

Nelinearna metoda najmanjših kvadratov

Recimo, da imamo funkcijo $F: U \subseteq \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^m$, kjer je $m > n$, in rešujemo sistem

$$F(\mathbf{x}) = \mathbf{0}.$$

Ker ima ta sistem več enačb kot neznanek, v splošnem nima rešitev. Zato se (podobno kot pri linearnih sistemih) vprašamo, kaj je najboljši približek rešitve, tj. iščemo tisti $\mathbf{x} \in U$, za katerega je vrednost $\|F(\mathbf{x})\|^2$ minimalna. Do rešitve nas pripelje *Gauss–Newtonova* iteracija s korakom oblike

$$\mathbf{x}^{(k+1)} = \mathbf{x}^{(k)} - (JF(\mathbf{x}^{(k)}))^+ F(\mathbf{x}^{(k)}).$$

(Namesto prave rešitve \mathbf{z} sistema $(JF(\mathbf{x}^{(k)}))\mathbf{z} = F(\mathbf{x}^{(k)})$ iz enega koraka običajne Newtonove metode poiščemo rešitev tega sistema v smislu *linearne metode najmanjših kvadratov*. Tisti $(JF)^+$ je zgoraj napisan le zato, da formula izgleda krajša. V resnici metoda ‘deluje’ le za predoločene sisteme polnega ranga, za te pa pravzaprav ne potrebujemo Moore–Penroseovega posplošenega inverza.) Bolj natančno: ta postopek nam da en *lokalni* minimum funkcije $\mathbf{x} \mapsto \|F(\mathbf{x})\|^2$.

1. Podatke v tabeli (te podatke dobiš tudi na spletni učilnici)

x_i	0.038	0.194	0.425	0.626	1.253	2.500	3.740
y_i	0.050	0.127	0.094	0.2122	0.2729	0.2665	0.3317

želimo modelirati s funkcijo oblike

$$f(x) = \frac{ax}{b+x}.$$

Parametra a in b bomo poiskali po metodi najmanjših kvadratov.

- (a) Poišči rešitev z uporabo Newtonove metode. (Kako? Odvajaj zgornji izraz in poišči ‘ničlo odvoda’.)
- (b) Poišči rešitev z uporabo Gauss–Newtonove metode.

2. Z Gauss–Newtonovo iteracijo bomo rešili nalogo iz 1. tedna vaj. V ravnini \mathbb{R}^2 imamo na znanih položajih $(p_1, q_1), \dots, (p_n, q_n)$ postavljenih n oddajnikov. Določiti želimo položaj (x, y) sprejemnika. Sprejemnik lahko zazna le jakost signala posameznih oddajnikov in na podlagi tega določi razdalje d_1, \dots, d_n do teh oddajnikov. V idealiziranem primeru, ko so naši podatki točni, imamo za vsak $i = 1, \dots, n$ enačbo

$$(x - p_i)^2 + (y - q_i)^2 = d_i^2.$$

Rešitev sistema teh enačb za $i = 1, \dots, n$ pa nam da položaj sprejemnika (x, y) .

Popravi funkcijo $X = \text{sprejemnik}([p_i, q_i], [d_i])$ iz 1. tedna, ki za nabor položajev oddajnikov (p_i, q_i) in razdalj d_i poišče položaj sprejemnika $X(x, y)$. Začetni približek $\mathbf{x}^{(0)}$ je lahko kar tisto, kar nam je vrnila linearna metoda najmanjših kvadratov.