

Aufgabe 14: a) Zeigen Sie, dass das lineare Gleichungssystem $Ax = b$ mit

$$A = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 2 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}$$
$$b = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}$$

nicht lösbar ist.

b) Lösen Sie deshalb das Approximationsproblem

$$\|Ax - b\|^2 \rightarrow \min!$$

mit Hilfe der QR-Zerlegung von A .

LÖSUNG:

a) Aus der ersten Zeile ergibt sich sofort $x_1 = 1$, aus der dritten Zeile $x_2 = 1$.
Damit steht in der zweiten Zeile $2 + 1 = 1$, was offensichtlich falsch.

b) Wir berechnen die QR-Zerlegung von A . Setzen wir dazu

$$u_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 0 \end{pmatrix},$$
$$\|u_1\| = \sqrt{5},$$
$$\alpha_1 = -\text{sign}(u_{11})\|u_1\| = -\sqrt{5}$$
$$n_1 = u_1 - \begin{pmatrix} \alpha_1 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 + \sqrt{5} \\ 2 \\ 0 \end{pmatrix}.$$
$$Q^{(1)} = \mathbb{1} - 2 \frac{n_1 n_1^T}{\|n_1\|^2} = \mathbb{1} - \frac{1}{5 + \sqrt{5}} n_1 n_1^T$$
$$= \begin{pmatrix} -\frac{1}{\sqrt{5}} & -\frac{2}{\sqrt{5}} & 0 \\ -\frac{2}{\sqrt{5}} & \frac{1}{\sqrt{5}} & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}$$

Nun wenden wir die Matrix $Q^{(1)T} = Q^{(1)}$ auf die Spalten der Matrix A an.

$$\begin{aligned} Q^{(1)} \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 0 \end{pmatrix} &= \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 0 \end{pmatrix} - \frac{1}{5 + \sqrt{5}} \begin{pmatrix} 1 + \sqrt{5} \\ 2 \\ 0 \end{pmatrix} (5 + \sqrt{5}) \\ &= \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 0 \end{pmatrix} - \begin{pmatrix} 1 + \sqrt{5} \\ 2 \\ 0 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} -\sqrt{5} \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} Q^{(1)} \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix} &= \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix} - \frac{1}{5 + \sqrt{5}} \begin{pmatrix} 1 + \sqrt{5} \\ 2 \\ 0 \end{pmatrix} 2 \\ &= \begin{pmatrix} -\frac{2}{\sqrt{5}} \\ \frac{1}{\sqrt{5}} \\ 1 \end{pmatrix} \end{aligned}$$

Daraus ergibt sich

$$\begin{aligned} R = Q^{(1)T} A &= \begin{pmatrix} -\sqrt{5} & -\frac{2}{\sqrt{5}} \\ 0 & \frac{1}{\sqrt{5}} \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \\ b_1 = Q^{(1)T} b &= \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix} - \frac{3 + \sqrt{5}}{5 + \sqrt{5}} \begin{pmatrix} 1 + \sqrt{5} \\ 2 \\ 0 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -\frac{3}{\sqrt{5}} \\ -\frac{1}{\sqrt{5}} \\ 1 \end{pmatrix} \end{aligned}$$

Die zu lösende Gleichung hat also nun die Form

$$\begin{pmatrix} -\sqrt{5} & -\frac{2}{\sqrt{5}} \\ 0 & \frac{1}{\sqrt{5}} \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -\frac{3}{\sqrt{5}} \\ -\frac{1}{\sqrt{5}} \\ 1 \end{pmatrix}.$$

Bemerkung: Wir merken daran, dass die beiden letzte Zeilen sowohl $x_2 = -1$ als auch $x_2 = 1$ liefern. Das ist unmöglich, daran sieht man ebenfalls, dass das Gleichungssystem nicht lösbar ist.

Im zweiten Schritt setzen wir

$$v_2 = \begin{pmatrix} \frac{1}{\sqrt{5}} \\ 1 \end{pmatrix},$$

und ergänzen mit 0 in der ersten Zeile, um den Vektor $u_2 \in \mathbb{R}^3$ zu bekommen.

$$\begin{aligned}
 u_2 &= \begin{pmatrix} 0 \\ \frac{1}{\sqrt{5}} \\ 1 \end{pmatrix}, \\
 \|u_2\| &= \frac{\sqrt{6}}{\sqrt{5}}, \\
 \alpha_2 &= -\text{sign}(u_{22})\|u_2\| = -\frac{\sqrt{6}}{\sqrt{5}} \\
 n_2 &= u_2 - \begin{pmatrix} 0 \\ \alpha_2 \\ 0 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ \frac{1+\sqrt{6}}{\sqrt{5}} \\ 1 \end{pmatrix} \\
 Q^{(2)} &= \mathbb{1} - 2\frac{n_2 n_2^T}{\|n_2\|^2} = \mathbb{1} - \frac{5}{6 + \sqrt{6}} n_2 n_2^T \\
 &= \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & -\frac{1}{\sqrt{6}} & -\frac{\sqrt{5}}{\sqrt{6}} \\ 0 & -\frac{\sqrt{5}}{\sqrt{6}} & \frac{1}{\sqrt{6}} \end{pmatrix}
 \end{aligned}$$

Um $R = Q^{(2)T} Q^{(1)T} A = Q^{(2)} Q^{(1)} A$ zu berechnen, wenden wir $Q^{(2)}$ auf die Spalten der Matrix $Q^{(1)} A$ an.

$$Q^{(2)} \begin{pmatrix} -\sqrt{5} \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -\sqrt{5} \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix},$$

da $\begin{pmatrix} -\sqrt{5} \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}$ senkrecht auf dem Vector n_2 steht.

$$\begin{aligned}
 Q^{(2)} \begin{pmatrix} -\frac{2}{\sqrt{5}} \\ \frac{1}{\sqrt{5}} \\ 1 \end{pmatrix} &= \begin{pmatrix} -\frac{2}{\sqrt{5}} \\ \frac{1}{\sqrt{5}} \\ 1 \end{pmatrix} - \frac{5}{6 + \sqrt{6}} \begin{pmatrix} 0 \\ \frac{1+\sqrt{6}}{\sqrt{5}} \\ 1 \end{pmatrix} \frac{6 + \sqrt{6}}{5} \\
 &= \begin{pmatrix} -\frac{2}{\sqrt{5}} \\ \frac{1}{\sqrt{5}} \\ 1 \end{pmatrix} - \begin{pmatrix} 0 \\ \frac{1+\sqrt{6}}{\sqrt{5}} \\ 1 \end{pmatrix} \\
 &= \begin{pmatrix} -\frac{2}{\sqrt{5}} \\ -\frac{\sqrt{6}}{\sqrt{5}} \\ 0 \end{pmatrix}
 \end{aligned}$$

Daraus ergibt sich

$$R = Q^{(2)}Q^{(1)}A = \begin{pmatrix} -\sqrt{5} & -\frac{2}{\sqrt{5}} \\ 0 & -\frac{\sqrt{6}}{\sqrt{5}} \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$$

$$b_2 = Q^{(2)T}b_1 = Q^{(2)}b_1 = \begin{pmatrix} -\frac{3}{\sqrt{5}} \\ -\frac{1}{\sqrt{5}} \\ 1 \end{pmatrix} - \frac{5}{6 + \sqrt{6}} \begin{pmatrix} 0 \\ \frac{1+\sqrt{6}}{\sqrt{5}} \\ 1 \end{pmatrix} \frac{4 - \sqrt{6}}{5}$$

$$= \begin{pmatrix} -\frac{3}{\sqrt{5}} \\ -\frac{1}{\sqrt{5}} \\ 1 \end{pmatrix} - \frac{4 - \sqrt{6}}{6 + \sqrt{6}} \begin{pmatrix} 0 \\ \frac{1+\sqrt{6}}{\sqrt{5}} \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -\frac{3}{\sqrt{5}} \\ -\frac{4}{\sqrt{30}} \\ \frac{2}{\sqrt{6}} \end{pmatrix}$$

$$A = QR,$$

$$Q = Q^{(1)}Q^{(2)}$$

$$\Rightarrow \begin{cases} -\sqrt{5}x_1 - \frac{2}{\sqrt{5}}x_2 & = & -\frac{3}{\sqrt{5}} \\ & -\frac{\sqrt{6}}{\sqrt{5}}x_2 & = & -\frac{4}{\sqrt{30}} \end{cases}$$

$$\Leftrightarrow \begin{cases} x_1 & = & \frac{3}{5} - \frac{2}{5}x_2 = \frac{1}{3} \\ x_2 & = & \frac{2}{3} \end{cases}$$

Die Lösung unseres Minimierungsproblems ist also $(x_1, x_2) = (\frac{1}{3}, \frac{2}{3})$.

Aufgabe 15: a) Erweitern Sie die Funktion *QRSolve* vom letzten Übungsblatt zu einer Funktion, die lineare Ausgleichsprobleme für nichtquadratische Matrizen A lösen kann.

b) Testen Sie diese Funktion anhand des Beispiels

$$\|Ax - b\|^2 \rightarrow \min$$

$$\text{mit } A = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 2 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \text{ und } b = \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}.$$

LÖSUNG:

- a) Zuerst müssen wir in *QRDecomposition* ein paar kleine Änderungen vornehmen. Zum einen laufen die Schleifen in der Funktion *ApplyQ*, sowie die erste innere Schleife im Hauptprogramm bis m und nicht nur bis n und zum andern muss die äußere for-Schleife im Hauptprogramm bis n und nicht nur $n - 1$ laufen.

```
function [A,alpha] = QRDecompositionNonSymmetric( A )
% QR - decomposition
% argument "A" is the matrix we want to decompose

% sign, being either +1 or -1, but not 0
```

```

function sig = pmsign (val)
    if (val < 0)
        sig = -1;
    else
        sig = +1;
    end
end

% auxiliary function: apply Q
function x = ApplyQ( k, alpha, v, x )
    s = 0;
    m = size(v);
    for l = k:m
        s = s + v(l)*x(l);
    end
    s = s / (alpha*v(k));
    for l=k:m
        x(l) = x(l) + s*v(l);
    end
end

% main program
% get the length of the vector
[m,n] = size( A );

for k = 1:n
    norm = 0;
    for i =k:m
        norm = norm + A(i,k)*A(i,k);
    end
    norm = sqrt(norm);
    alpha(k) = -pmsign(A(k,k)) * norm;
    A(k,k) = A(k,k) - alpha(k);
    for j = k+1:n
        A(:,j) = ApplyQ( k, alpha(k), A(:,k), A(:,j) );
    end
end

end

```

In *QRSolve* muss man folgende Änderungen vornehmen: Die beiden for-Schleifen in der Funktion *ApplyQ* laufen bis m und nicht nur bis n , bei der Berechnung von $Q^T b$ läuft die Schleife bis n und nicht nur $n - 1$ und beim Rückwärts-Einsetzen beginnt die for-Schleife bei n und nicht bei m .

```
function x = QRSolveNonSymmetric( A, b)
```

```

% solves the system Ax=b by using QR decomposition

[m,n]=size(A);

% auxiliary function: apply Q
function x = ApplyQ( k, alpha, v, x )
    s = 0;
    m = size(v);
    for l = k:m
        s = s + v(l)*x(l);
    end
    s = s / (alpha*v(k));
    for l=k:m
        x(l) = x(l) + s*v(l);
    end
end

% QR decomposition
[A,alpha]=QRDecompositionNonSymmetric(A);

% we have to solve the system Rx=Q^Tb, thus we have to compute Q^Tb
for i = 1:n
    b = ApplyQ(i, alpha(i), A(:,i), b);
end

% now we solve the system Rx=Q^Tb
for k = n:-1:1
    s = b(k);
    for j = k+1:n
        s = s - A(k,j)*x(j);
    end
    x(k) = s/alpha(k);
end

end

```

Aufgabe 16: Betrachten Sie den Vektorraum

$$V = \{f : [0, \pi] \rightarrow \mathbb{R} \mid f(x) = c_1 \sin(x) + c_2 \sin(2x) + c_3 \sin(3x) \text{ mit } c_1, c_2, c_3 \in \mathbb{R}\}.$$

Die Funktionen

$$v_1(x) = \sin(x)$$

$$v_2(x) = \sin(2x)$$

$$v_3(x) = \sin(3x)$$

bilden offenbar eine Basis des Vektorraums V .

a) Zeigen Sie, dass v_1 , v_2 und v_3 bezüglich des Skalarproduktes

$$g(v, w) = \int_0^\pi v(x)w(x) dx$$

orthogonal sind.

b) Bestimmen Sie eine Orthonormalbasis (ONB) dieses Vektorraums.

c) Berechne Sie die orthogonale Projektion der Funktion

$$f(x) = \begin{cases} x & : x < \frac{\pi}{2} \\ \pi - x & : x \geq \frac{\pi}{2} \end{cases}$$

auf den Vektorraum V bezüglich $g(\cdot, \cdot)$.

Tipp: Zeigen Sie zunächst

$$\sin(ax) \sin(bx) = \frac{1}{2} (\cos((a-b)x) - \cos((a+b)x)).$$

LÖSUNG: Zuerst beweisen wir die im Tipp aufgestellte Behauptung:

Sei $a, b \in \mathbb{N}$ mit $a \neq b$

$$\sin(ax) = \frac{1}{2i} (e^{iax} - e^{-iax})$$

$$\sin(bx) = \frac{1}{2i} (e^{ibx} - e^{-ibx})$$

$$\begin{aligned} \implies \sin(ax) \sin(bx) &= -\frac{1}{2} \left[\frac{(e^{i(a+b)x} + e^{-i(a+b)x})}{2} - \frac{(e^{i(a-b)x} + e^{-i(a-b)x})}{2} \right], \\ &= \frac{1}{2} (\cos((a-b)x) - \cos((a+b)x)) \end{aligned}$$

a)

$$\begin{aligned} g(\sin(ax), \sin(bx)) &= \int_0^\pi \sin(ax) \sin(bx) dx = \int_0^\pi \frac{1}{2} (\cos((a-b)x) - \cos((a+b)x)) dx \\ &= \frac{1}{2(a-b)} [\sin((a-b)x)]_0^\pi - \frac{1}{2(a+b)} [\sin((a+b)x)]_0^\pi = 0. \end{aligned}$$

weil $a - b \neq 0$ und $a + b \neq 0$. Daraus folgt, dass die Funktionen v_1, v_2 und v_3 bzgl. des Skalarproduktes $g(\cdot, \cdot)$ orthogonal sind.

b) Da v_1, v_2, v_3 linear unabhängig sind, bilden sie also eine orthogonale Basis und wir müssen nur noch normieren:

Die normierte Basis, nennen wir sie w_1, w_2, w_3 , erhalten wir wie folgt:

$$\begin{aligned} w_1 &= \frac{1}{\sqrt{g(\sin(x), \sin(x))}} \sin(x) \\ w_2 &= \frac{1}{\sqrt{g(\sin(2x), \sin(2x))}} \sin(2x) \\ w_3 &= \frac{1}{\sqrt{g(\sin(3x), \sin(3x))}} \sin(3x) \end{aligned}$$

Sei $a \in \mathbb{N}$,

$$\begin{aligned} g(\sin(ax), \sin(ax)) &= \int_0^\pi \sin(ax) \sin(ax) dx = \int_0^\pi \frac{1}{2} (1 - \cos((2a)x)) dx \\ &= \frac{1}{2} [x]_0^\pi - \frac{1}{2a} [\sin(2ax)]_0^\pi = \frac{\pi}{2}. \end{aligned}$$

und dann

$$\begin{aligned} w_1 &= \sqrt{\frac{2}{\pi}} \sin(x) \\ w_2 &= \sqrt{\frac{2}{\pi}} \sin(2x) \\ w_3 &= \sqrt{\frac{2}{\pi}} \sin(3x) \end{aligned}$$

Bemerkung: Wenn die Basis nicht bereits orthogonal wäre, könnten wir das Gram-Schmidt-Verfahren benutzen. Dieses funktioniert mit dem Skalarprodukt $g(\cdot, \cdot)$ analog zum Vorgehen im \mathbb{R}^3 .

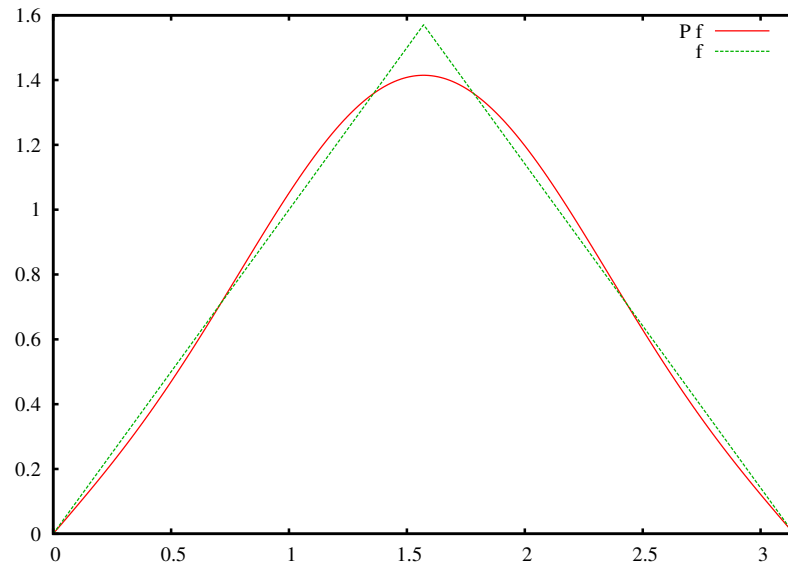
c) Die orthogonale Projektion der Funktion $f(x)$ auf den Vektorraum V bzgl. des Skalarproduktes $g(\cdot, \cdot)$ berechnet sich wie folgt

$$Pf(x) = g(f(x), w_1(x))w_1(x) + g(f(x), w_2(x))w_2(x) + g(f(x), w_3(x))w_3(x)$$

$$\begin{aligned}
g(f(x), w_1(x)) &= \int_0^\pi f(x)w_1(x) \, dx \\
&= 2 \int_0^{\frac{\pi}{2}} x \sqrt{\frac{2}{\pi}} \sin(x) \, dx \\
&= 2 \sqrt{\frac{2}{\pi}} \int_0^{\frac{\pi}{2}} x \sin(x) \, dx \\
&= 2 \sqrt{\frac{2}{\pi}} \left(-x \cos(x) \Big|_0^{\frac{\pi}{2}} + \int_0^{\frac{\pi}{2}} \cos(x) \, dx \right) \\
&= 2 \sqrt{\frac{2}{\pi}} \sin(x) \Big|_0^{\frac{\pi}{2}} \\
&= 2 \sqrt{\frac{2}{\pi}} \\
g(f(x), w_2(x)) &= \int_0^\pi f(x)w_2(x) \, dx \\
&= \int_0^{\frac{\pi}{2}} x \sqrt{\frac{2}{\pi}} \sin(2x) \, dx + \int_{\frac{\pi}{2}}^\pi (\pi - x) \sqrt{\frac{2}{\pi}} \sin(2x) \, dx \\
&= \int_0^{\frac{\pi}{2}} x \sqrt{\frac{2}{\pi}} \sin(2x) \, dx + \int_0^{\frac{\pi}{2}} x \left(-\sqrt{\frac{2}{\pi}} \sin(2x) \right) \, dx \\
&= 0 \\
g(f(x), w_3(x)) &= \int_0^\pi f(x)w_3(x) \, dx \\
&= 2 \sqrt{\frac{2}{\pi}} \int_0^{\frac{\pi}{2}} x \sin(3x) \, dx \\
&= 2 \sqrt{\frac{2}{\pi}} \left(-\frac{1}{3} x \cos(3x) \Big|_0^{\frac{\pi}{2}} + \frac{1}{3} \int_0^{\frac{\pi}{2}} \cos(3x) \, dx \right) \\
&= \frac{2}{9} \sqrt{\frac{2}{\pi}} \sin(3x) \Big|_0^{\frac{\pi}{2}} \\
&= -\frac{2}{9} \sqrt{\frac{2}{\pi}}
\end{aligned}$$

Daraus folgt

$$\begin{aligned}
Pf(x) &= 2 \sqrt{\frac{2}{\pi}} w_1(x) - \frac{2}{9} \sqrt{\frac{2}{\pi}} w_3(x) \\
&= \frac{4}{\pi} \sin(x) - \frac{4}{9\pi} \sin(3x)
\end{aligned}$$



Aufgabe 17: Thema: Orthonormalsystem und orthogonale Projektion

Sei V ein Vektorraum mit Skalarprodukt und $U = \text{span}\{u_1, \dots, u_n\}$ ein Unterraum, wobei $\{u_1, \dots, u_n\}$ ein Orthonormalsystem sei. Welche Aussagen sind richtig?

- a) Wenn $v \in V$ und $v \cdot u_i = 0$ für $i = 1, \dots, n$, dann ist $v = 0$.
ja nein
- b) Die orthogonale Projektion $Pv \in U$ eines Vektors $v \in V$ ist eindeutig bestimmt und es gilt: $Pv = \sum_{i=1}^n (v \cdot u_i) u_i$.
ja nein
- c) Für $v, w \in V$ gilt: $Pv \cdot Pw = \sum_{i=1}^n (v \cdot u_i)(w \cdot u_i)$.
ja nein
- d) Wenn $v \in V$, dann gilt: $\|v\|^2 = \sum_{i=1}^n (v \cdot u_i)^2$.
ja nein
- e) Wenn $v \in U$, dann gilt: $\|v\|^2 = \sum_{i=1}^n (v \cdot u_i)^2$.
ja nein

LÖSUNG: Die Antworten lauten: a) Nein! Bsp. $v = e_3$, $u_1 = e_1$, $u_2 = e_2$, $U = \text{span}\{u_1, u_2\}$ b) Ja! c) Ja! Ausmultiplizieren $u_i \cdot u_j = 0$. d) Nein! Siehe a) e) Ja! Wegen c) $v = w = u$, dann $Pv = Pw = u$.

Aufgabe 18: Thema: Normalgleichungssystem

Sei A eine $m \times n$ Matrix. Betrachten Sie das Normalgleichungssystem

$$A^T Ax = A^T b$$

für $b \in \mathbb{R}^m$. Welche Aussagen sind richtig?

- a) Für $b = 0$ hat das System stets nur die triviale Lösung.
ja nein
- b) Ax ist eindeutig bestimmt, auch wenn es mehrere Lösungen $x \in \mathbb{R}^n$ gibt.
ja nein
- c) Gilt Rang von A gleich n , dann ist $A^T A$ positiv definit.
ja nein
- d) Ist A eine symmetrische $n \times n$ Matrix, dann ist jede Lösung des Systems auch Lösung von $Ax = b$.
ja nein

LÖSUNG: Die Antworten lauten:

a) Nein! Bsp. $A = 0$.

b) Ja! Seien x_1 und x_2 Lösungen der Gleichung $A^T Ax = A^T b$. Dann folgt daraus

$$\begin{aligned} \Rightarrow & A^T A(x_1 - x_2) = 0 \\ \Rightarrow & (x_1 - x_2)A^T A(x_1 - x_2) = 0 \\ \Leftrightarrow & \|A(x_1 - x_2)\|^2 = 0 \\ \Leftrightarrow & A(x_1 - x_2) = 0 \\ \Leftrightarrow & Ax_1 = Ax_2 \end{aligned}$$

c) Ja! Rang von A gleich n , daraus folgt:

$$Ax = 0 \Leftrightarrow x = 0.$$

$$\Rightarrow A^T Ax \cdot x = \|Ax\|^2 \neq 0 \quad \text{für } x \neq 0$$

Zudem wissen wir, dass die Matrix $A^T A$ positiv semidefinit ist und somit ist $A^T A$ positiv definit.

d) Nein! Beispiel: A sei die Nullmatrix.