov = np.linalg.lstsq(A_tilde, b_tilde, rcond=None)[0]
   # TSVD Regularization
   U, sigma, VT = np.linalg.svd(A, full_matrices=False)
   sigma_truncated = np.zeros_like(sigma)
   sigma_truncated[:k_tsvd] = sigma[:k_tsvd]
   Sigma_truncated = np.diag(sigma_truncated)
   Sigma_truncated_inv = np.diag([1 / s if s > 0 else 0 for s in
       sigma_truncated])
   x_tsvd = VT.T @ Sigma_truncated_inv @ U.T @ b
   # Calculate and store errors
   solution_error, residual_error = calculate_errors(x_tikhonov,
       x_exact, A, b)
   return x_tikhonov, solution_error, residual_error
def estimate_rank_and_condition(A):
   rank_A = np.linalg.matrix_rank(A)
   cond_A = np.linalg.cond(A)
   return rank_A, cond_A
def plot_l_curve(A, b, x_exact, lambda_values, subplot_title):
   norms_solution = []
   norms_residual = []
   for lam in lambda_values:
       _, solution_error, residual_error = perform_regularizations(A,
```

```
b, x_exact, lam, N)
       norms_solution.append(solution_error)
       norms_residual.append(residual_error)
   plt.loglog(norms_residual, norms_solution, label=subplot_title)
   plt.xlabel('Norma resztowa ||Ax-b||')
   plt.ylabel('Norma rozwiązania ||x-x*||')
   plt.grid(True)
def plot_l_curve_tsvd(A, b, x_exact, k_values, dataset_name):
   norms_solution = []
   norms_residual = []
   U, S, Vt = np.linalg.svd(A, full_matrices=False)
   for k in k_values:
       S_truncated = np.zeros_like(S)
       S_truncated[:k] = S[:k]
       Sigma_truncated_inv = np.diag(1 / S_truncated[:k])
       x_tsvd = Vt[:k, :].T @ Sigma_truncated_inv @ U[:, :k].T @ b
       solution_error, residual_error = calculate_errors(x_tsvd,
           x_exact, A, b)
       {\tt norms\_solution.append(solution\_error)}
       norms_residual.append(residual_error)
   plt.loglog(norms_residual, norms_solution, label=f'TSVD for
        {dataset_name}')
   plt.xlabel('Norma resztowa (||Ax - b||)')
   plt.ylabel('Norma rozwiązania (||x-x*||)')
   plt.grid(True)
def plot_optimal_regularization_parameter(N_values):
   optimal_lambda_A = []
   optimal_lambda_B = []
   for N in N_values:
       # Generate Toeplitz matrix A
       c = np.arange(N)
       r = np.concatenate(([c[0]], -c[1:]))
       A = toeplitz(c, r)
       # Generate solutions x* for datasets (A) and (B)
       x_star_a = np.arange(1, N + 1)
       x_star_b = np.random.normal(0, 1, N)
       # Generate forward projections b for datasets (A) and (B)
       b_a = multiply_matrix_vector(A, x_star_a)
       b_b = multiply_matrix_vector(A, x_star_b)
```

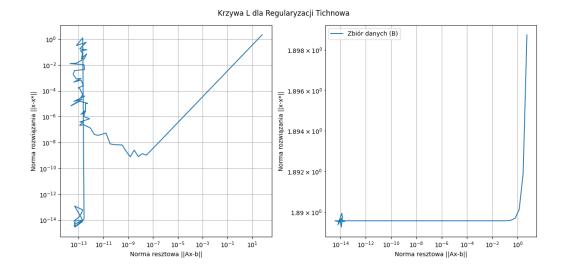
```
# Determine optimal lambda for dataset (A) - Placeholder
       optimal_lambda_A.append(np.argmin(
           [calculate_errors(perform_regularizations(A, b_a, x_star_a,
               lam, N)[0], x_star_a, A, b_a)[1] for lam in
           lambda_values]))
       # Determine optimal lambda for dataset (B) - Placeholder
       optimal_lambda_B.append(np.argmin(
           [calculate_errors(perform_regularizations(A, b_b, x_star_b,
               lam, N)[0], x_star_b, A, b_b)[1] for lam in
           lambda_values]))
   # Plotting the optimal lambda values
   plt.figure(figsize=(10, 6))
   plt.plot(N_values, optimal_lambda_A, 'o-', label='Optymalna śćwarto
       lambda dla zbioru danych (A)')
   plt.plot(N_values, optimal_lambda_B, 's-', label='Optymalna śćwarto
       lambda dla zbioru danych(B)')
   plt.xlabel('śćWielko macierzy N')
   plt.ylabel('Optymalna śćwarto parametru lambda')
   plt.title('Optymalna śćwarto parametru lambda w zależśnoci od
        świelkoci macierzy N')
   plt.legend()
   plt.grid(True)
   plt.tight_layout()
   plt.show()
# Main code section
lambda_values = np.logspace(-15, 1, 100)
N_{values} = [5, 10, 50, 100]
# Estimate and print rank and condition number for Toeplitz matrices of
    different sizes
for N in N_values:
   c = np.arange(N)
   r = np.concatenate(([c[0]], -c[1:]))
   A = toeplitz(c, r)
   rank_A, cond_A = estimate_rank_and_condition(A)
   print(f"N={N}: rank(A)={rank_A}, cond(A)={cond_A:.2e}")
\mbox{\#} Create plots for the L-curve for data set (A) and (B) for N=10
N = 10
c = np.arange(N)
r = np.concatenate(([c[0]], -c[1:]))
A = toeplitz(c, r)
# Generate solutions x* for datasets (A) and (B)
x_star_a = np.arange(1, N + 1)
x_star_b = np.random.normal(0, 1, N)
```

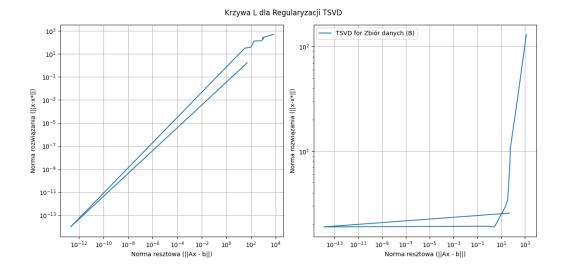
```
# Forward projections b
b_a = multiply_matrix_vector(A, x_star_a)
b_b = multiply_matrix_vector(A, x_star_b)
k_values = range(1, min(A.shape) + 1)
plt.figure(figsize=(12, 6))
# Plot the L-curve for data set (A)
plt.subplot(1, 2, 1)
plot_l_curve(A, b_a, x_star_a, lambda_values, 'Zbiór danych (A)')
# Plot the L-curve for data set (B)
plt.subplot(1, 2, 2)
plot_l_curve(A, b_b, x_star_b, lambda_values, 'Zbiór danych (B)')
plt.suptitle('Krzywa L dla Regularyzacji Tichnowa')
plt.legend()
plt.tight_layout()
plt.show()
plt.figure(figsize=(12, 6))
# Plot the L-curve for data set (A)
plt.subplot(1, 2, 1)
plot_l_curve_tsvd(A, b_a, x_star_a, k_values, 'Zbiór danych (A)')
# Plot the L-curve for data set (B)
plt.subplot(1, 2, 2)
plot_l_curve_tsvd(A, b_b, x_star_b, k_values, 'Zbiór danych (B)')
plt.suptitle('Krzywa L dla Regularyzacji TSVD')
plt.legend()
plt.tight_layout()
plt.show()
\mbox{\tt\#} Plot optimal regularization parameter as a function of N for datasets
    (A) and (B)
plot_optimal_regularization_parameter(N_values)
```

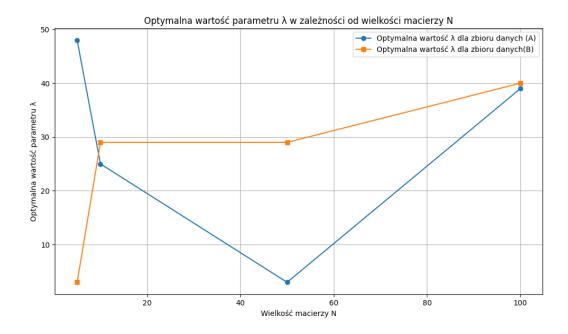
Wyniki obliczeń szacunkowych:

$$\begin{cases} N = 5 : rank(A) = 2, cond(A) = 3.40e17 \\ N = 10 : rank(A) = 2, cond(A) = 2.03e18 \\ N = 50 : rank(A) = 2, cond(A) = 6.36e19 \\ N = 100 : rank(A) = 2, cond(A) = 6.49e20 \end{cases}$$

$$(25)$$







# 8 Wnioski

Bląd rozwiązania dla danych typu A jest duzo mniejszy ze wzgledu na wykorzystanie w zbiorze B liczb z zakresu rozkładu normalnego.