

# Matlab: complessità e stabilità degli algoritmi. Alcuni esempi.

Ángeles Martínez Calomardo e Alvise Sommariva

Università degli Studi di Padova

6 novembre 2012

# Esempio di algoritmo instabile

Formula risolutiva dell'equazione di secondo grado

Dato  $x^2 + 2px - q$ , con  $p^2 + q \geq 0$  eseguiamo un primo algoritmo Matlab che valuta la radice via:

$$y = -p + \sqrt{p^2 + q}. \quad (1)$$

- $p^2 + q \geq 0$  implica radici reali.
- Potenzialmente instabile per  $p \gg q$  a causa della sottrazione tra  $p$  e  $\sqrt{p^2 + q}$  (cancellazione).

Valutiamo la radice con un secondo algoritmo stabile via razionalizzazione di (1):

$$\begin{aligned} y &= -p + \sqrt{p^2 + q} = \frac{(-p + \sqrt{p^2 + q})(p + \sqrt{p^2 + q})}{(p + \sqrt{p^2 + q})} \\ &= \frac{q}{(p + \sqrt{p^2 + q})} \end{aligned} \quad (2)$$

# Codice stabilità : algoritmo 1

Salviamo il seguente codice in `radicesecgrado.m`.

```
p=1000; q=0.018000000081; sol=0.9*10^(-5);  
  
% ALGORITMO 1  
s=p^2;  
t=s+q;  
if t >=0  
    u=sqrt(t);  
else  
    fprintf('\n \t [RADICI COMPLESSE]');  
end  
s1=-p+u;
```

## Codice stabilità : algoritmo 2

```
% ALGORITMO 2
s=p^2;
t=s+q;
if t >=0
    u=sqrt(t);
else
    fprintf ('\n \t [RADICI COMPLESSE] ');
end
v=p+u;
t1=q/v;
```

## Codice stabilità : stampa risultati

```
fprintf( '\n \t [ALG.1]: %10.19f ',s1);
fprintf( '\n \t [ALG.2]: %10.19f ',t1);
if length(sol) > 0 & (sol ~= 0)
    rerr1 =abs(s1-sol)/abs(sol);
    rerr2=abs(t1-sol)/abs(sol);
    fprintf( '\n \t [REL.ERR.ALG.1]: %2.2e ',rerr1);
    fprintf( '\n \t [REL.ERR.ALG.2]: %2.2e ',rerr2);
end
```

# Test.

Come previsto, il secondo algoritmo si comporta notevolmente meglio del primo, che compie un errore relativo dell'ordine di circa  $10^{-9}$ . Infatti:

```
>> radicesecgrado  
  
[ALG.1] [1]: 0.0000089999999772772  
[ALG.2] [1]: 0.0000090000000000000  
[REL. ERR.] [ALG.1]: 2.52e-009  
[REL. ERR.] [ALG.2]: 0.00e+000  
  
>>
```

# Calcolo $\pi$

Eseguiamo un codice Matlab che valuti le successioni  $\{u_n\}$ ,  $\{z_n\}$ , definite rispettivamente come

$$\begin{cases} s_1 = 1, \quad s_2 = 1 + \frac{1}{4} \\ u_1 = 1, \quad u_2 = 1 + \frac{1}{4} \\ s_{n+1} = s_n + \frac{1}{(n+1)^2} \\ u_{n+1} = \sqrt{6 s_{n+1}} \end{cases}$$

e

$$\begin{cases} z_1 = 1, \quad z_2 = 2 \\ z_{n+1} = 2^{n-\frac{1}{2}} \sqrt{1 - \sqrt{1 - 4^{1-n} \cdot z_n^2}} \end{cases} \quad (3)$$

che *teoricamente* convergono a  $\pi$ .

# Calcolo $\pi$

Implementiamo poi la successione, diciamo  $\{y_n\}$ , che si ottiene razionalizzando (3), cioè moltiplicando numeratore e denominatore di

$$z_{n+1} = 2^{n-\frac{1}{2}} \sqrt{1 - \sqrt{1 - 4^{1-n} \cdot z_n^2}}$$

per

$$\sqrt{1 + \sqrt{1 - 4^{1-n} \cdot z_n^2}}$$

e calcoliamo  $u_m$ ,  $z_m$  e  $y_m$  per  $m = 2, 3, \dots, 40$  (che teoricamente dovrebbero approssimare  $\pi$ ).

Infine disegniamo in un unico grafico l'andamento dell'errore relativo di  $u_n$ ,  $z_n$  e  $y_n$  rispetto a  $\pi$  aiutandoci con l'help di Matlab relativo al comando `semilogy`.

# Calcolo $\pi$ : metodo 1

In seguito scriviamo un'implementazione di quanto richiesto commentando i risultati. Si salvi in un file `pigreco.m` il codice

```
% SEQUENZE CONVERGENTI "PI GRECO".
```

```
% METODO 1.  
s(1)=1; u(1)=1;  
s(2)=1.25; u(2)=s(2);  
for n=2:40  
    s(n+1)=s(n)+(n+1)^(-2);  
    u(n+1)=sqrt(6*s(n+1));  
end  
rel_err_u=abs(u-pi)/pi;  
  
fprintf('\n');
```

# Calcolo $\pi$ : metodo 2

```
% METODO 2.  
format long  
z(1)=1;  
z(2)=2;  
for n=2:40  
    c=(4^(1-n)) * (z(n))^2; inner_sqrt=sqrt(1-c);  
    z(n+1)=(2^(n-0.5))*sqrt( 1-inner_sqrt );  
end  
rel_err_z=abs(z-pi)/pi;  
  
fprintf( '\n' );
```

## Calcolo $\pi$ : metodo 3

```
% METODO 3.  
y(1)=1;  
y(2)=2;  
for n=2:40  
    num=(2^(1/2)) * abs(y(n));  
    c=(4^(1-n)) * (z(n))^2;  
    inner_sqrt=sqrt(1-c);  
    den=sqrt( 1+inner_sqrt );  
    y(n+1)=num/den;  
end  
rel_err_y=abs(y-pi)/pi;
```

## Calcolo $\pi$ : plots

```
% SEMILOGY PLOT.  
hold on;  
semilogy(1:length(u),rel_err_u,'k.');//  
semilogy(1:length(z),rel_err_z,'m+');//  
semilogy(1:length(y),rel_err_y,'ro');//  
hold off;
```

Di seguito digitiamo sulla shell di Matlab/Octave

```
|>> pigreco
```

# Plot risultati

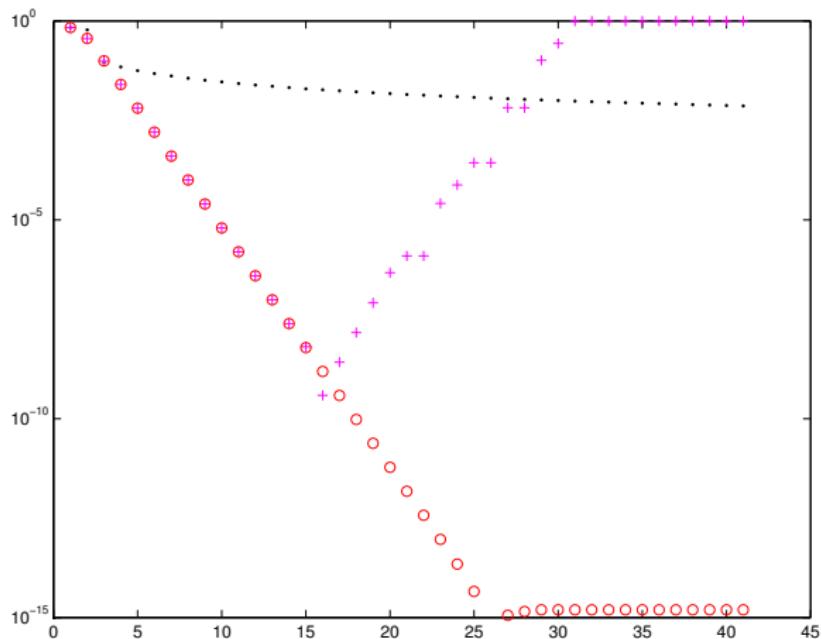


Figura : Errore relativo commesso con le 3 successioni, rappresentate rispettivamente da ., + e o.

## Discussione risultati.

- La prima successione converge molto lentamente a  $\pi$ , la seconda diverge mentre la terza converge velocemente a  $\pi$ .
- Per alcuni valori  $\{z_n\}$  e  $\{y_n\}$  coincidono per alcune iterazioni per poi rispettivamente divergere e convergere a  $\pi$ . Tutto ciò è naturale poichè le due sequenze sono analiticamente (ma non numericamente) equivalenti.
- Dal grafico dell'errore relativo, la terza successione, dopo aver raggiunto errori relativi prossimi alla precisione di macchina, si assesta ad un errore relativo di circa  $10^{-15}$  (probabilmente per questioni di arrotondamento).

# L'algoritmo 2 in dettaglio

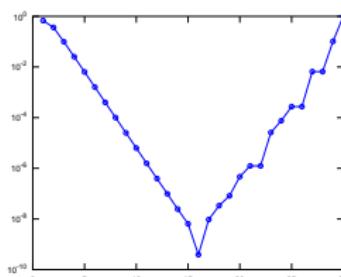
## Successione approssimante $\pi$

Nell'approssimare il valore di  $\pi$  con la seguente formula ricorsiva

$$\begin{aligned} z_2 &= 2 \\ z_{n+1} &= 2^{n-0.5} \sqrt{1 - \sqrt{1 - 4^{1-n} z_n^2}}, \quad n = 2, 3, \dots, \end{aligned}$$

si ottiene la seguente successione di valori (dove si è posto  $c = 4^{1-n} z_n^2$ ).

$n + 1$	$c$	$1 - \sqrt{1 - c}$	$z_{n+1}$	$\frac{ z_{n+1} - \pi }{\pi}$
...	...	...	...	...
10	1.505e-04	7.529e-05	3.14157294036	6.27e-06
11	3.764e-05	1.882e-05	3.14158772527	1.57e-06
12	9.412e-06	4.706e-06	3.14159142150	3.92e-07
13	2.353e-06	1.176e-06	3.14159234561	9.80e-08
14	5.882e-07	2.941e-07	3.14159257654	2.45e-08
15	1.470e-07	7.353e-08	3.14159263346	6.41e-09
16	3.676e-08	1.838e-08	3.14159265480	3.88e-10
17	9.191e-09	4.595e-09	3.14159264532	2.63e-09
18	2.297e-09	1.148e-09	3.14159260737	1.47e-08
19	5.744e-10	2.872e-10	3.14159291093	8.19e-08
...	...	...	...	...
28	2.220e-15	1.110e-15	3.16227766016	6.58e-03
29	5.551e-16	3.330e-16	3.46410161513	1.03e-01
30	1.665e-16	1.110e-16	4.00000000000	2.73e-01
31	5.551e-17	0.000e+00	0.00000000000	1.00e+00
32	0.000e+00	0.000e+00	0.00000000000	1.00e+00



## Una successione ricorrente.

Consideriamo la successione  $\{I_n\}$  definita da

$$I_n = e^{-1} \int_0^1 x^n e^x dx \quad (4)$$

- $n = 0$ :  $I_0 = e^{-1} \int_0^1 e^x dx = e^{-1}(e^1 - 1).$
- integrando per parti

$$\begin{aligned} I_{n+1} &= e^{-1} \left( x^{n+1} e^x \Big|_0^1 - (n+1) \int_0^1 x^n e^x dx \right) \\ &= 1 - (n+1) I_n. \end{aligned}$$

- $I_n > 0$ , decrescente e si prova che  $I_n \rightarrow 0$  come  $1/n$ .

# Problema.

Calcoliamo  $I_n$  per  $n = 1, \dots, 99$ :

- mediante la successione *in avanti*

$$\begin{cases} I_0 = e^{-1}(e^1 - 1) \\ I_{n+1} = 1 - (n + 1)I_n. \end{cases} \quad (5)$$

- mediante la successione *all'indietro*

$$\begin{cases} t_{1000} = 0 \\ t_{n-1} = (1 - t_n)/n. \end{cases}$$

Si noti che se  $I_{n+1} = 1 - (n + 1)I_n$  allora  $I_n = (1 - I_{n+1})/(n + 1)$  e quindi  $I_{n-1} = (1 - I_n)/n$ .

# Successione ricorrente in Matlab

Scriviamo il codice in un file `succricorrente.m`.

```
% SUCCESSIONE RICORRENTE.  
clear all;  
% SUCCESSIONE "s_n".  
s(1)=exp(-1);  
for n=1:99  
    s(n+1)=1-(n+1)*s(n);  
end  
% SUCCESSIONE "t_n".  
M=1000;  
t=zeros(M,1); % INIZIALIZZAZIONE "t".  
for n=M:-1:2  
    j=n-1;  
    t(j)=(1-t(n))/n;  
end
```

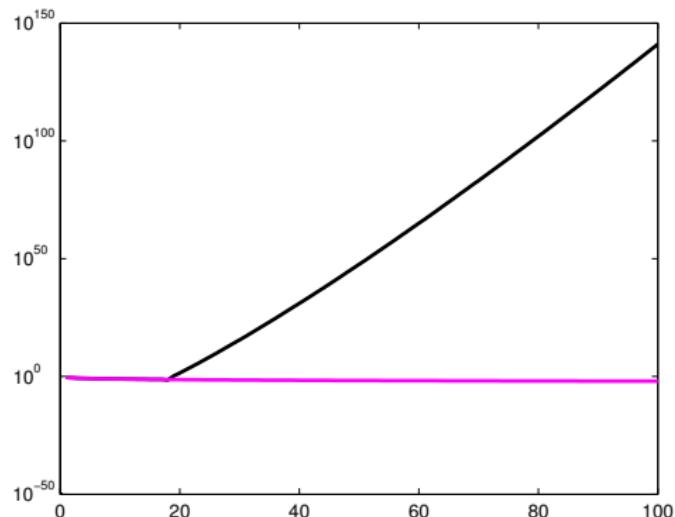
# Successione ricorrente in Matlab

```
% PLOT SEMI-LOGARITMICO.  
clf;  
hold on;  
semilogy(1:length(s),abs(s),'k-');  
semilogy(1:length(s),abs(t(1:length(s))), 'm-');  
hold off;
```

Di seguito digitiamo sulla shell di Matlab/Octave

```
|>> succricorrente
```

# Plot risultati



**Figura :** Grafico che illustra i valori assoluti assunti dalla successione in avanti (in nero) e all'indietro (in rosa magenta).

# Instabilità della formula ricorsiva

La formula  $I_n = 1 - n I_{n-1}$  è instabile, quindi amplifica l'errore ad ogni passo.

Infatti, nel calcolatore

$$(I_n + \varepsilon_n) = 1 - n(I_{n-1} + \varepsilon_{n-1}).$$

Sottraendo dalla precedente equazione la relazione  $I_n = 1 - nI_{n-1}$  si può quantificare l'errore:

$$\varepsilon_n = -n \varepsilon_{n-1}, \quad \text{e per induzione} \quad |\varepsilon_n| = n! |\varepsilon_0|$$

Il fattore  $n!$  amplifica l'errore di rappresentazione iniziale (su  $I_0$ ),  $\varepsilon_0$ .

- **Esempio.** Nel calcolo di  $I_{20}$  l'errore è  $\varepsilon_{20} = 20! \varepsilon_0 \approx 2.7 \cdot 10^2$ .

# Formula alternativa stabile

La formula all'indietro smorza l'errore

Per l'errore al passo  $n - 1$  si trova

$$\varepsilon_{n-1} = \frac{-1}{n} \varepsilon_n.$$

Partendo da  $m$

$$|\varepsilon_{m-1}| = \frac{|\varepsilon_m|}{m}, \quad |\varepsilon_{m-2}| = \frac{|\varepsilon_m|}{m(m-1)}, \dots, |\varepsilon_{m-k}| = \frac{|\varepsilon_m|}{m(m-1) \cdots (m-k+1)}.$$

- La produzione al denominatore abbatta rapidamente l'errore iniziale!
- Per esempio, per calcolare  $I_{25}$  partendo da  $I_{40} = 0.5$ , l'errore iniziale  $|\varepsilon_{40}| < 0.5$  verrebbe abbattuto di un fattore

$$40 \cdot 39 \cdots 27 \cdot 26 = 5.2602 \cdot 10^{22}$$

## Complessità : potenza di matrice.

Problema: calcolare la potenza  $p$ -esima di una matrice quadrata  $A$  di ordine  $n$  cioè

$$A^p := \underbrace{A * \dots * A}_{p \text{ volte}}$$

senza usare l'operatore di elevamento a potenza  $\wedge$ .

**Primo algoritmo.** Si può implementare il seguente pseudocodice

```
B=I ;  
for i=1:p  
    B=B*A ;  
end
```

in cui  $I$  è la matrice identica di ordine  $n$  e  $*$  è il classico prodotto tra matrici.

## Complessità : potenza di matrice.

**Secondo algoritmo.** Alternativamente (in maniera più stabile ed efficiente) si può decomporre  $p$  come

$$p = \sum_{i=0}^M c_i 2^i$$

ove  $M = \lfloor \log_2 p \rfloor$  e  $c_i = 0$  oppure  $c_i = 1$ . Si osserva facilmente che questa è la classica rappresentazione di  $p$  in base 2. Usando la proprietà della potenze

$$\begin{aligned} B &= A^p = A^{\sum_{i=0}^M c_i 2^i} = A^{\sum_{i=0}^M 2^i c_i} \\ &= (A^{2^0})^{c_0} * \dots * (A^{2^M})^{c_M} = \prod_{i=0}^M (A^{2^i})^{c_i} \end{aligned} \quad (6)$$

ove ogni termine  $A^{2^i}$  può essere calcolato come  $A^{2^{i-1}} A^{2^{i-1}}$ .

## Complessità : potenza di matrice.

Confrontiamo i due metodi per  $p = 6$ . Nel primo si calcola  $A^6$  come

$$A^6 = A * A * A * A * A * A$$

e quindi sono necessari 5 prodotti tra matrici. Nel secondo caso essendo  $6 = 0 * 2^0 + 1 * 2^1 + 1 * 2^2$  si ha

$$A^6 = (A^2) * (A^4).$$

Calcolati  $A^2 = A * A$  ed in seguito  $A^4 = (A^2) * (A^2)$ , abbiamo finalmente  $A^6$  con solo 3 prodotti tra matrici ma con lo storage addizionale di alcune matrici in memoria.

## Complessità : potenza di matrice.

Un codice che produce la decomposizione in potenze di 2 di un numero  $p$  è il seguente:

```
q=p;
M=floor(log2(p))+1;
c=[];
for i=1:1:M
    c(i)=mod(q,2);
    q=floor(q/2);
end
```

## Complessità : potenza di matrice.

Uno pseudocodice che implementa il secondo algoritmo è

```
p=100; n=200;
c=trasforma_in_binario(p);
A=rand(n);
B=eye(n);
C=A;
M=floor(log2(p));
% B contiene la potenza di A finora calcolata.
% C contiene la potenza A^(2^index)) finora calcolata.
for index=0:M
    j=index+1;
    if c(j) == 1
        B=B*C;
    end
    C=C*C;
end
```

# Complessità : potenza di matrice.

## Esercizio 1

*Si implementino i due algoritmi proposti per il calcolo della potenza di matrice tramite due functions (senza usare l'operatore  $\wedge$ ) e si calcoli l'errore relativo in norma infinito rispetto all'elevamento a potenza di MATLAB/OCTAVE per diverse matrici e potenze ( $n = 25, 50$  e  $p = 20, 40$ ).*

## Esercizio 2

*Si confrontino poi i tempi di esecuzione delle due functions per il calcolo di  $A^{100}$ , con  $A$  matrice di numeri casuali di dimensione  $200 \times 200$ .*

# Norme matriciali

- Nell'introduzione a MATLAB/OCTAVE abbiamo visto che il comando `norm(v)` calcola la norma del vettore  $v$ .
- Analogamente, per calcolare in MATLAB/OCTAVE la norma di una matrice  $A$  si usa il comando `norm(A)`.
- Se nessun ulteriore parametro viene specificato tale comando restituisce la norma 2 della matrice ovvero:

$$\|A\|_2 = \sqrt{\rho(A^T A)}$$

dove  $\rho(A)$  è il raggio spettrale della matrice  $A$ . Altre possibilità sono:

- norma 1  
 $\|A\|_1 = \max_j \sum_{i=1}^n |a_{ij}|$ , in MATLAB/OCTAVE `norm(A,1)`;
- norma infinito  
 $\|A\|_\infty = \max_i \sum_{j=1}^n |a_{ij}|$ , in MATLAB/OCTAVE `norm(A,inf)`;
- norma di Frobenius  
 $\|A\|_F = \sqrt{\sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^n |a_{ij}|^2}$ , in MATLAB/OCTAVE `norm(A,'fro')`;

# Norme matriciali

## Esempi

```
>>> A = [5 -4 2; 1 7 -6; 1 1 9]
A =
      5    -4     2
      1     7    -6
      1     1     9

>>> norm(A,1)
ans = 17

>>> norm(A,inf)
ans = 14

>>> norm(A,'fro')
ans = 14.6287388383278

>>> norm(A)
ans = 12.0560586095913
```

# Come misurare la durata di un programma

- Per confrontare due programmi che risolvono lo stesso problema è utile misurare il tempo di CPU (wallclock time) impiegato per eseguirli.
- In MATLAB/OCTAVE questo tempo si misura in secondi con il comando: `cputime`.

Esempio:

```
>> A = rand(5000);  
t = cputime;  
det(A);  
tfin=cputime;  
cpu=tfin-t  
  
>> cpu = 32.500
```

## Facoltativo. Complessità : algoritmo di Horner.

Ci poniamo il problema di valutare il polinomio

$$p(x) = a_0 + a_1 \cdot x + \dots + a_n \cdot x^n \quad (7)$$

in un punto  $x$ .

Osserviamo che

$$p(x) = a_0 + x \cdot (a_1 + x \cdot (a_2 + \dots + x \cdot (a_{n-1} + x \cdot a_n))) \quad (8)$$

Supponiamo sia  $a = (a_0, \dots, a_n)$  il vettore di dimensione  $n+1$  delle componenti del polinomio. Possiamo valutare il polinomio tramite i seguenti due algoritmi, il primo che valuta direttamente il polinomio secondo quanto descritto in (7), il secondo che effettua la stessa operazione come descritto in (8) calcolando dapprima  $s_1 = a_{n-1} + x \cdot a_n$ , poi  $s_2 = a_{n-2} + x \cdot s_1$  e così via.

# Complessità : algoritmo di Horner.

In Matlab avremo allora

```
function s=algoritmo1(a,x)
xk=1; s=a(1);
for i=2:length(a)
    xk=xk*x;
    s=s+a(i)*xk;
end
```

e

```
function s=algoritmo2(a,x)
L=length(a);
s=a(L); % COMPONENTE a_n IMMAGAZZINATA IN a(n+1).
for i=L-1:-1:1
    s=a(i)+x*s;
end
```

## Complessità : algoritmo di Horner.

Se lanciamo il codice `demo_horner` per la valutazione di  $p(x) = 1 + 2 \cdot x + 3 \cdot x^2 + 4 \cdot x^3$  in  $x = \pi$

```
clear all;
a=[1 2 3 4];
x=pi;
y1=algoritmo1(a,x);
y2=algoritmo2(a,x);
format long;
y1
y2
```

otteniamo

```
>> demo_horner
ans = 1.609171052316469e+02
y1 = 1.609171052316469e+02
y2 = 1.609171052316469e+02
>>
```

## Complessità : algoritmo di Horner.

La differenza sta nella complessità computazionale e non nel risultato numerico. Il primo codice richiede  $2n$  moltiplicazioni e  $n$  somme, mentre il secondo algoritmo  $n$  moltiplicazioni e  $n$  somme.