

FUNDAÇÃO GETÚLIO VARGAS

MODELAGEM MATEMÁTICA

1

Feito por:
Guilherme Horta



Contents

1	Introdução	2
1.1	O bitcoin	2
1.2	Introdução a Agda	3
1.3	UTXO Bitcoin	4
1.4	Blockchain em Agda	5
2	Metodologia	6
3	Agradecimento	7

1 Introdução

O bitcoin foi a primeira criptomoeda criada em 2008 por Satoshi Nakamoto em sua publicação Bitcoin WhitePaper.

Desde Novembro de 2008, o valor de mercado mundial do bitcoin chegou a 330 bilhões de dólares (em 17 de dezembro de 2018). O preço do bitcoin chegou a ter seu recorde histórico por volta de 20 mil dólares. Outras cripto-moedas como Ethereum e Monero também foram criadas e elas também possuem um bom valor de mercado. Cripto-moedas se tornaram instrumentos financeiros e serão as principais moedas em um futuro próximo.

Cripto-moedas também são utilizadas por contratos inteligentes. Por exemplo, seria o comprador reservar uma parte do dinheiro para o vendedor na blockchain. Para o dinheiro ser liberado, o vendedor deve receber a assinatura do comprador. O comprador irá fornecer a assinatura se receber o produto. Se o produto não chegar a tempo, o comprador recebe seu dinheiro de volta. Contratos inteligentes são utilizados hoje em dia por grandes fundos, no qual as relações de contratos são integralmente governada por algoritmos (sem nenhuma interferência governamental).

1.1 O bitcoin

Já que cripto-moedas são governadas integralmente por algoritmos. Precisamos garantir que esses algoritmos estejam corretos, uma vez que em caso de falha, não existe nada que se possa fazer. Por exemplo, o bitcoin pode ficar preso em algum contrato e não seria possível usá-lo novamente. O único jeito de resolver problemas é criando um consenso entre usuários e mineradores, a partir de um soft fork (atualização retro compatível) ou um hard fork (atualização não retrocompatível). A possibilidade de erro é um dos maiores riscos às cripto-moedas. Por exemplo, no protocolo inicial do bitcoin, a unicidade dos IDs das transações não era garantida. Com isso, era possível que houvesse ataques de gasto duplo. Isso pôde ser evitado incluindo o número do bloco na transação (foi feito em um soft fork). Outro problema do bitcoin é que o tamanho do bloco do bitcoin não é suficiente para cobrir todas as transações. Para resolver isso, foi criada a Lightning Network, que é um protocolo de segunda camada do bitcoin.

Por isso, é importante a verificação completa dos protocolos criptográficos. Um alto nível de verificação pode ser encontrado criando um método formal para cripto-moedas e provando que ele está correto. Métodos formais são análises matemáticas para verificar se o software comporta conforme o esperado. Ainda não foi criado nenhum método completamente formal para a formalização de alguma cripto-moeda.

O crescimento de contratos inteligentes criou alguns problemas em relação a segurança de instrumentos financeiros. O maior incidente foi a falha do cripto-contrato DAO. Quando o DAO chegou a um valor de 150 milhões de dólares, um usuário usou uma vulnerabilidade para hackear o contrato. A perda do dinheiro dos investidores foi somente evitada por causa de um hard fork na rede ethereum, que apagou a maioria das transações investidas no DAO. Esse hard fork violou o princípio de que o dinheiro dos usuários em cripto-moedas devem ser apenas governados por algoritmos, sem nenhuma interferência humana. Por isso, existe a necessidade de provas formais, que garantem sua correção do software.

1.2 Introdução a Agda

Para garantir a correção de um programa, precisamos de demonstrações formais ou técnicas de model checking. Idealmente, deveria ser capazes de especificar e programar em uma mesma linguagem. Agda é uma linguagem que permite isso.

Agda é um provador de teoremas baseado na teoria de tipos de Martin-Lof. Ele está muito relacionado ao provador de teoremas Coq. Além do mais, Agda é uma linguagem total, o que é garantido que ela sempre termina (não existe loop infinito). Sem isso, Agda seria uma linguagem inconsistente. Agda já está em sua segunda versão. Ela foi criada na tese de doutorado de Ulf Norell. Depois disso, ela foi aprimorada por sua comunidade.

Para definir-se booleans em Agda:

```
data Bool : Set where
  false : Bool
  true  : Bool
```

Para definir os números naturais de acordo com os axiomas de peano, usa-se:

```
data ℕ : Set where
  zero : ℕ
  suc  : ℕ → ℕ
```

No caso dos naturais, existe uma função sucessor. Para cada número natural, essa função retorna outro número natural.

Para definir-se soma, usa-se a definição recursiva

```
_+_ : ℕ → ℕ → ℕ
zero + n = n
suc m + n = suc (m + n)
```

Em uma lista, existem dois construtores. Um que fornece a lista vazia e outro, que dado um elemento e outra lista, ele fornece uma nova lista.

```
data List (A : Set) : Set where
  [] : List A
  _::_ : A → List A → List A
```

Para descobrir o tamanho da lista:

```
length : {A : Set} → List A → ℕ
length [] = 0
length (x :: xs) = suc (length xs)
```

Um tipo é dependente se ele depende de algum valor. Um exemplo disso é um vetor indexado de seu tamanho:

```
data Vec (A : Set) : ℕ → Set where
  [] : Vec A 0
  _::_ : ∀ {n} → A → Vec A n → Vec A (suc n)
```

Nesse caso, $\text{Vec } A \ n$ é um vetor de elementos do tipo A com n elementos.

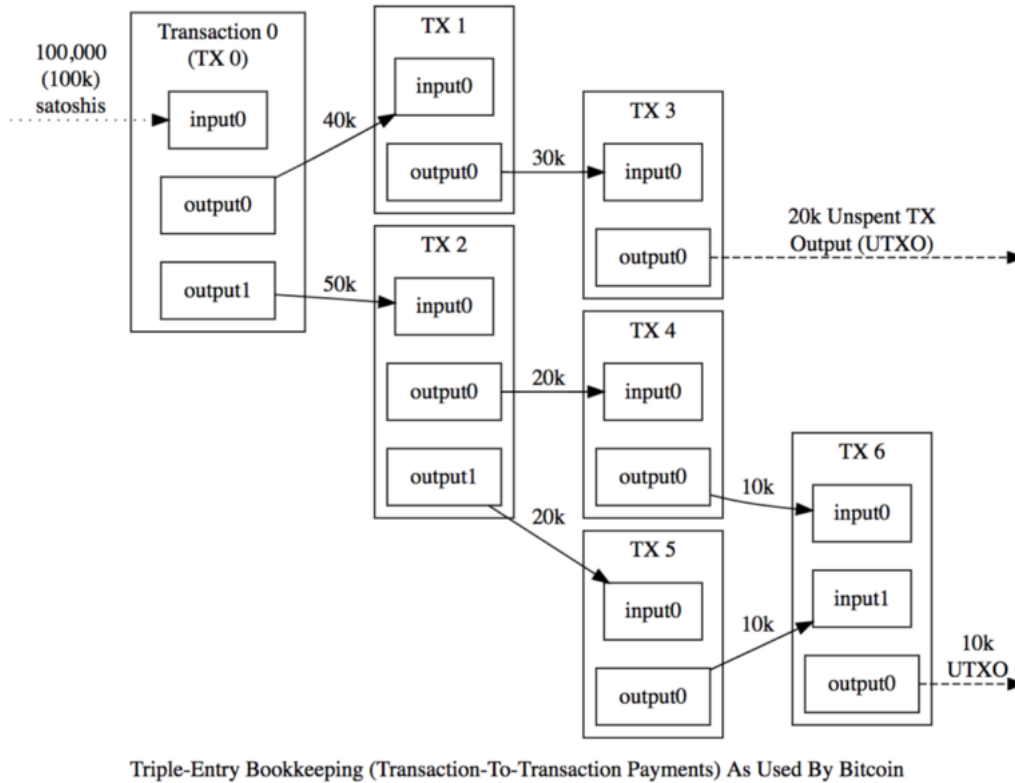
Uma vantagem de usar este tipo de vetor, é que é possível criar uma função que retorna o primeiro elemento desse vetor de forma segura.

```
head : ∀ {A : Set} {n : ℕ} → Vec A (suc n) → A
head (x :: xs) = x
```

1.3 UTXO Bitcoin

Uma das características que diferencia o Bitcoin de outras criptomoedas (como o Ethereum) e outros bancos é a sua estrutura de dados de transação. Em um banco, o saldo dessa conta é armazenado em uma linha do banco de dados. Para o bitcoin, isso não existe. O que está armazenado na blockchain são apenas as transações. No bitcoin, existe a transação não gasta, cujo termo é UTXO (unspent transaction output).

No bitcoin, cada transação possui várias entradas e saídas. As entradas são todas as transações não gastas do usuário e a saída são todas as contas receberão a transação mais uma transação não gasta. Como pode ser visto nessa figura:



Triple-Entry Bookkeeping (Transaction-To-Transaction Payments) As Used By Bitcoin

Existem várias vantagens e desvantagens desse tipo de estrutura de dados. Uma das desvantagens é que é bastante custoso verificar o saldo da conta, pois é necessário calcular todas as transações vinculadas a conta. Outra desvantagem é que esse modelo é mais complexo que o modelo bancário.

Já suas vantagens são outras. Esse tipo de estrutura de dados permite escalabilidade, pois o paralelismo é permitido. Já que uma mesma conta pode por exemplo gastar várias transações não gastas ao mesmo tempo. Outra vantagem seria a privacidade, pois um mesmo usuário pode criar uma conta nova por transação.

No paper de Anton Setzer, a modelagem da estrutura de dados do UTXO está quase terminada.

1.4 Blockchain em Agda

A estrutura de dados blockchain significa cadeia de blocos. Existem dois tipos de blocos, o primeiro bloco (genesis block) e os outros. Cada bloco, possui uma ligação para o bloco anterior (exceto o primeiro). Essa ligação é o hash (identificador único

de algum elemento) do bloco anterior. Dessa forma, é possível sempre garantir a ordem dos blocos. Cada bloco armazena transações, o hash do bloco anterior, o nonce e o seu próprio hash. Cada bloco precisa ser minerado, ou seja, o minerador precisa calcular o valor do nonce (que necessita muito poder computacional).

Dessa forma, no código de Agda, foi adicionada a especificação de que o bloco deve conter o hash do bloco anterior e a especificação do hash do bloco, usando tipos dependentes.

```

data GenesisBlock : ℕ → Set where
  block : (n : ℕ) → (sb : SimpleBlock) → n ≡ hashBlock sb → GenesisBlock n

data Block : ℕ → ℕ → Set where
  block : (n : ℕ) → (m : ℕ) → (sb : SimpleBlock) → m ≡ hashBlock sb → Block n m

data Blockchain : ℕ → Set where
  gen : {n : ℕ} → GenesisBlock n → Blockchain n
  cons : {n m : ℕ} → Block n m → Blockchain n → Blockchain m

```

2 Metodologia

O trabalho está sendo programado na linguagem Agda, provador de teoremas.

Para controle de versão, é utilizado o Git com Github. Com o Github, é possível fazer integração contínua com Travis CI ou Hydra. Ou seja, a cada novo commit, é instanciada uma máquina virtual para compilar o projeto todo.

O gerenciador de pacotes utilizado é o Nix, que é um gerenciador de pacotes funcional. Ou seja, é feito de forma descritiva como será compilado o projeto.

Para compilação dos slides e da dissertação é utilizado Latex e latexmk e todo o resto acima. Todo código colocado nos slides e na dissertação são compilados antes. Dessa forma, não existe perigo de haver algum código que não funcione.

O trabalho será feito usando a metodologia do livro Type Driven Development. Ou seja, enquanto a criptomoeda for programada, o seu tipo será refinado conforme às necessidades. Caso algo ainda não seja provado com os tipos, uma prova formal será adicionada posteriormente.

3 Agradecimento

Agradeço o professor Flávio por me auxiliar em todas as minhas dúvidas sobre bitcoin e me ajudar na escrita da minha dissertação.

References

- [1] Andreas Abel, *Stephan Adelsberger, and Anton Setzer*. *ooAgda. Agda Library, 2016*. <https://github.com/agda/ooAgda>
- [2] Andreas Abel, *Stephan Adelsberger, and Anton Setzer*. *ooAgda. Agda Library, 2016*. <https://github.com/agda/ooAgda>
- [3] Agda Wiki. *The Agda Wiki, 2017*. <http://wiki.portal.chalmers.se/agda/pmwiki.php>
- [4] Satoshi Nakamoto. *Bitcoin: A peer-to-peer electronic cash system, 1 November 2008. Announced on the cryptography mailing list*. <http://www.bitcoin.org/bitcoin.pdf>
- [5] Satoshi Nakamoto. *Satoshi Nakamoto. Bitcoin: A peer-to-peer electronic cash system, 1 November 2008. Announced on the cryptography mailing list*. <http://www.bitcoin.org/bitcoin.pdf>
- [6] Anton Setzer. *ept. of Computer Science, Swansea University, Singleton Park, Swansea SA28PP, UK*