

同ランク半正定値行列の平均について

Means for fixed rank PSD matrices

藤井 淳一 (大阪教育大学)

Jun Ichi Fujii (Osaka Kyoiku Univ.)

1 Introduction.

よく知られているように、可逆性作用素、特に正定値行列の場合、リーマン (フィンラー) 幾何学の測地線として久保-安藤平均 [18] の意味での幾何平均の path

$$A\#_t B = A^{\frac{1}{2}} \left(A^{-\frac{1}{2}} B A^{-\frac{1}{2}} \right)^t A^{\frac{1}{2}}$$

および、相対作用素エントロピー [10]

$$S(A|B) = A^{\frac{1}{2}} \log \left(A^{-\frac{1}{2}} B A^{-\frac{1}{2}} \right) A^{\frac{1}{2}}$$

がその初期速度ベクトルとして位置づけられた [13, 14, 11, 7, 4, 17]。半正定値の一般平均 m の場合には、久保-安藤平均では、その単調性と上反連続性から、

$$A m B = \text{s-lim}_{\varepsilon \searrow 0} (A + \varepsilon) m (B + \varepsilon)$$

とするのが常であった。しかしこれはもはや純粋な多様体の幾何学の範疇からは逸脱し、特に多変数化において様々な支障をきたすことは、[17] で示した。特に、相対作用素エントロピーは、発散することのないように条件付けが必要になってくる。「可逆性」は通常の幾何学的な考察において重要なファクターなのである。

しかし、ある偶然から幾何学的に半正定値な行列の幾何平均の話を Bonnabel-Sepulchre [6] が導入していることを知った。これは、同ランクに限って、Grassman 多様体の測地線で「正定値に変換して」平均を導入するものであった。関連で調べているうちに、同ランクの射影について Batzies-Hüper-Machado-Leite [5] も幾何平均の path を、明示的に表現していることを知った。当人同士は知らないようだが、実は前者の射影版が後者になっていることがわかった。さらに、この方法で、一般の久保-安藤平均 m を、 \tilde{m} に広げられることもわかった。[6] で指摘されているように (彼らは幾何平均限定)、正定値の場合には久保-安藤平均と一致するが、半正定値の時は一般には二者は異なり、しかも、相対作用素エントロピーは常に存在することになる。ここでは、この modify された平均 \tilde{m} について論じたいと思う。ただし話を単純にするため実行列に話を限るが、複素化はそれほど難しくない (無限次元化は多少の注意を有する) と思われるので、容易に拡張できる形で述べたい。

2 幾何学的背景

まず $p \leq n$ についての、Stiefel 多様体 $\mathcal{V}_{n,p}$ に注目する：

$$\mathcal{V}_{n,p} = \{V : n \times p \mid V^*V = I_p\} = \mathcal{O}(n)/\mathcal{O}(n-p).$$

[8] のように、 $\mathcal{O}(n-p)$ を $\mathcal{O}(n)$ の中に $I_p \oplus \mathcal{O}(n-p)$ として埋め込むと、商空間の定義とつながる：

$$\left\{ Q \begin{pmatrix} I_p & O \\ O & Q_{n-p} \end{pmatrix} \middle| \begin{array}{l} Q \in \mathcal{O}(n) \\ Q_{n-p} \in \mathcal{O}(n-p) \end{array} \right\} = \begin{pmatrix} Q_1 & * \\ Q_2 & * \end{pmatrix} \cong \left\{ V = \begin{pmatrix} Q_1 \\ Q_2 \end{pmatrix} : n \times p \mid V^*V = I_p \right\}.$$

ただし行列のブロック分解は $Q = \begin{pmatrix} Q_1 & Q_3 \\ Q_2 & Q_4 \end{pmatrix}$ とする。つまり、 I_n のファイバーは、 $I_p \oplus \mathcal{O}(n-p)$ と同型である。直交群 $\mathcal{O}(n)$ の Lie 環は skew-hermitian 全体 $\mathfrak{so}(n)$ で、これも I での接空間である。ファイバー部分の接空間を垂直空間 $O \oplus \mathfrak{so}(n-p)$ として幾何学的な「接続」が考えられるので、接ベクトル $\Delta \in \mathfrak{so}(n)$ は水平空間に属し、 Δ は

$$\Delta = \begin{pmatrix} A & -B^* \\ B & C \end{pmatrix} - \begin{pmatrix} O & O \\ O & C \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} A & -B^* \\ B & O \end{pmatrix}$$

($A \in \mathfrak{so}(p)$, $C \in \mathfrak{so}(n-p)$) とみなせる。したがって、 $\mathcal{V}_{n,p}$ の初期接ベクトル Δ 、初期値 Y の測地線は、微分方程式 $\dot{Y} = -Y\dot{Y}^*Y$ and $Y(t)^*Y(t) = I_p$ を満たすものであるが、

$$Y(t) = (Y, I_{n,n-p})e^{t\Delta} \begin{pmatrix} I_p \\ O \end{pmatrix}$$

とあらわせる。ただし、 $I_{n,n-p} = \begin{pmatrix} I_{n-p} \\ O \end{pmatrix}$ である, [8].

Stiefel 多様体は等質空間で一般には対称空間ではない。そこで、さらに Riemann 対称空間になる Grassmann 多様体

$$\mathcal{G}_{n,p} = \mathcal{V}_{n,p}/\mathcal{O}(p) \cong \mathcal{O}(n)/\mathcal{O}(p) \times \mathcal{O}(n-p)$$

が様々に研究されている。定義としても、様々な手法があり、上記以外にも、部分空間として、したがって射影の空間として、もしくは symmetries の空間としての位置づけもある。[19, 20, 21, 3, 1, 2]。無限次元化するには後者の方が都合がいいが、ここでは触れない。

Stiefel 多様体と比較すると、 $\mathcal{O}(p) \times \mathcal{O}(n-p)$ を $\mathcal{O}(n)$ に、 $\mathcal{O}(p) \oplus \mathcal{O}(n-p)$ として埋め込んでやると、ファイバーに接する垂直空間は $\mathfrak{so}(p) \oplus \mathfrak{so}(n-p)$ となって、水平な接ベクトルは

$$\Delta = \begin{pmatrix} A & -B^* \\ B & C \end{pmatrix} - \begin{pmatrix} A & O \\ O & C \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} O & -B^* \\ B & O \end{pmatrix}$$

と考えられる。

すると、 $U_1, U_2 \in \mathcal{G}_{n,p}$ の測地線の一つの表現は、

$$Y(t) = (Y, I_{n,n-p}) e^{t \begin{pmatrix} O & -B^* \\ B & O \end{pmatrix}} \begin{pmatrix} I_p \\ O \end{pmatrix}$$

となるが、このように初期値と初期接ベクトルによる表現でなく、両端を決めて path にしたい。そこで、 $\Sigma = \Sigma^*$ に対する **CS-decomposition**

$$\exp \begin{pmatrix} O & -\Sigma \\ \Sigma & O \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \cos \Sigma & -\sin \Sigma \\ \sin \Sigma & \cos \Sigma \end{pmatrix}$$

によって、角度の行列を導入し、測地線の速度を調整して ($t = 1$ で終点になるよう) 正規化すれば、 $U_1^* U_2 = \text{diag}(\sigma_j) = \cos \Theta$ ($0 \leq \Theta \leq I$) となるとき、

$$\begin{aligned} U(t) &= U_1 \cos t\Theta + (1 - U_1 U_1^*) U_2 \sin^\dagger \Theta \sin t\Theta \\ &= U_1 \cos t\Theta + (U_2 - U_1 \cos \Theta) \sin^\dagger \Theta \sin t\Theta \end{aligned}$$

で与えられる [6]。ただし、 \dagger は、**Moore-Penrose 一般化逆行列**である。

3 同ランク PSD 行列の平均 — BS 平均—

ここで、久保-安藤平均 m 若しくは、その path m_t を考える ($t \in [0, 1]$)。通常対称的な path を考えるので、 $A m_{1-t} B = B m_t A$ を仮定し、 $m = m_{\frac{1}{2}}$ は、対称平均とすることが多い。

同ランクの半正定値行列 A, B の時は、 A の 0 以外の p 個の固有値の単位固有ベクトルで、 V_A を作って $V_A^* A V_A$ で対角化し、 B でも同様に考えて、 $V_A^* V_B$ の特値値は $[0, 1]$ に収まるので、特異値 σ_j を降順に並べた p 次対角行列 Θ を考え、その対角化を導く $O_A, O_B \in \mathcal{O}(p)$; $\Theta = O_A^* V_A^* V_B O_B$ について、 $U_1 = U_A = V_A O_A$, $U_2 = U_B = V_B O_B$ とすることになる。するとこの測地線は補間的であり、逆向き測地線が $U(1-t)$ で与えられるなど、性質のいいものであることがわかる。

そこで、 p 次正定値行列 $R_A^2 = U_A^* A U_A$, $R_B^2 = U_B^* B U_B$ によって、 m についての **BS-mean** \tilde{m} を

$$A \tilde{m}_t B = U(t) \left(R_A^2 m_t R_B^2 \right) U(t)^*.$$

と定義することができる (これは何らかの測地線とは限らない)。path の対称性は、測地線の対称性によって遺伝し、 $A \tilde{m}_t B = B \tilde{m}_{1-t} A$ がすぐわかる。ほかにも様々な特徴を持つ：

Theorem 1. *BS 平均 $A \tilde{m}_t B$ は以下の性質を持つ：*

1. 遺伝性： $\text{ran } A = \text{ran } B$ ならば、久保-安藤平均と等しい： $A \tilde{m}_t B = A m_t B$ 。
特に $A \tilde{m}_t A = A$ であり、可逆な場合も久保-安藤平均になる。

2. 同次性: $(cA) \tilde{m}_t(cB) = c(A \tilde{m}_t B)$ ($c > 0$).

3. ユニタリ不変: $(U^*AU) \tilde{m}_t(U^*BU) = U^*(A \tilde{m}_t B)U$ (U :ユニタリ).

4. 単調性: $A \leq A', B \leq B'$ ならば、 $A \tilde{m}_t B \leq A' \tilde{m}_t B'$.

5. path 補間性の遺伝: $(A \tilde{m}_t B) \tilde{m}_r(A \tilde{m}_s B) = A \tilde{m}(1-r)t + rsB$ ($s, t, r \in [0, 1]$).

特殊な性質として、久保-安藤平均とは違って一般化逆行列との親和性がある:

Theorem 2. 準随伴性: $A \tilde{m}_t^* B = (A^\dagger \tilde{m}_t B^\dagger)^\dagger$.

しかし、値域をそろえるために変換されるので、「トランス不等式」は成立しない。

4 射影の BS 平均と BHML 平均

Batzies-Hüper-Machado-Leitesection[5] らの射影 P, Q の幾何平均の path は、BS 平均であることが確認できるが、彼らは公式として、

$$P(t) = P \#_t Q = e^{t\Omega} P e^{-t\Omega}, \quad \Omega = \frac{\log(2Q - I)(2P - I)}{2}.$$

のように path を明示した。「同ランク」という仮定があると、値域を測地線による変換でそろえた場合、値域内では双方単位行列になってしまい、元の平均部分はすべて単位行列なので、測地線部分で決まるので、いかなる平均の path も上記と一致することもわかる。

$$P \tilde{m}_t Q = e^{t\Omega} P e^{-t\Omega}.$$

ただし、当然ながら、少しでも射影と異なると平均も異なってくる。

ところで、 $1m0 = 0m1 = 0$ となる平均については、 $PmQ = P \wedge Q$ であることが知られているので、値域がずれて共通部分が自明になれば、久保安藤平均では消えてしまうが、次の例のように、BS 平均では「角度情報」がしっかり残るという利点がある:

Example. 2つの同ランク射影 $P = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix}$, $Q = \begin{pmatrix} \cos^2 \theta & \cos \theta \sin \theta \\ \cos \theta \sin \theta & \sin^2 \theta \end{pmatrix}$ (Q は、角度 θ の部分空間に対応する射影) について、

$$2P - I = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & -1 \end{pmatrix}, \quad 2Q - I = \begin{pmatrix} \cos 2\theta & \sin 2\theta \\ \sin 2\theta & -\cos 2\theta \end{pmatrix}$$

なので、

$$(2Q - I)(2P - I) = \begin{pmatrix} \cos 2\theta & -\sin 2\theta \\ \sin 2\theta & \cos 2\theta \end{pmatrix}, \quad \sqrt{(2Q - I)(2P - I)} = \begin{pmatrix} \cos \theta & -\sin \theta \\ \sin \theta & \cos \theta \end{pmatrix}$$

となつて、 $((2Q - I)(2P - I))^{\frac{t}{2}} = \begin{pmatrix} \cos t\theta & -\sin t\theta \\ \sin t\theta & \cos t\theta \end{pmatrix}$ となるので、path は、

$$P(t) = \begin{pmatrix} \cos t\theta & -\sin t\theta \\ \sin t\theta & \cos t\theta \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \cos t\theta & \sin t\theta \\ -\sin t\theta & \cos t\theta \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \cos^2 t\theta & \cos t\theta \sin t\theta \\ \cos t\theta \sin t\theta & \sin^2 t\theta \end{pmatrix}.$$

となつて、角度 $t\theta$ に対応する射影になっている。

5 concluding remarks

さらに、初期微分係数として m についての solidarity

$$\tilde{S}_m(A|B) = \left. \frac{d(A \tilde{m}_t B)}{dt} \right|_{t=0} = \lim_{\varepsilon \searrow 0} \frac{A \tilde{m}_\varepsilon B - A}{\varepsilon}$$

特に、 $m = \#$ の場合の相対作用素エントロピーも常に定義できる。

実際にはこの方向で無理やり rank が違うときの平均も考えられるので、可逆でない場合すべてカバーできるが、それはもはや幾何学的には意味を持たないかもしれない。

謝辞：本研究は科研費(課題番号:19K03542)の助成を受けたものである。

参考文献

- [1] P.-A. Absil, R. Mahony and R. Sepulchre, “Optimization Algorithms on Matrix Manifolds”, Princeton Univ. Press, 2008.
- [2] P.-A. Absil, R. Mahony and R. Sepulchre, Riemannian geometry of Grassmann manifolds with a view on algorithmic computation, *Acta Applicandae Mathematicae*, **80**, 199–220 (2004).
- [3] E. Andruchow, The Grassmann manifold of a Hilbert space, *Actas del XII Congreso Dr. A.A.R. Monteiro*, 2014, 41–55 (2013).
- [4] R. Bhatia and J.A.R. Holbrook: Riemannian geometry and matrix geometric means, *Linear Algebra Appl.*, **423**, 594–618 (2006).
- [5] E. Batzies, H. Hüper, L. Machado and F. Silva Leite, Geometric mean and geodesic regression on Grassmanians, *Linear Algebra Appl.*, **466**, 83–101 (2015).
- [6] S. Bonnabel and R. Sepulchre, Riemannian metric and geometric mean for positive semidefinite matrices of fixed rank, *SIAM, J. Matrix Anal. Appl.*, **31(3)**, 1055–1070 (2009).

- [7] G.Corach and A.L.Maestriperi: Differential and metrical structure of positive operators, *Positivity*, **3**, 297–315 (1999).
- [8] A.Edelman, T.A.Arias and S.T.Smith, The geometry of algorithms with orthogonality constraints, *SIAM, J. Matrix Anal. Appl.*, **20(2)**, 303–353 (1998).
- [9] J.I.Fujii, Izumino’s view of operator means, *Math. Japon.*, **33**, 671–675 (1988).
- [10] J.I.Fujii and E.Kamei, Relative operator entropy in noncommutative information theory, *Math. Japon.*, **34**, 341–348 (1989).
- [11] J.I.Fujii, M.Fujii and Y.Seo, An extension of the Kubo -Ando theory: Solidarities, *Math. Japon.*, **35**, 509–512 (1990).
- [12] J.I.Fujii, Operator means and the relative operator entropy. Operator theory and complex analysis (Sapporo, 1991), 161–172, *Oper. Theory Adv. Appl.*, **59**, Birkhäuser, Basel, 1992.
- [13] J.I.Fujii, Structure of Hiai-Petz parametrized geometry for positive definite matrices, *Linear Algebra Appl.*, **432**, 318–326 (2010).
- [14] J.I.Fujii, Path of quasi-means as a geodesic, *Linear Algebra Appl.*, **434**, 542–558 (2011).
- [15] J.I.Fujii, Interpolationality for symmetric operator means, *Sci. Math. Japon.*, **75**, 267–274 (2012).
- [16] J.I.Fujii, Moore-Penrose inverse and operator mean, to appear in *Sci. Math. Japon.*, (on line 2017-15).
- [17] J.I.Fujii and Y.Seo, The relative operator entropy and the Karcher mean, *Linear Algebra and Appl.*, **542**, 4–34 (2018).
- [18] F.Kubo and T.Ando, Means of positive linear operators, *Math. Ann.*, **246**, 205–224 (1980).
- [19] H.Porta and L.Recht, Minimality of geodesics in Grassmann manifolds, *Proc. Amer. Math. Soc.*, **100**, 464–464 (1987).
- [20] A.T.Smith, Covariance, subspace, and intrinsic Cramér-Rao bounds, *IEEE Transactions on Signal Processing*, **53(5)**, 1610–1630 (2005).
- [21] B.Vandereycken, P.-A.Absil and S.Vandewalle, Embedded geometry of the set of symmetric positive semidefinite matrices of fixed rank, 2009 IEEE/SP 15th Workshop on Statistical Signal Processing.