



Università degli studi Milano Bicocca - Dipartimento di Fisica

Esperimentazioni di Fisica Computazionale

S. Franceschina

June 5, 2025

Abstract

Contents

1	Analisi dell'errore	2
1.1	Teoria	2
1.2	Esercizio 1.0.1	2
1.2.1	Soluzione	2
1.3	Esercizio 1.2.1	2
1.3.1	Soluzione	3
1.4	Esercizio 1.4.1	5
1.4.1	Soluzione	6
2	Sistemi lineari	6
2.1	Teoria	6
3	Radici di equazioni non lineari	6
3.1	Teoria	6
4	Interpolazioni	6
4.1	Teoria	6
5	Integrazione numerica	6
5.1	Teoria	6
6	Equazioni differenziali ordinarie	6
6.1	Teoria	6

1 Analisi dell'errore

1.1 Teoria

Nella presente sezione analizziamo le due principali fonti di errore in contesti computazionali:

1. Errori di arrotondamento: dovuti alla rappresentazione di numeri reali con numero finito di digits.
2. Errori di approssimazione: dovuti alla modalità stessa con cui affrontiamo il problema, per questo motivo sono presenti anche nel caso ideale.

1.2 Esercizio 1.0.1

Considera la funzione $f(x) = e^x$ nell'intervallo $x \in [0, 1]$. Scrivi un programma che calcoli la serie approssimante:

$$g_N(x) = \sum_{n=0}^N \frac{x^n}{n!}. \quad (1)$$

1. Verifica che l'errore assoluto $\Delta = |f(x) - g_N(x)|$ scala approssimativamente come $x^{N+1}/(N+1)!$ per $N = 1, 2, 3, 4$.
2. L'errore Δ , nell'intervallo dato di x , differisce da $x^{N+1}/(N+1)!$. Perché accade questo e per quali valori di x ?

1.2.1 Soluzione

Al fine dell'esercizio vengono rappresentati nel grafico 1 le funzioni Δ e $\frac{x^{N+1}}{(N+1)!}$, con $N = 1, 2, 3, 4$, al variare di x nell'intervallo $[0, 1]$.

La prima considerazione che possiamo fare è che all'aumentare di N la funzione Δ assume valori sempre più vicini allo zero. Questo significa che la distanza tra il valore della funzione $f(x)$ presa in esame e la sua espansione di Taylor troncata all'ordine N diminuisce. In effetti ci aspettiamo che la funzione Δ sia esattamente zero nel caso in cui $N \rightarrow \infty$. Inoltre possiamo notare che la funzione Δ , in ognuno dei grafici, è tanto più prossima allo zero quanto più ci si avvicina all'origine, poichè l'espansione in serie richiede $x \rightarrow 0$.

La seconda considerazione è che le funzioni Δ e $\frac{x^{N+1}}{(N+1)!}$ si avvicinano tra loro all'aumentare di N . Questo risponde alla richiesta dell'esercizio, cioè che l'errore scali come un polinomio di ordine $N + 1$.

1.3 Esercizio 1.2.1

Calcolare la seguente somma

$$\sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n^2} = \frac{\pi^2}{6} = \lim_{N \rightarrow \infty} S(N) \quad \text{con} \quad S(N) = \sum_{n=1}^N \frac{1}{n^2} \quad (2)$$

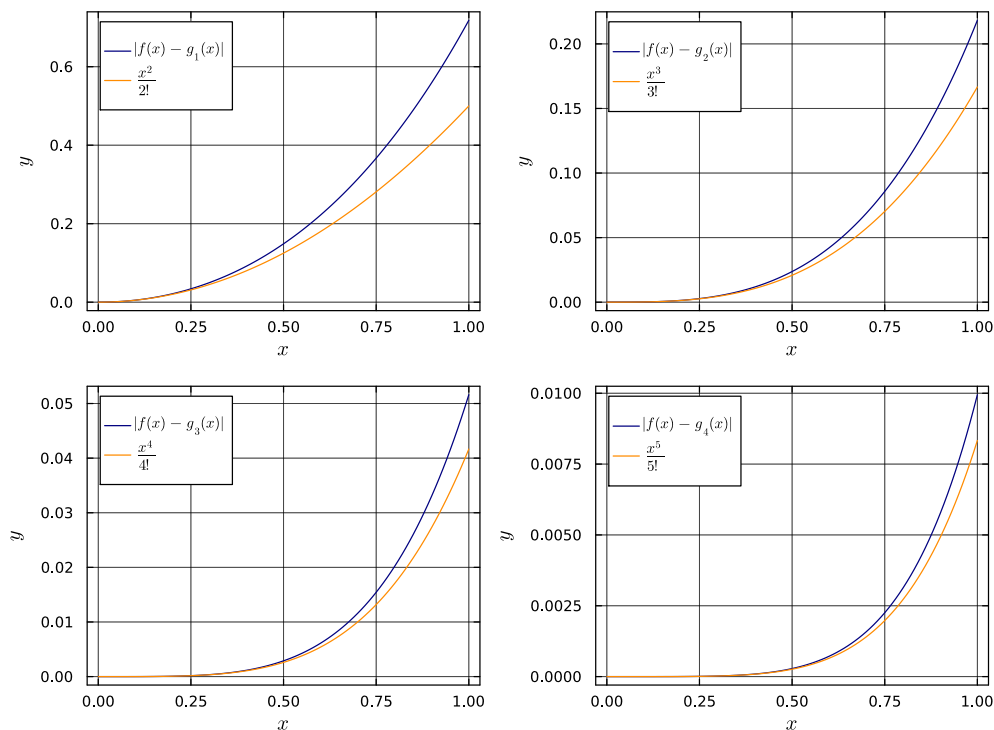


Figure 1: Confronto tra Δ e $\frac{x^{N+1}}{(N+1)!}$ per $N = 1, 2, 3, 4$.

1. Calcolare la somma in single precision utilizzando l'ordinamento normale, $n = 1, 2, 3, \dots, N$.
2. Calcolare la somma in single precision utilizzando l'ordinamento inverso, $n = N, \dots, 2, 1$.
3. Studiare la convergenza di entrambe le implementazioni in funzione di N tracciando il grafico di $|S(N) - \pi^2/6|$.
4. Ripetere i punti da 1 a 3 utilizzando double precision.
5. Sai spiegare cosa succede?

1.3.1 Soluzione

Procediamo prendendo in esame i due casi, single precision e double precision.

Single precision: Si riportano in figura 2 gli errori di troncamento della serie $\sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n^2}$, laddove N è il troncamento. Le somme sono state eseguite con variabili di tipo Float32 (single precision).

In figura 2 notiamo due comportamenti degni di nota. Il primo riguarda la curva blu, che arresta la sua discesa poco dopo $N = 4000$. Il secondo riguarda il discostarsi delle due curve, già a partire da $N \simeq 2000$, a causa dell'andamento a linea spezzata della curva blu.

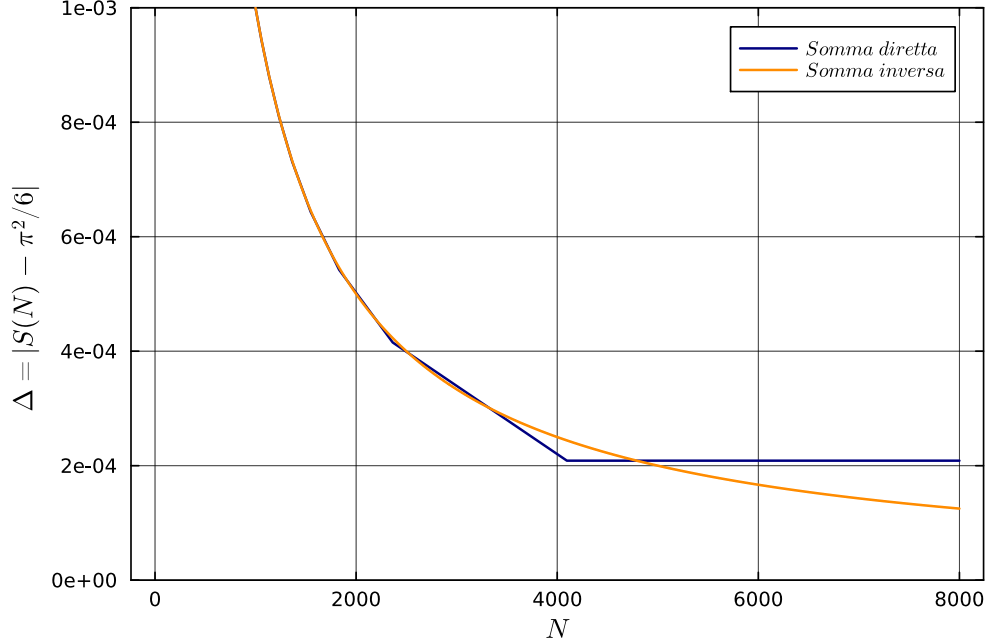


Figure 2: $S(N) = \sum_{n=1}^N \frac{1}{n^2}$ in single precision

La spiegazione del primo fenomeno è la seguente: nel caso della somma con ordinamento diretto, all'aumento dell'indice di somma, gli addendi sono sempre più piccoli. In particolare la somma comincia da 1, e sappiamo che dovrà raggiungere $\frac{\pi^2}{6} \simeq 1.64$ e perciò per tutto il processo la somma parziale resterà nell'intervallo $[1, 2)$. In tale intervallo la distanza tra due floating point numbers è $\epsilon_{mach} = 2^{-23}$. Osserviamo il grafico 2: la curva blu comincia ad essere costante a partire da $N = 4096 = 2^{12}$. Tale numero corrisponde all'addendo $\frac{1}{N^2} = 2^{-24}$, che è appena più piccolo di ϵ_{mach} , ovvero della distanza tra due floating point numbers in $[1, 2)$, e quindi è come sommare 0.

La spiegazione del secondo fenomeno è simile: in questo caso alla somma viene aggiunto un addendo che è più piccolo del precedente, ma non così tanto da essere più piccolo di ϵ_{mach} . In questo modo la somma viene migliorata, ma il nuovo addendo è arrotondato rispetto al suo valore vero. Il successivo addendo, pur essendo differente in teoria, a causa dell'arrotondamento risulta essere uguale al precedente. Ciò fa in modo che venga sommato sempre lo stesso numero, e così l'andamento della curva blu è lineare.

I due fenomeni non si verificano per la somma con ordinamento inverso perchè il primo numero ad essere sommato è molto piccolo. Questo fa in modo che i successivi floating point number siano molto vicini tra loro, è così sommare l'addendo successivo fa cadere la somma parziale vicina al floating point number che la approssima.

Si può mostrare matematicamente che gli errori $\Delta = |S(N) - \pi^2/6|$ scalano come $O(\frac{1}{N})$. Per verificare questa affermazione possiamo interpolare la curva degli errori con un metodo che vedremo nella sezione 2. Sulla base delle considerazioni di questa sezione, possiamo aspettarci che sia più conveniente interpolare la curva con ordinamento inverso, perchè i valori che la compongono sono meno affetti da errori di tipo numerico. Utilizzando il modello lin-

earizzato $\log(\Delta) = -c * \log(N)$ con $c = 1$ si ottiene per l'ordinamento inverso $c_{fit} = 1.00003$ e per quello diretto $c_{fit} = 0.986$. Come atteso il caso di ordinamento diretto restituisce un risultato peggiore di quello inverso.

Double precision: Si riporta in figura 3 un ingrandimento del grafico degli errori di troncamento della serie $\sum_{n=1}^{\infty} \frac{1}{n^2}$, laddove N è il troncamento. La somme sono state eseguite con variabili di tipo Float64 (double precision).

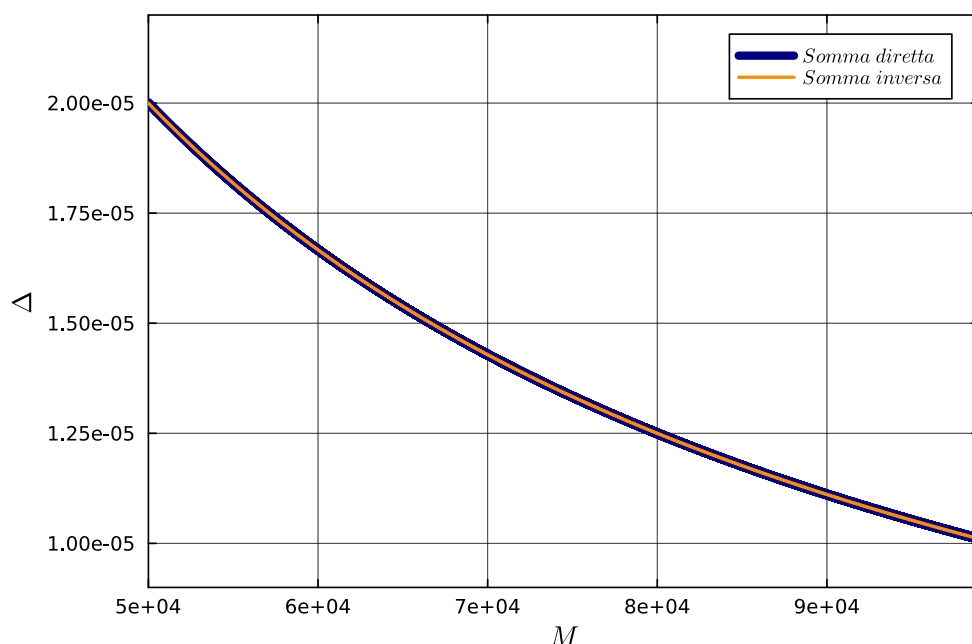


Figure 3: Ingrandimento di $S(N) = \sum_{n=1}^N \frac{1}{n^2}$ in double precision

Nel caso di figura 3 possiamo notare che le due curve sono sovrapposte, nonostante l'ingrandimento a valori di $N \in [5000, 10000]$. Per osservare un fenomeno simile a quello di figura 2 dovremmo raggiungere valori di $N = 2^{26}$. Infatti l'approssimazione non migliora quando vengono sommati numeri dell'ordine di ϵ_{mach} per double precision, cioè $\frac{1}{N^2} \simeq 2^{-52}$.

1.4 Esercizio 1.4.1

(a) In statistics, we define the variance of a sample of values x_1, \dots, x_n by

$$\sigma^2 = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2, \quad \bar{x} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i. \quad (3)$$

Write a function that takes as input a vector x of any length and returns σ^2 as calculated by the formula. You should test your function with $x = [1, 1, \dots, 1]$ and some random vectors.

(b) One drawback of the naive formula is that you must first compute a sum for \bar{x} before performing the sum to compute σ^2 . This means that we have to pass twice through the

data. This is undesirable for large data sets or when the sample variance is to be computed as the data is generated. Some textbooks quote a single-loop formula:

$$\sigma^2 = \frac{1}{n-1} \left(u - \frac{1}{n} v^2 \right), u = \sum_{i=1}^n x_i^2, \quad v = \sum_{i=1}^n x_i. \quad (4)$$

Try both formulas for the datasets below, each of which has a variance exactly equal to

1. Do this in both single and double precision.

$x = [1e3, 1+1e3, 2+1e3]$ $x = [1e6, 1+1e6, 2+1e6]$ $x = [1e7, 1+1e7, 2+1e7]$ $x = [1e8, 1+1e8, 2+1e8]$

Can you explain the results?

1.4.1 Soluzione

2 Sistemi lineari

2.1 Teoria

3 Radici di equazioni non lineari

3.1 Teoria

4 Interpolazioni

4.1 Teoria

5 Integrazione numerica

5.1 Teoria

6 Equazioni differenziali ordinarie

6.1 Teoria