

Vorteile:

Gesamtkosten der Transformation $O(n)$

Differenz-Anteile meist klein \rightarrow gut komprimierbar

Differenzanteil auf Level k enthält Information über das Verhalten von v auf diesem Level, bzw. in dieser Auflösung
 \rightarrow

Multiskalenanalyse, Zerlegung des Vektors in verschiedene Frequenzbereiche = Skalen

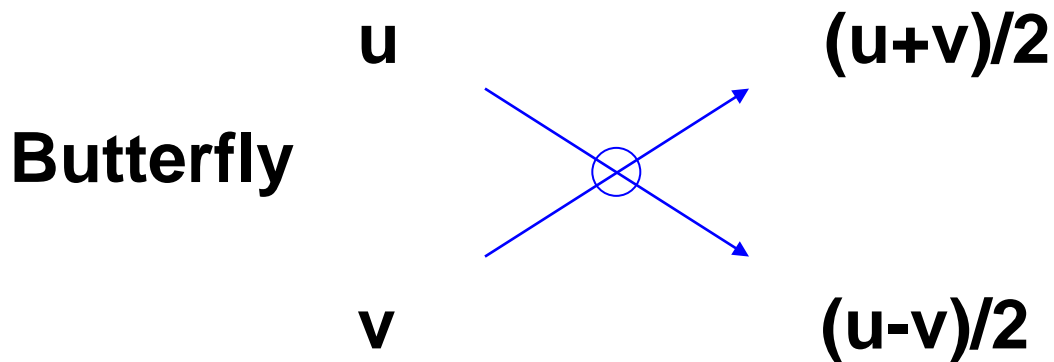
Entspricht in etwa der Fourier-Analyse

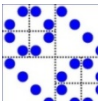
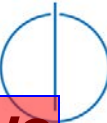
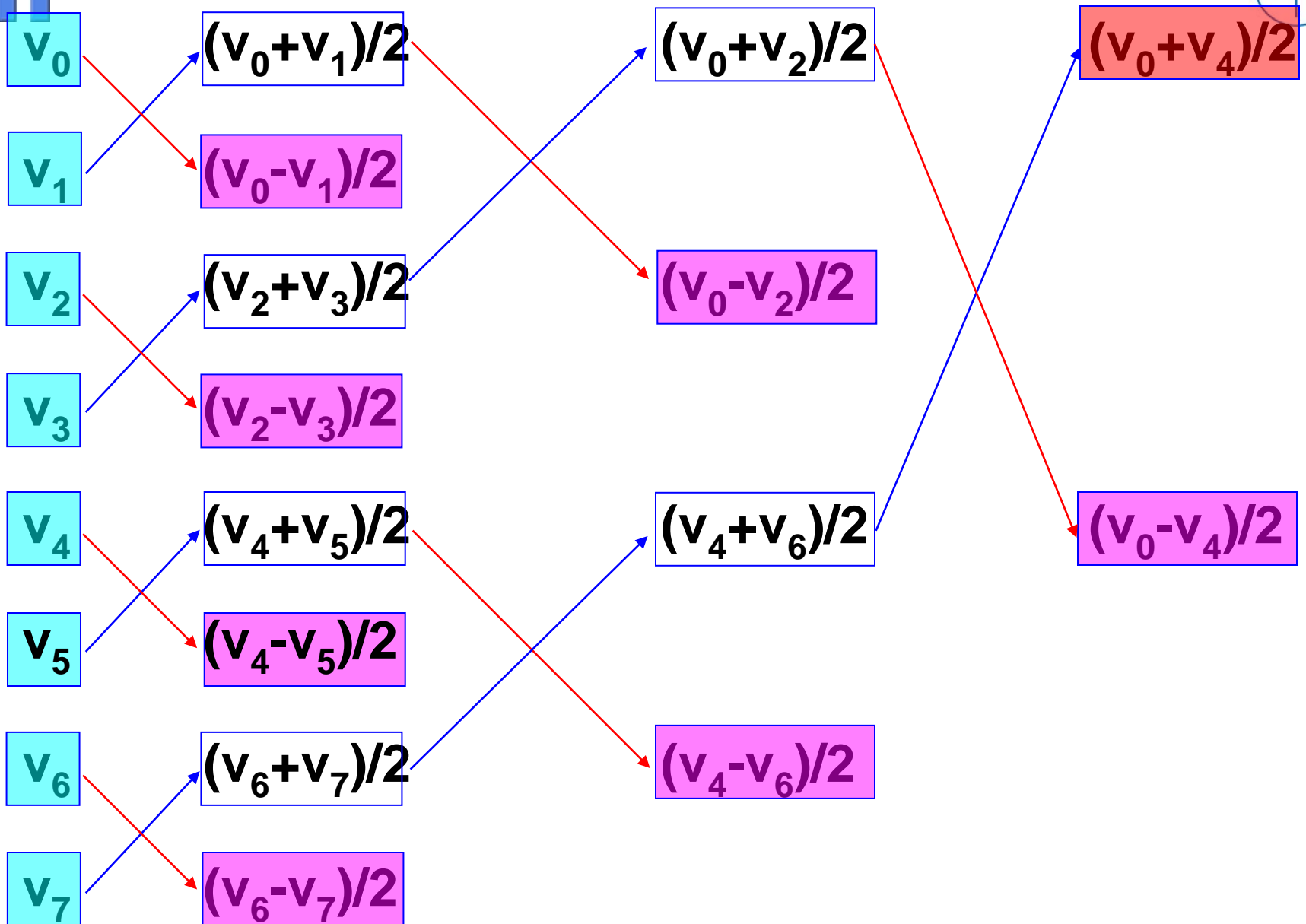
Filter muss leicht umkehrbar (invertierbar) sein!

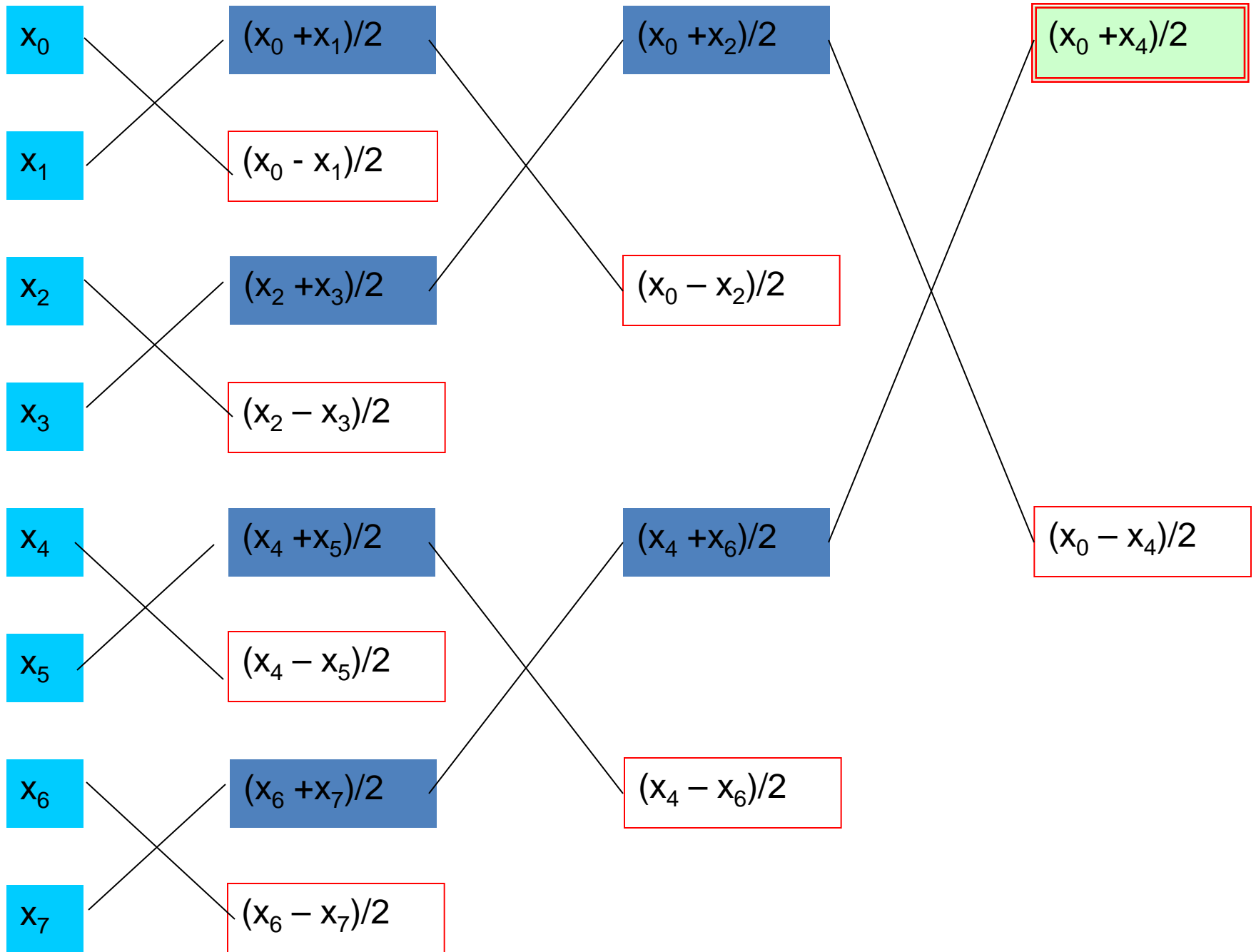
Rekonstruktionsbedingung! (vgl. DFT und IDFT)

Algorithmische Ähnlichkeit zur Fourier-Transformation am Beispiel des Haar-Filters mit den Masken

$$\frac{1}{2} \begin{bmatrix} 1 & 1 \end{bmatrix} \quad \text{und} \quad \frac{1}{2} \begin{bmatrix} 1 & -1 \end{bmatrix} \quad :$$







v wird dabei transformiert in
alle Differenzanteile und
den letzten Mittelwert.

Unterschied zur DFT:

keine Sortierphase,

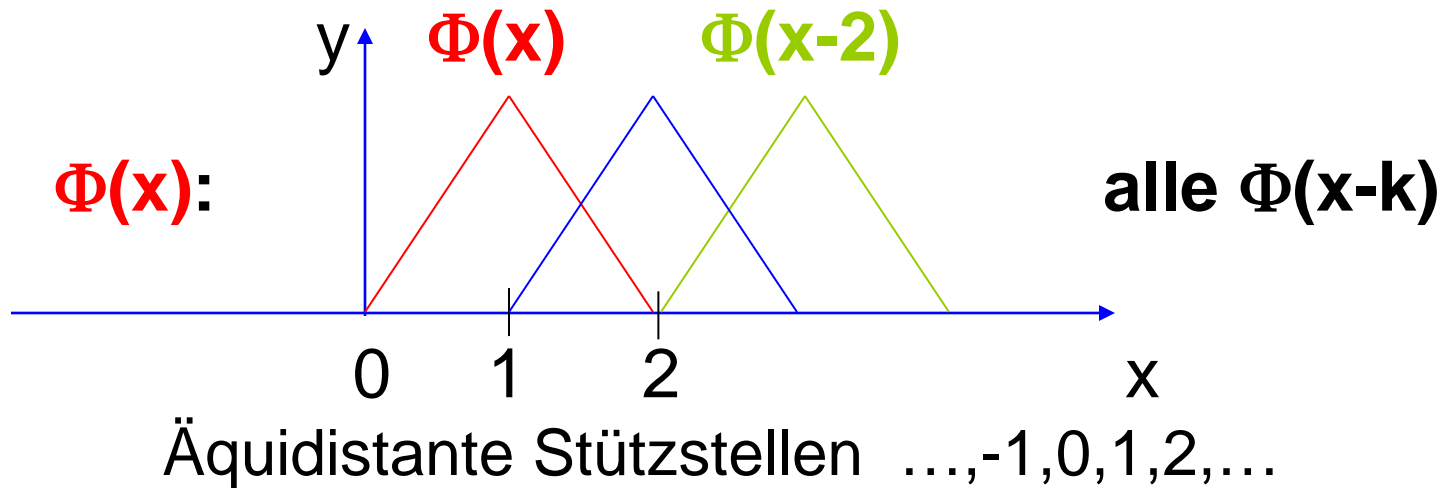
einfacher Butterfly,

nur die Mittelwertanteile werden weiter bearbeitet

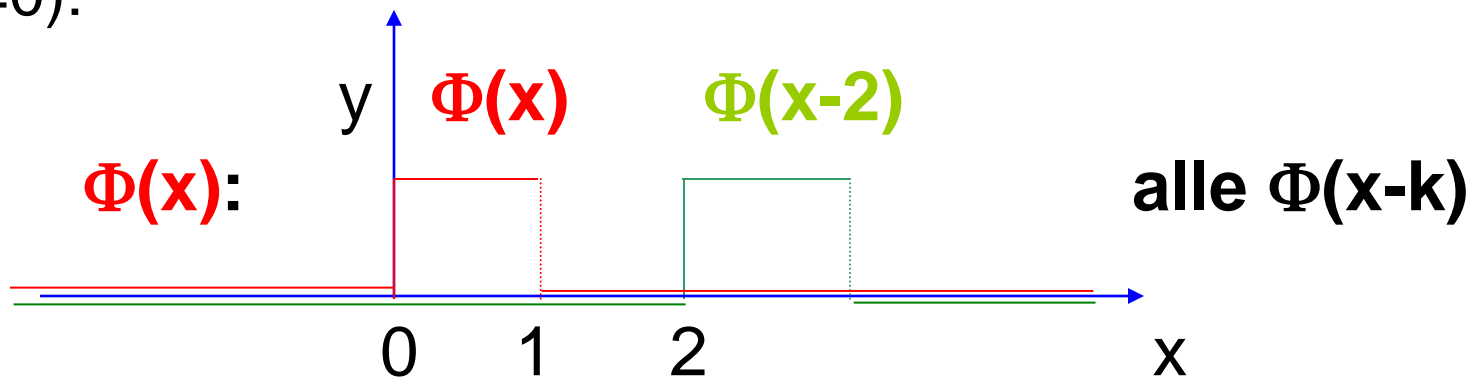
$\rightarrow O(n)$

Funktionsansatz:

Erinnerung: lineare B-Splines (Hut-Funktion)

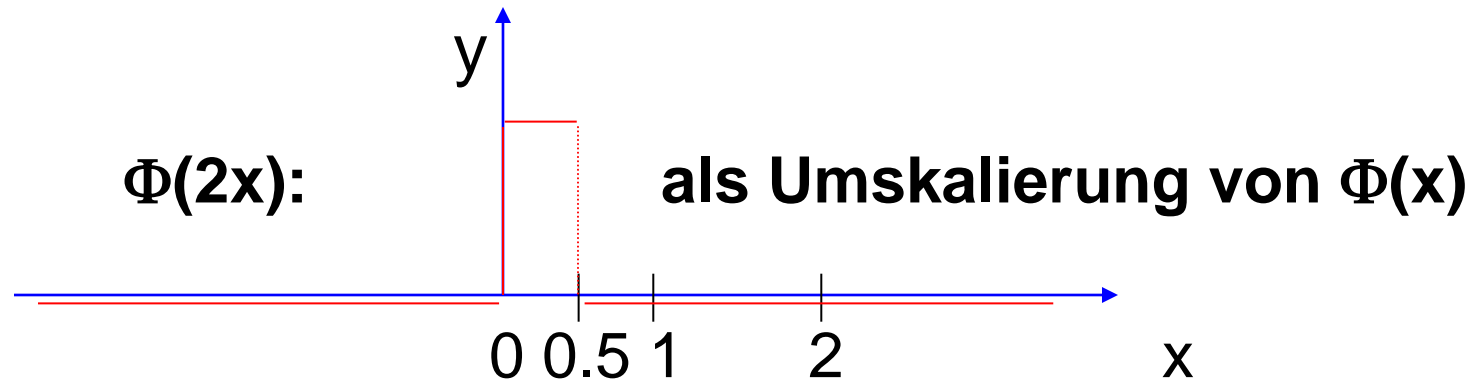


Zur Vereinfachung betrachten wir den konstanten B-Spline ($k=0$):



$\Phi(x)$ heißt Skalierungsfunktion und liefert Basis $\Phi(x-k)$, k
 Weiterhin erfüllt $\Phi(x)$ die Gleichung

$$\Phi(x) = (1 \cdot \Phi(2x) + 1 \cdot \Phi(2x-1))$$



Genauso liefern $\Phi(2x-k)$ (feinere) Ansatzfunktionen

z.B. $1 = \Phi(0.25) =$

$$= (\Phi(2 \cdot 0.25) + \Phi(2 \cdot 0.25 - 1)) = \Phi(0.5) = 1$$

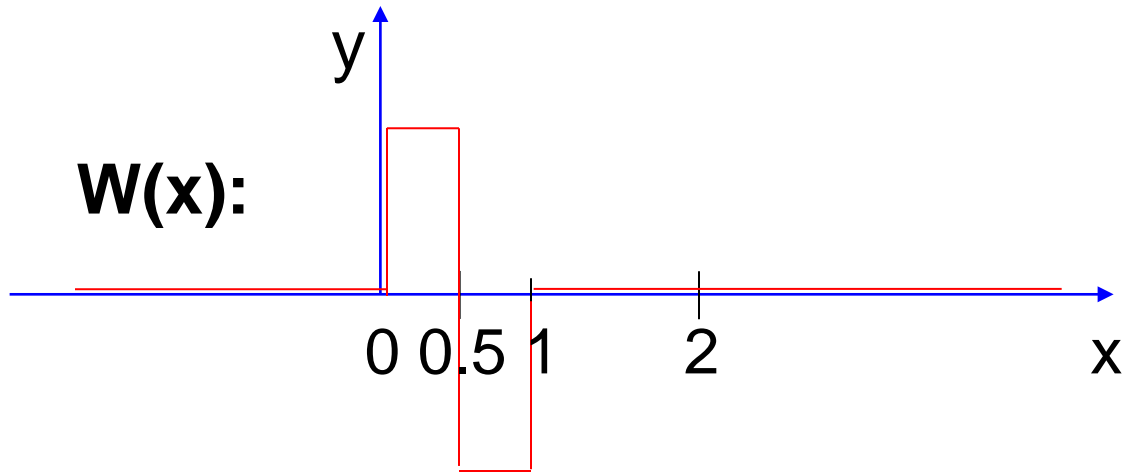
Filter-Maske $[1 \quad 1]$, denn

$$1 \cdot \Phi(2x) + 1 \cdot \Phi(2x-1)$$

zu Tiefpass-Filter (Mittelwertfilter)

Notwendig ist zweiter Hochpass-Filter (Differenz-Filter).
 Definiere dazu zur Skalierungsfunktion $\Phi(x)$ die eigentliche Waveletfunktion

$$W(x) = 1 * \Phi(2x) - 1 * \Phi(2x-1) , \quad \text{Maske } [1 \quad -1]$$



Wichtig: Orthogonalität der Ansatzfunktionen!

$$\int \Phi(x - k) \cdot W(x - j) dx = 0$$

$\Phi(2x-k)$ sind Basis zu feinerer Diskretisierung und höherer Auflösung (Genauigkeit).

Mit den obigen Beziehungen kann $\Phi(2x)$ eindeutig durch $\Phi(x)$ und $W(x)$ dargestellt werden:

$$\Phi(x) = \Phi(2x) + \Phi(2x-1)$$

$$W(x) = \Phi(2x) - \Phi(2x-1)$$

oder umgekehrt

$$\Phi(2x) = (\Phi(x) + W(x)) / 2$$

$$\Phi(2x-1) = (\Phi(x) - W(x)) / 2$$

Gegeben: $f(x) = \sum a_k \cdot \Phi(2x-k)$

Nun können wir den Übergang von Koeffizienten zur Basis $\Phi(2x-k)$ zu Koeffizienten bezgl. $\Phi(x-k)$, $W(x-k)$ beschreiben

$$a_{2k} \cdot \Phi(2x-2k) \rightarrow a_{2k} \cdot (\Phi(x-k) + W(x-k)) / 2$$

$$a_{2k+1} \cdot \Phi(2x-2k-1) \rightarrow a_{2k+1} \cdot (\Phi(x-k) - W(x-k)) / 2$$

$$\begin{aligned}
 f(x) &= \sum a_k^{(1)} \Phi(2x - k) = \\
 &= \sum a_{2k}^{(1)} \Phi(2x - 2k) + \sum a_{2k+1}^{(1)} \Phi(2x - 2k - 1) = \\
 &= \sum \frac{a_{2k}^{(1)}}{2} (\Phi(x - k) + W(x - k)) + \\
 &\quad + \sum \frac{a_{2k+1}^{(1)}}{2} (\Phi(x - k) - W(x - k)) = \\
 &= \sum \frac{a_{2k}^{(1)} + a_{2k+1}^{(1)}}{2} \cdot \Phi(x - k) + \sum \frac{a_{2k}^{(1)} - a_{2k+1}^{(1)}}{2} \cdot W(x - k) = \\
 &= \sum a_k^{(0)} \cdot \Phi(x - k) + \sum b_k^{(0)} \cdot W(x - k) = \\
 &= f^{\text{tiefpass}}(x) + f^{\text{hochpass}}(x)
 \end{aligned}$$

Anwendung der beiden Filtermasken $[1 \ 1]/2$ und $[1 \ -1]/2$ auf die Koeffizienten a_k liefert neue Koeffizienten zu hoch/tiefpass-gefilterten Teil-Funktionen.

Umgekehrt kann aus den beiden gefilterten Teilfunktionen die Gesamtfunktion $f(x)$ wieder rekonstruiert werden mittels

$$\begin{aligned}
 f^{\text{tiefpass}}(x) + f^{\text{hochpass}}(x) &= \\
 \sum a_k^{(0)} \Phi(x-k) + b_k^{(0)} W(x-k) &= \\
 = \sum a_k^{(0)} (\Phi(2x-2k) + \Phi(2x-2k-1)) + \\
 &\quad + \sum b_k^{(0)} (\Phi(2x-2k) - \Phi(2x-2k-1)) = \\
 = \sum (a_k^{(0)} + b_k^{(0)}) \cdot \Phi(2x-2k) + \\
 &\quad + \sum (a_k^{(0)} - b_k^{(0)}) \Phi(2x-2k-1) = \\
 = \sum a_{2k}^{(1)} \Phi(2x-2k) + \sum a_{2k+1}^{(1)} \Phi(2x-2k-1) = \\
 = \sum a_k^{(1)} \Phi(2x-k) = f(x)
 \end{aligned}$$

Also Anwendung der Filter

$$\begin{bmatrix} 1 & 1 \end{bmatrix} \text{ und } \begin{bmatrix} 1 & -1 \end{bmatrix}$$

auf die Koeffizienten der hoch/tiefpassgefilterten Koeffizienten liefert die Koeffizienten zur feineren Diskretisierung.

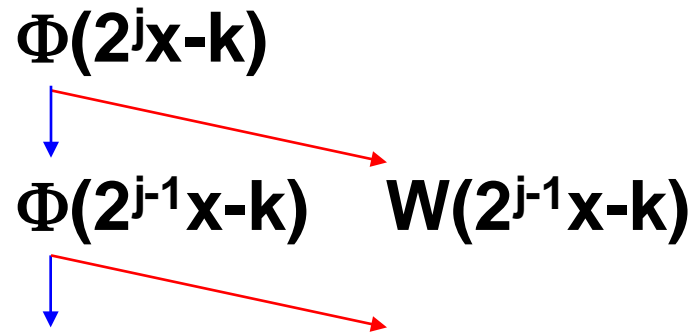
Funktionenfamilien auf verschiedenen Skalen:

$$\Phi(x-k), \quad k = \dots, -1, 0, 1, \dots$$

$$\Phi(2x-k), \quad k = \dots, -1, 0, 1, \dots$$

....

$$\Phi(2^j x - k), \quad k = \dots, -1, 0, 1, \dots, \quad j = \dots, -1, 0, 1, \dots$$



beschrieben durch die Transformation der Koeffizienten:

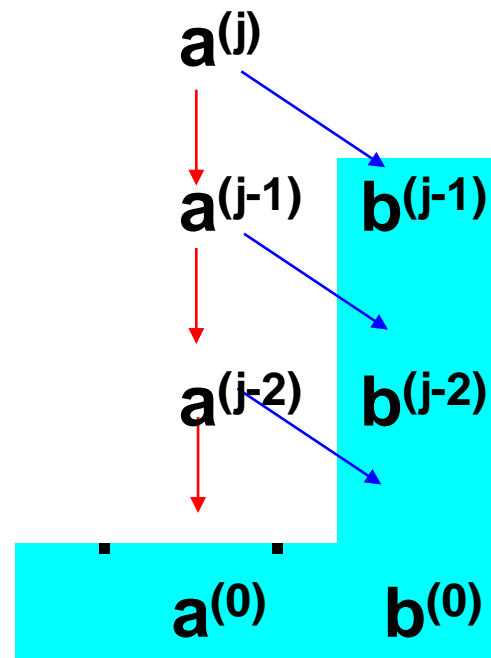
$$\begin{pmatrix} \vdots \\ \vdots \\ a_k^{(j-1)} \\ b_k^{(j-1)} \\ \vdots \\ \vdots \end{pmatrix} = \frac{1}{2} \begin{pmatrix} 1 & 1 & & & & \\ 1 & -1 & & & & \\ & & 1 & 1 & & \\ & & 1 & -1 & & \\ & & & & \ddots & \ddots \\ & & & & \ddots & \ddots \end{pmatrix} \cdot a^{(j)}$$

entsprechend Tief- und Hochpassfilter mit Haar-Filter.

Umkehrung mit

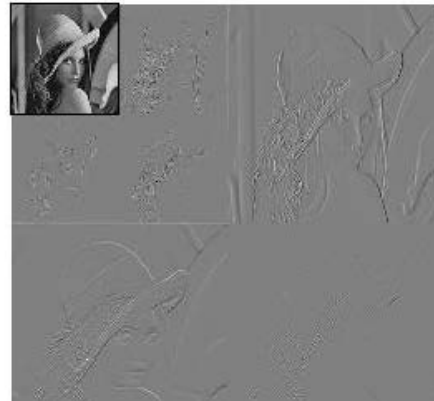
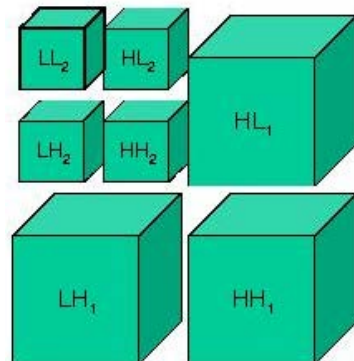
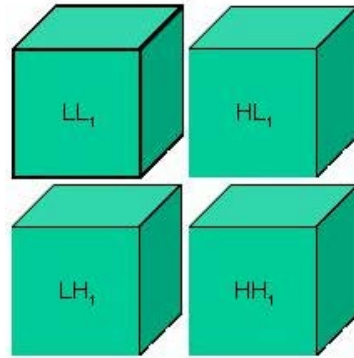
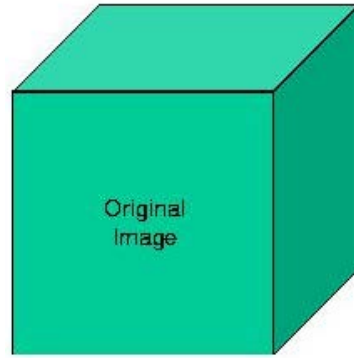
$$a^{(j)} = \begin{pmatrix} 1 & 1 & & & & \\ 1 & -1 & & & & \\ & & 1 & 1 & & \\ & & 1 & -1 & & \\ & & & & \ddots & \ddots \\ & & & & \ddots & \ddots \end{pmatrix} \cdot \begin{pmatrix} \vdots \\ \vdots \\ a_k^{(j-1)} \\ b_k^{(j-1)} \\ \vdots \\ \vdots \end{pmatrix}$$

Rekursive Wiederholung:



Wavelet als Verschmelzung der klassischen Filter und Fourieranalyse mit der Idee lokaler Basisfunktionen wie bei den B-Splines.

Haar-Filter \leftrightarrow Haar-Wavelet

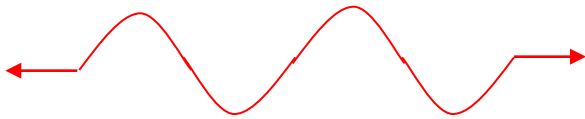


$\cos(kx), \sin(kx)$

Skalierung k

Alle gleichberechtigt

globaler Träger



keine Variations-
möglichkeit

Kantenproblem

Volle Rekursion

Kosten $O(n \log(n))$

Frequenz aus

Fourierkoeffizienten



$W(2^j x - m), \Phi(2^j x - m)$

Shift m , Skalierung 2^j

Mittelwert/Differenz

lokaler Träger



Wahl von Approximations-
güte und Diff'barkeit

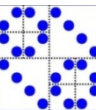
Lokal, adaptiv

Rekursion nur im Mittelwert

Kosten $O(n)$

Frequenz aus

Wavelekoeffizienten



VI. Iterationsverfahren

To infinity and beyond



Falls eine direkte Lösung des Problems nicht möglich oder ineffizient ist.

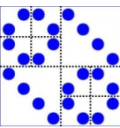
6.1. Fixpunktgleichungen

6.1.1. Problemstellung:

Iterationsfunktion $\Phi(x)$

Iteration: $x_0 \in \mathbb{R}$ Startwert,

$$x_{k+1} := \Phi(x_k) \in \mathbb{R}, k=0,1,\dots$$



Dadurch ist eine Folge x_k definiert.

Ist diese Folge konvergent:

$$x_k \rightarrow \bar{x} \quad \text{für } k \rightarrow \infty,$$

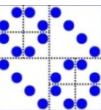
so folgt für eine stetige Funktion Φ :

$$\bar{x} = \lim_{k \rightarrow \infty} x_k = \lim_{k \rightarrow \infty} \Phi(x_{k-1}) = \Phi(\lim_{k \rightarrow \infty} x_{k-1}) = \Phi(\bar{x})$$

\bar{x} heißt Fixpunkt von Φ in \mathbf{R} .

Beispiel: $\Phi(x) = x^2$, also $x_{k+1} := \Phi(x_k) = (x_k)^2$
oder

$$x_k = x_{k-1}^2 = x_{k-2}^4 = \dots = x_0^{(2^k)}$$



Das Konvergenzverhalten hängt vom Startwert x_0 ab :

$$x_0 = 0 \quad \Rightarrow \quad x_k = 0, \quad k = 1, 2, \dots, \quad \bar{x}_1 = 0$$

$$x_0 = \pm 1 \quad \Rightarrow \quad x_k = 1, \quad k = 1, 2, \dots, \quad \bar{x}_2 = 1$$

$$0 < |x_0| < 1 \quad \Rightarrow \quad x_k = x_0^{2^k} \rightarrow 0 \quad k \rightarrow \infty, \quad \bar{x}_1 = 0$$

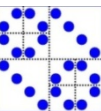
$$|x_0| > 1 \quad \Rightarrow \quad x_k = x_0^{2^k} \rightarrow \infty \quad k \rightarrow \infty, \quad (\bar{x}_3 = \infty)$$

Φ hat daher den Fixpunkte 0, bzw. ist divergent
(könnte man als Fixpunkt ∞ bezeichnen).

Die Folgen sind jeweils monoton für $k > 0$.

1 ist ebenfalls Fixpunkt, kann aber nur vorkommen,
wenn man mit ± 1 startet;

1 heißt daher abstoßender Fixpunkt.



6.1.2. Beispiel: Ausbreitung eines Grippevirus in einem Kindergarten

Zu Zeitpunkt t_i bezeichnen wir mit k_i die relative Anzahl erkrankter Kinder, also

$$k_i = \# \text{ kranke Kinder} / \# \text{ Kinder.}$$

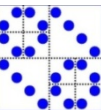
t_i ist diskrete Folge von Zeitpunkten.

Infektionsrate $\alpha > 1$, (= Übertragungswahrscheinlichkeit)

Bei jeder Kontaktaufnahme zweier Kinder kann daher eine Virusübertragung stattfinden; daher ist die Zahl neu Erkrankter zum nächsten Zeitpunkt direkt proportional zur Zahl der möglichen Begegnungen zwischen einem kranken und einem gesunden Kind.

Ein Kind, das zum Zeitpunkt t_i krank ist, ist zum Zeitpunkt t_{i+1} wieder gesund, kann sich aber wieder anstecken

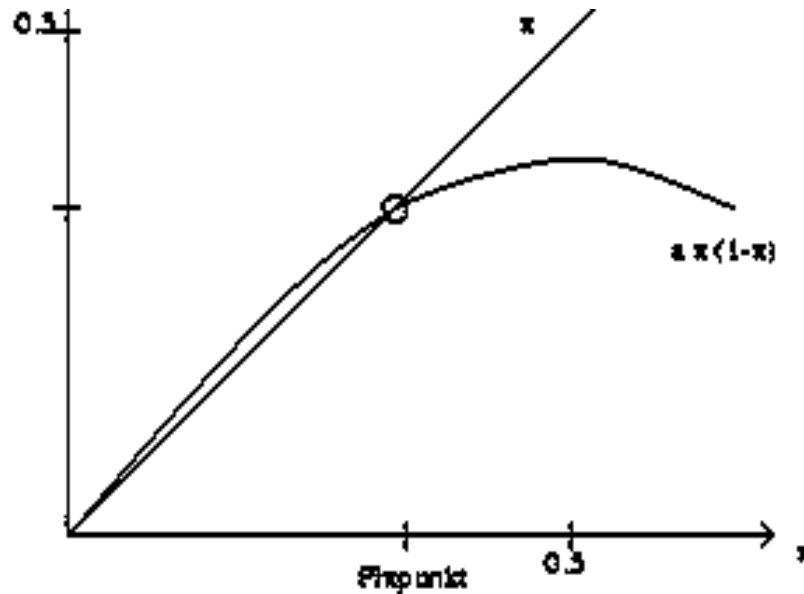
(Diese Annahme dient der Vereinfachung des Modells).



Ergibt Formel: $k_{i+1} = \alpha k_i (1 - k_i)$
 $= \alpha * \#Kranke * \#Gesunde$

Dazugehörige Iterationsfunktion: $\Phi(x) = \alpha x(1 - x)$

beschreibt eine konkave Parabel, die logistische Parabel.

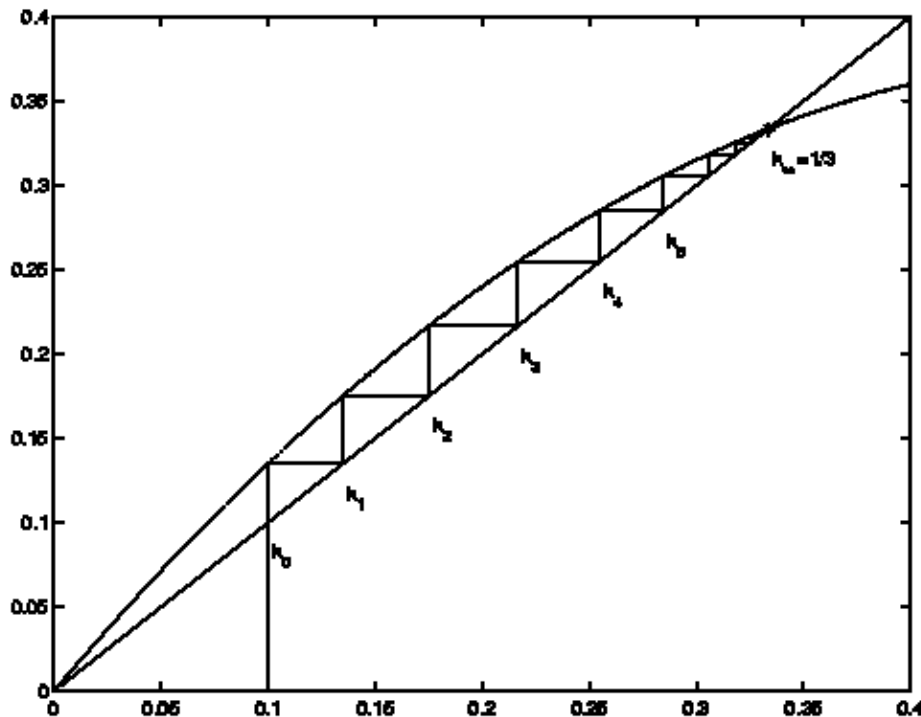


Relatives Maximum bei $x = 0.5$ mit Wert $\Phi(0.5) = 0.25\alpha$;
 Nullstellen bei $x = 0$ und $x = 1$;

Fixpunkt als Schnittpunkt von Φ mit der Funktion $g(x) \equiv x$:

$$\bar{x} = \Phi(\bar{x}) = \alpha\bar{x}(1 - \bar{x}) \Rightarrow \bar{x} = \frac{\alpha - 1}{\alpha}$$

Für $1 < \alpha < 2$ existiert genau ein eindeutiger Fixpunkt dieser Iteration zwischen 0 und 0.5.



z.B. $x_0=0.1$ und $\alpha=1.5$

Konvergiert monoton wachsend gegen $1/3$

Fixpunkt geometrisch:

Schnittpunkt zwischen Iterationsfunktion $\Phi(x)$ und
Gerade $g(x) \equiv x$.

6.1.3. Banach'scher Fixpunktsatz

Frage:

Wann konvergiert die so erzeugte Folge und wann nicht?

Welche Eigenschaften müssen Φ und x_0 haben,
damit Konvergenz gegen einen (ev. eindeutigen) Fixpunkt
vorliegt?

Banach'scher Fixpunktsatz:

**Sei I ein abgeschlossenes Intervall, Startwert $x_0 \in I$,
 Φ eine Abbildung $\Phi: I \rightarrow I$, d.h. $\Phi(I) \subseteq I$,
 Φ sei in I eine kontrahierende Abbildung, d.h. es gibt eine
 Konstante $0 < L < 1$ mit**

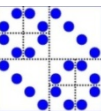
$$x, y \in I \Rightarrow |\Phi(x) - \Phi(y)| \leq L \cdot |x - y|.$$

**Dann konvergiert die Folge $x_{k+1} := \Phi(x_k)$
 gegen den eindeutigen Fixpunkt $\bar{x} \in I$,
 also $x_k \rightarrow \bar{x} = \Phi(\bar{x})$ für $k \rightarrow \infty$.**

Beweis: Offensichtlich gilt stets $x_k \in I$; daher folgt

$$\begin{aligned} |x_{k+1} - x_k| &= |\Phi(x_k) - \Phi(x_{k-1})| \leq L|x_k - x_{k-1}| \leq \\ &\leq L(L|x_{k-1} - x_{k-2}|) \leq \dots \leq L^k|x_1 - x_0|. \end{aligned}$$

Damit ergibt sich für den Abstand zweier Iterierter x_k und x_m für $m > k$:



$$\begin{aligned}
 |x_m - x_k| &= |(x_m - x_{m-1}) + (x_{m-1} - x_{m-2}) + \dots + (x_{k+1} - x_k)| \leq \\
 &\leq |x_m - x_{m-1}| + |x_{m-1} - x_{m-2}| + \dots + |x_{k+1} - x_k| \leq \\
 &\leq (L^{m-1} + L^{m-2} + \dots + L^k) \cdot |x_1 - x_0| \leq \\
 &\leq \sum_{j=k}^{\infty} L^j \cdot |x_1 - x_0| = \frac{L^k}{1-L} \cdot |x_1 - x_0|.
 \end{aligned}$$



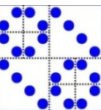
Daher wird der Abstand zwischen zwei Iterierten beliebig klein, wenn sie beide großen Index haben:

$$|x_m - x_k| \leq \varepsilon \quad \text{für} \quad m, k \geq N(\varepsilon)$$

Die Zahlen x_k bilden daher eine **Cauchy-Folge!**

Cauchy-Folgen sind konvergent in I , da I abgeschlossen ist!
(dies ist genau die mathematische Definition von Abgeschlossenheit).

Daher existiert eine Zahl $\bar{x} \in I$ mit $x_k \rightarrow \bar{x}$ für $k \rightarrow \infty$.



\bar{x} ist der gesuchte Fixpunkt in I , denn

$$\begin{aligned} 0 &\leq |\bar{x} - \Phi(\bar{x})| \leq |\bar{x} - x_k| + |x_k - \Phi(\bar{x})| \leq \\ &\leq |\bar{x} - x_k| + |\Phi(x_{k-1}) - \Phi(\bar{x})| \leq \\ &\leq |\bar{x} - x_k| + L|x_{k-1} - \bar{x}| \rightarrow 0 \quad \text{für } k \rightarrow \infty \end{aligned}$$

Daher muss gelten $\bar{x} - \Phi(\bar{x}) = 0$.

Dieser Fixpunkt in I ist eindeutig, denn

$$\begin{aligned} \bar{x} = \Phi(\bar{x}) \in I \quad \text{und} \quad \hat{x} = \Phi(\hat{x}) \in I \quad \text{mit} \quad \bar{x} \neq \hat{x} &\Rightarrow \\ |\bar{x} - \hat{x}| = |\Phi(\bar{x}) - \Phi(\hat{x})| \leq L \cdot |\bar{x} - \hat{x}| < |\bar{x} - \hat{x}| &\quad \text{falsch !} \end{aligned}$$

Widerspruch, daher Annahme $\bar{x} \neq \hat{x}$ falsch, also $\bar{x} = \hat{x}$

Außerdem gilt: x_k konvergiert *linear* gegen \bar{x} , denn

$$\begin{aligned} \underline{|x_{k+1} - \bar{x}|} &= |\Phi(x_k) - \Phi(\bar{x})| \leq L \underline{|x_k - \bar{x}|} \leq \dots \\ \dots &\leq L^{k+1} |x_0 - \bar{x}| \rightarrow 0, \quad L < 1 \end{aligned} \quad \#$$

Um den Satz anwenden zu können benötigt man also, dass Φ ein Intervall in sich abbildet, und zwar so, dass die Funktionswerte dabei näher zusammenrücken.

$L < 1$ heißt Lipschitz-Konstante.

Ist Φ diff'bar, so lassen sich diese Bedingungen mit Hilfe des Mittelwertsatzes vereinfachen:

Für $x, y \in I$ ist dann nämlich

$$\Phi(y) = \Phi(x) + \Phi'(z) \cdot (y - x)$$

mit einer Zahl z zwischen x und y .

Daher gilt:
$$|\Phi(y) - \Phi(x)| \leq \max_{z \in I} |\Phi'(z)| \cdot |y - x|$$

Ist nun $|\Phi'(z)| < 1$ in I , so kann man

$$L := \max_{z \in I} |\Phi'(z)| \quad \text{setzen.}$$

Wir betrachten den Mittelwertsatz jetzt speziell in der Nähe eines Fixpunktes \bar{x} . Dann gilt:

Sei $|\Phi'(\bar{x})| < 1$; dann kann man eine Umgebung U von \bar{x} angeben, in der Φ kontrahierend ist und $\Phi(U) \subseteq U$ gilt (es liegt dann also **lokale Konvergenz vor).**

Sei $|\Phi'(\bar{x})| < 1$; dann kann man eine Umgebung U von \bar{x} angeben, in der Φ kontrahierend ist und $\Phi(U) \subseteq U$ gilt (es liegt dann also **lokale** Konvergenz vor).

Beweis: Setze $U := [\bar{x}-h, \bar{x}+h]$ und wähle dabei $h > 0$ so klein, dass immer noch $L := \max_{z \in U} |\Phi'(z)| < 1$ gilt (Φ' ist ja stetig!).

Für ein $x \in U$ folgt dann $|\Phi(x) - \bar{x}| = |\Phi(x) - \Phi(\bar{x})| \leq L \cdot |x - \bar{x}| < h$ und daher ist auch $\Phi(x) \in U$.

Also insgesamt: $\Phi(U) \subseteq U$ und außerdem ist Φ kontrahierend in U .

Daher ist der Banach'sche Fixpunktsatz anwendbar.

Einen Fixpunkt \bar{x} mit $|\Phi'(\bar{x})| < 1$ nennt man
,anziehenden Fixpunkt'.

Im Beispiel x^2 ist 0 anziehender Fixpunkt, da $\Phi'(0) = 2 \cdot 0 = 0 < 1$

Daher gilt für $L = 0.5$ und $U = [-0.25, 0.25]$, dass $\Phi(x) = x^2$
in U eine kontrahierende Selbstabbildung von U ist \rightarrow mit dem
Fixpunktsatz von Banach: Konvergenz in U gegen Fixpunkt 0!

Andererseits heißt ein Fixpunkt \bar{x} mit $|\Phi'(\bar{x})| > 1$
abstoßender Fixpunkt,

da keine kontrahierende Umgebung für Φ existiert.

Im Beispiel x^2 ist 1 abstoßender Fixpunkt,

da $\Phi'(1) = 2 \cdot 1 = 2 > 1$.

Beispiel Grippevirus: $\Phi(x) = \alpha x(1-x)$

mit Fixpunkt $\bar{x} = (\alpha - 1)/\alpha$

Dann gilt $\Phi'(\bar{x}) = \alpha(1 - 2\bar{x}) = \alpha\left(1 - 2\frac{\alpha - 1}{\alpha}\right) = 2 - \alpha$

$\bar{x} = (1-\alpha)/\alpha$ ist anziehender Fixpunkt für $1 < \alpha < 3$.

Für $\alpha \geq 3$ ergibt sich abstoßender Fixpunkt!
Keine Konvergenz!

Für $\alpha \leq 1$ kein Fixpunkt im Intervall $[0, 1]$.

Wegen $x_{k+1} = \Phi(x_k) = \bar{x} + \Phi'(z)(x_k - \bar{x})$

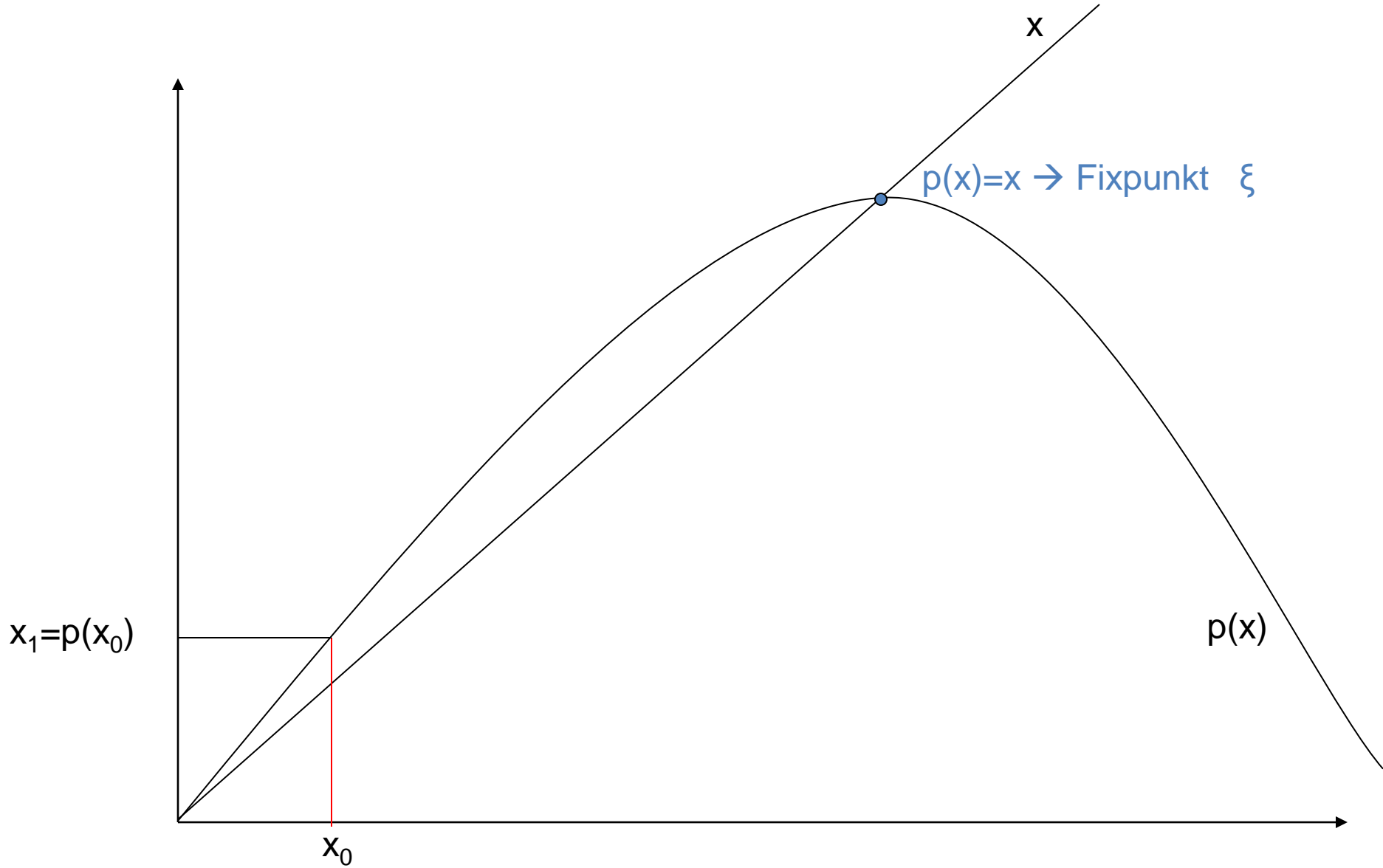
gilt außerdem $x_{k+1} - \bar{x} = \Phi'(z)(x_k - \bar{x})$

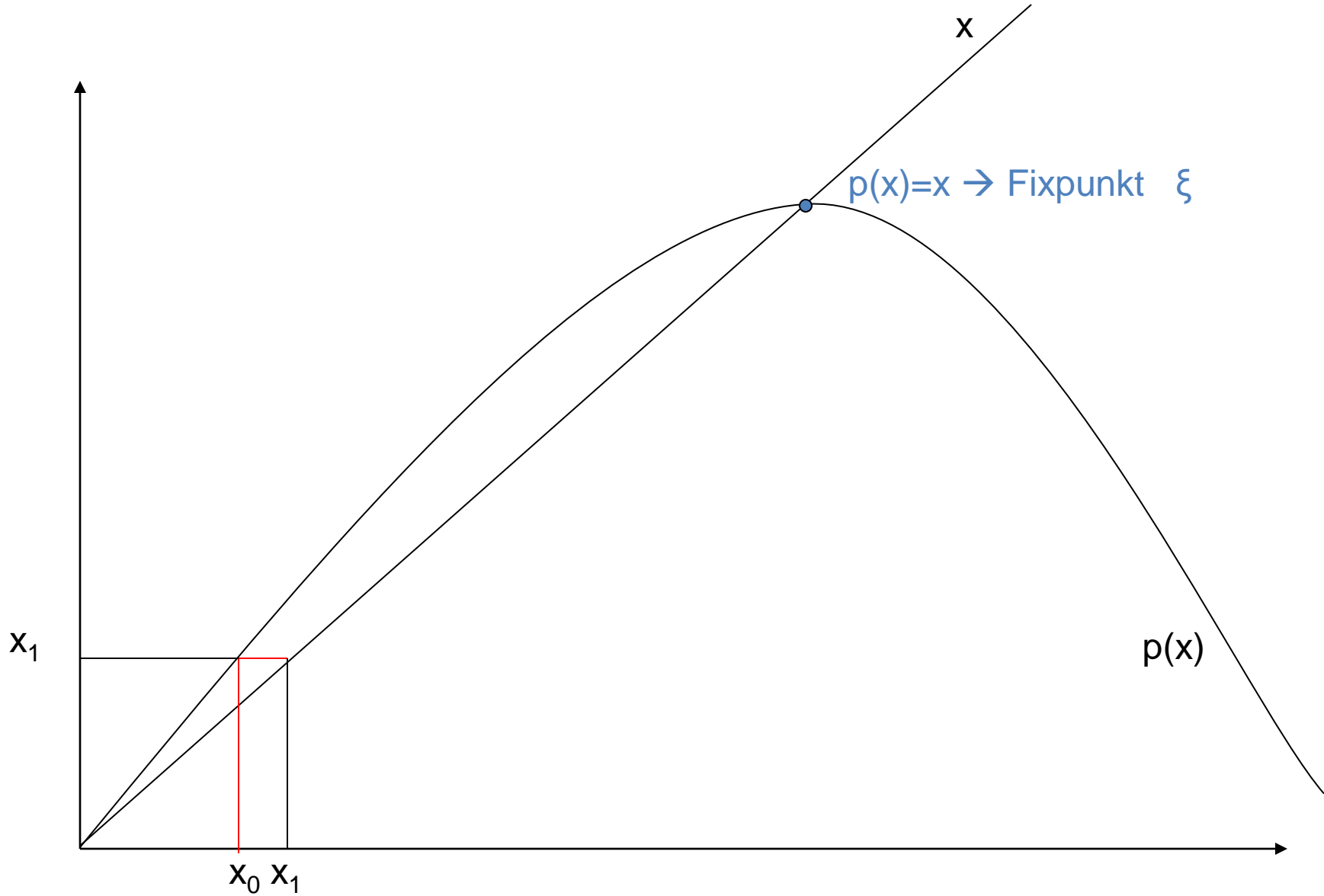
Daher ist für $1 < \alpha < 2$ $\Phi'(\bar{x}) > 0$, und die Folge x_k ist lokal monoton wachsend oder fallend, je nach Startwert rechts oder links vom Fixpunkt.

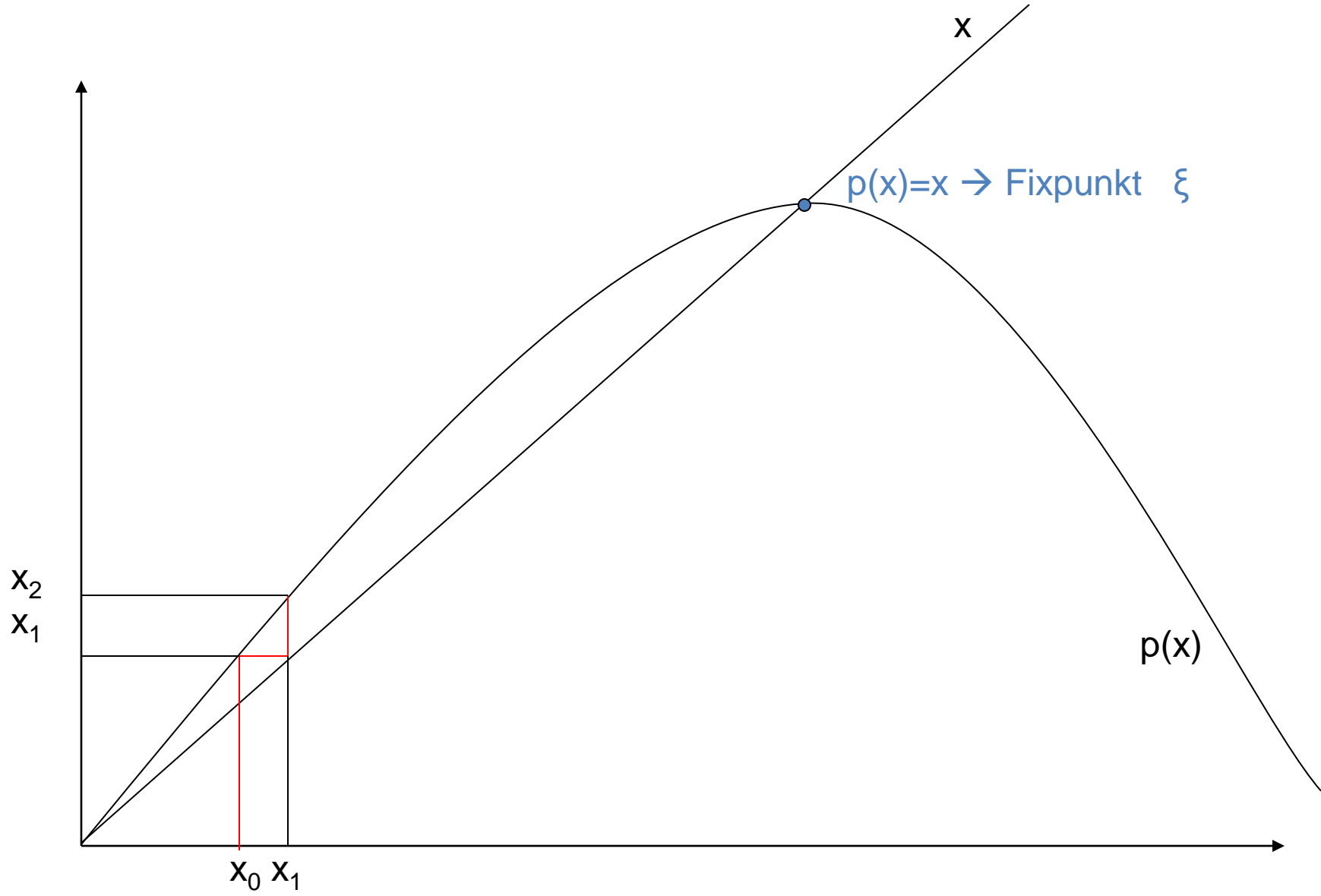
$$x_{k+1} - \bar{x} = \Phi'(z)(x_k - \bar{x})$$

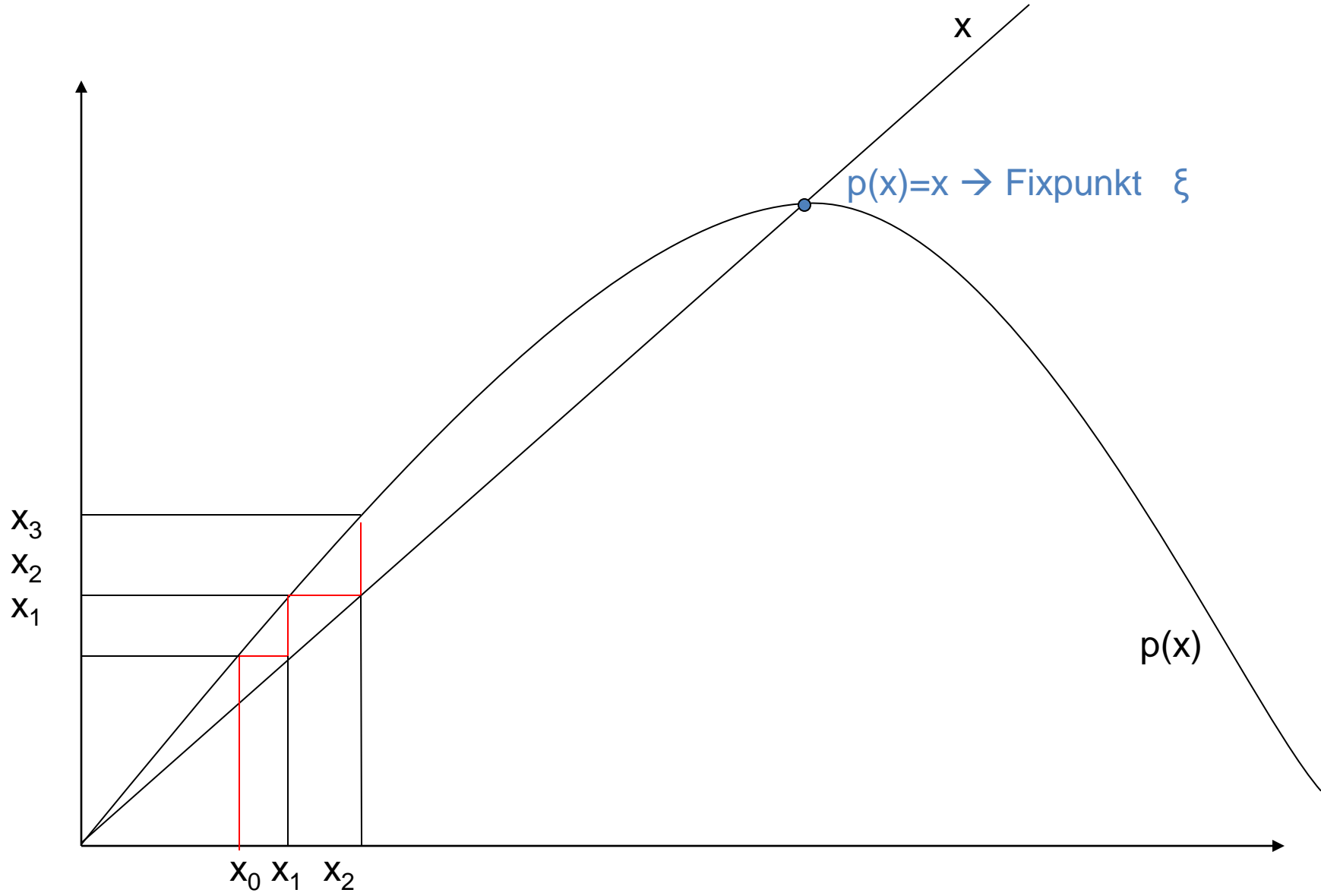
(die x_k liegen stets auf derselben Seite, rechts oder links vom Fixpunkt)

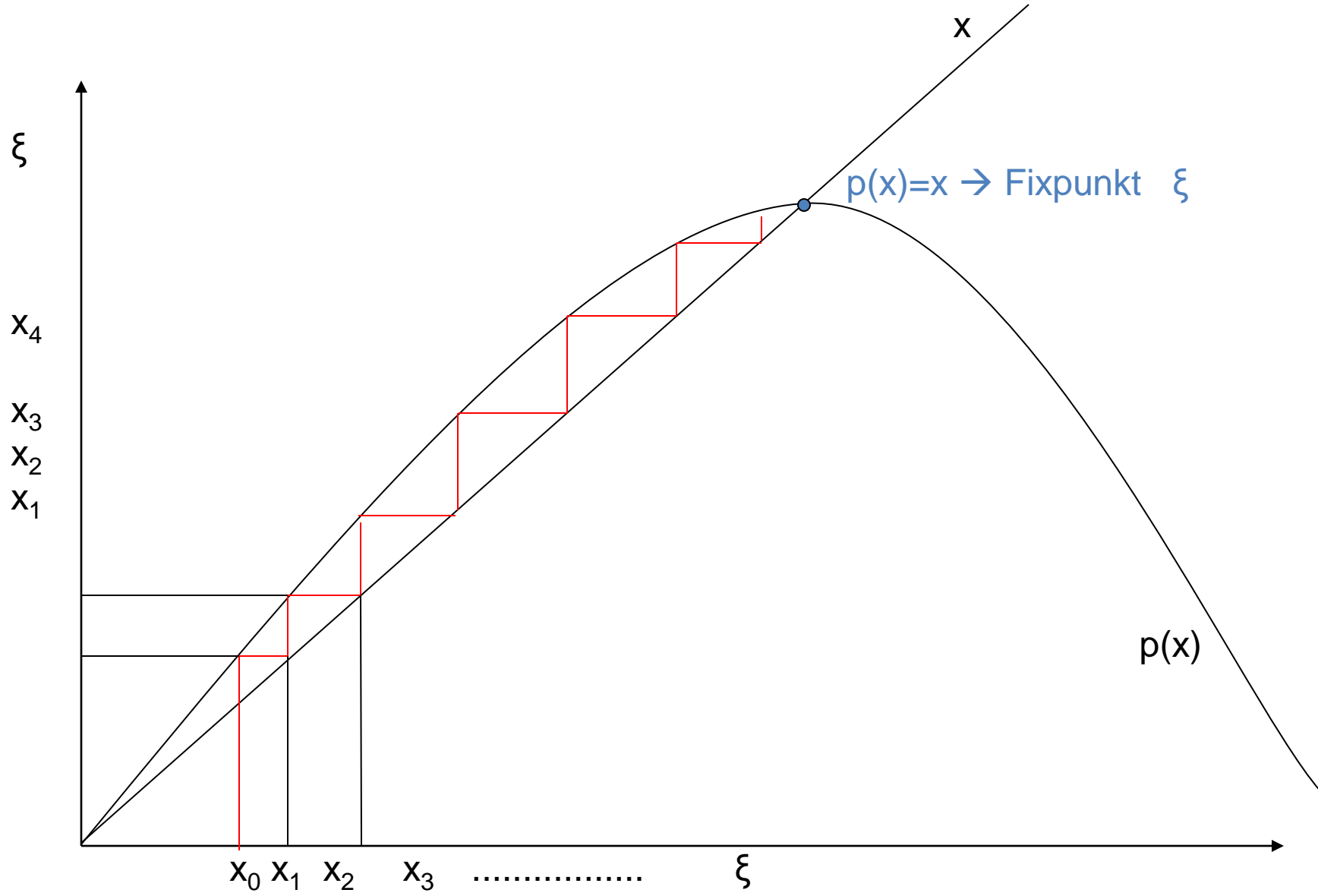
Dagegen konvergiert für $2 < \alpha < 3$ die Folge alternierend, da $\Phi'(\bar{x}) < 0$ ist.

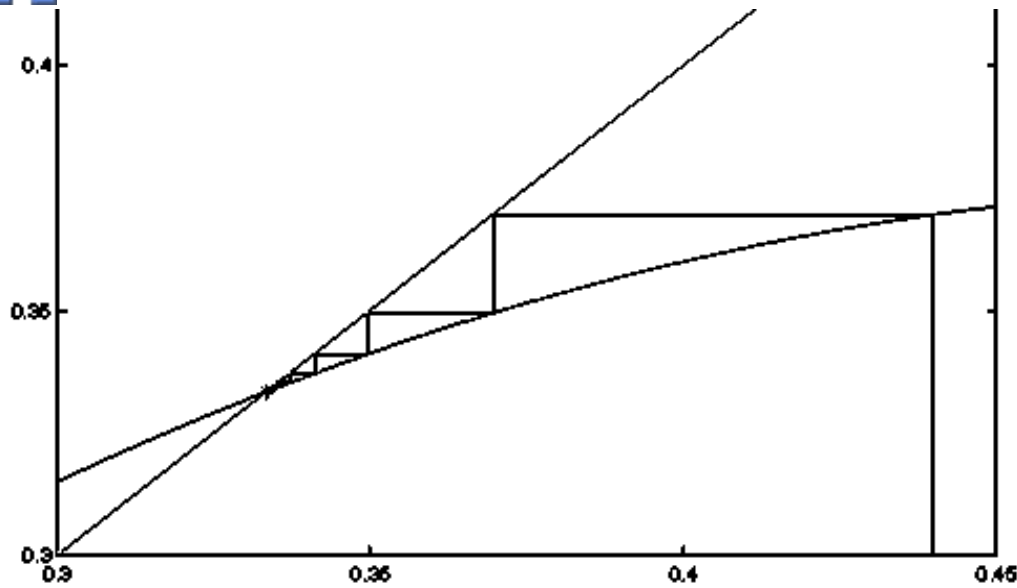




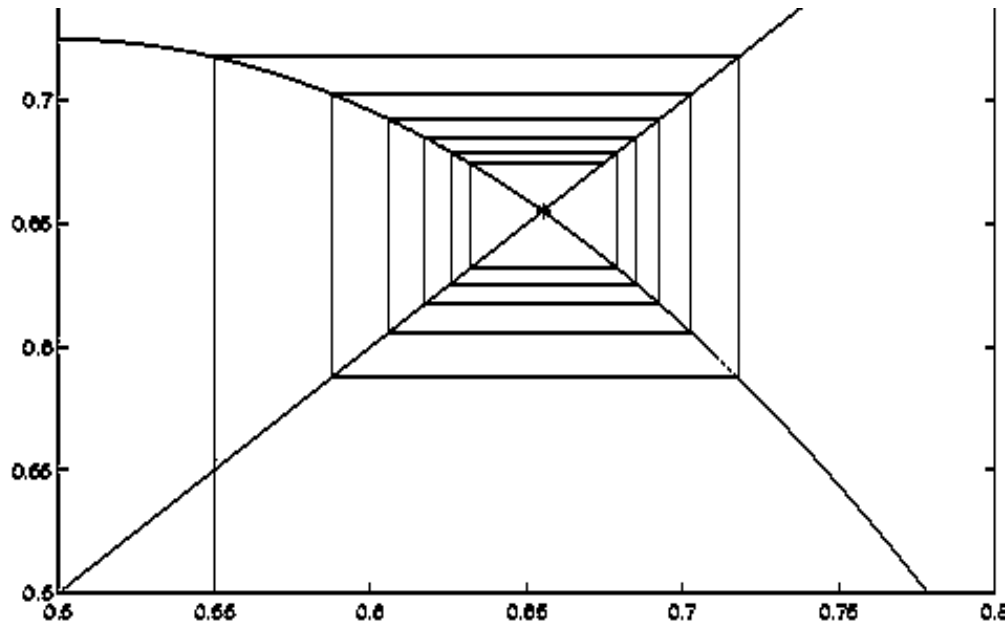








$\alpha = 1.5$ und Startwert
 $0.44 \rightarrow$
 monoton fallende
 Konvergenz



$\alpha = 2.9$ und Startwert
 $0.55 \rightarrow$
 alternierende
 Konvergenz