



KTH Engineering Sciences

Föreläsning 1

Fel- och störningsanalys

1 Terminologi

Antag att x är ett exakt värde och $\tilde{x}$ är en approximation av x . Vi kallar då

$$\text{absoluta felet i } \tilde{x} = \tilde{x} - x, \quad \text{relativa felet i } \tilde{x} = \frac{\tilde{x} - x}{x}.$$

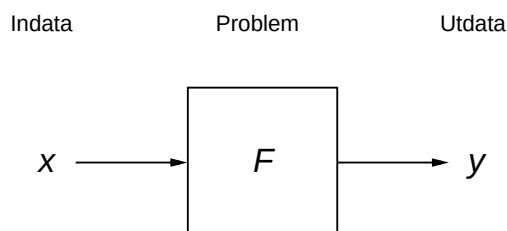
Ofta känner vi inte felet precis utan vet bara att det är mindre än en *felgräns*. Felgränsen kan vara antingen absolut, betecknad E_x , eller relativ, betecknad R_x , och innebär att

$$|\tilde{x} - x| \leq E_x, \quad \left| \frac{\tilde{x} - x}{x} \right| \leq R_x.$$

Om $\tilde{x}$ ges som ett korrekt avrundat decimaltal utskrivet med n siffror (på endera sidan av decimalkommat, men inledande nollor räknas inte) säger vi att $\tilde{x}$ har n korrekta, eller *signifikanta*, siffror. Exempelvis har 132,13 fem signifikanta siffror och 0,0311 har tre signifikanta siffror. Begreppet är nära relaterat till det relativa felet.¹

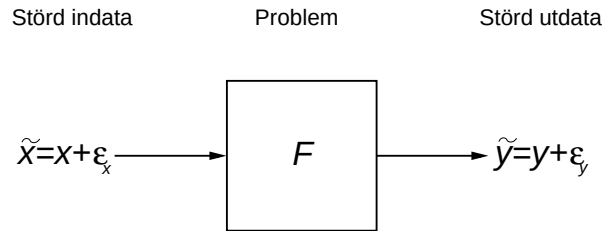
2 Störningsanalys

Indata till ett numeriskt problem innehåller i praktiken alltid (små) fel. Felen kan bero på tex mätfel, avrundningsfel eller pga att indata kommer från andra numeriska beräkningar som innehåller trunkationsfel. En viktig frågeställning är därför hur lösningen till problemet påverkas av dessa fel. Vi kan beskriva situationen såhär:



Här är F en abstrakt formulering av problemet. Det kan tex vara en enkel funktion $y = F(x)$, men i allmänhet är F mer komplicerad än så. Frågan är nu vad som händer med utdata y om vi stör indata x med ett litet fel ε_x . Istället för x skickar vi in $\tilde{x} = x + \varepsilon_x$ och istället för y får vi ut $\tilde{y} = y + \varepsilon_y$. Hur beror då ε_y på ε_x ?

¹Genom att skriva om talet och felgränsen i normalform, tex $x = 0.00311 \pm 0.000005 = 3.11 \times 10^{-3} \pm 0.5 \times 10^{-5}$, kan man se att om talet har n signifikanta siffror måste relativa felet ligga mellan 0.5×10^{-n} och 5×10^{-n} . Vill man vara precis är det bättre att ange relativt fel än antal signifikanta siffror.



Felet i utdata ε_y kallas ibland "forward error", eftersom det motsvarar felet som propagerar framåt från indata till utdata. På motsvarande sätt kallas felet i indata ε_x ibland "backward error". Då tänker man sig att detta är felet som måste läggas på indata för att skapa ett givet fel i utdata.

2.1 F känd funktion

Om F är en känd, snäll funktion kan vi analysera "felfortplantningen" från indata till utdata med hjälp av lokal linjärisering runt $\tilde{x}$. I detta fall är $y = F(x)$ och $\tilde{y} = F(\tilde{x})$. Via Taylorutvecklingen

$$F(x) = F(\tilde{x} - \varepsilon_x) \approx F(\tilde{x}) - \varepsilon_x F'(\tilde{x})$$

får vi

$$\varepsilon_y = \tilde{y} - y = F(\tilde{x}) - F(x) \approx \varepsilon_x F'(\tilde{x}) \quad \Rightarrow \quad \boxed{\varepsilon_y \approx \varepsilon_x F'(\tilde{x})}$$

Detta ger direkt motsvarande formel för absoluta felgränserna E_x och E_y ,

$$|\varepsilon_y| \lesssim |\varepsilon_x| |F'(\tilde{x})| \leq E_x |F'(\tilde{x})| \quad \Rightarrow \quad \boxed{E_y \approx E_x |F'(\tilde{x})|}$$

Om F beror på flera variabler,

$$y = F(x_1, x_2, \dots, x_n), \quad \tilde{y} = F(\tilde{x}_1, \tilde{x}_2, \dots, \tilde{x}_n),$$

får man på samma sätt

$$\boxed{\varepsilon_y \approx \varepsilon_{x_1} \frac{\partial F(\tilde{x}_1, \dots, \tilde{x}_n)}{\partial x_1} + \dots + \varepsilon_{x_n} \frac{\partial F(\tilde{x}_1, \dots, \tilde{x}_n)}{\partial x_n},}$$

där ε_{x_j} är felet i x_j , samt

$$\boxed{E_y \approx E_{x_1} \left| \frac{\partial F(\tilde{x}_1, \dots, \tilde{x}_n)}{\partial x_1} \right| + \dots + E_{x_n} \left| \frac{\partial F(\tilde{x}_1, \dots, \tilde{x}_n)}{\partial x_n} \right|},$$

där E_{x_j} är absoluta felgränsen för ε_{x_j} .

Exempel 1: Antag att $F(x) = 1 + \cos x$ och att indata x är given som $x = 0.1 \pm 0.005$. Med terminologin ovan är då $\tilde{x} = 0.1$ och $|\varepsilon_x| \leq 0.005$, dvs $E_x = 0.005$. Beräkna först $\tilde{y}$,

$$\tilde{y} = 1 + \cos(0.1) \approx 0.0499958$$

Enligt formeln ovan blir felgränsen för $\tilde{y}$

$$E_y \approx E_x |F'(\tilde{x})| = 0.005 \cdot \sin(0.1) \approx 0.5 \cdot 10^{-3}.$$

Vi avrundar därför $\tilde{y}$ till tre decimaler och skriver

$$y = 0.050 \pm 0.0005.$$

Exempel 2: Låt x vara exakta roten till ekvationen $f(x) = 0$. Låt $\tilde{x}$ vara en approximation till roten given av Newtons metod med avbrottskriteriet

$$|f(\tilde{x})| \leq \delta,$$

där toleransen δ är ett litet tal. Vi vill beräkna felgränsen i $\tilde{x}$. I detta exempel är $y = f(x) = 0$ och $\tilde{y} = f(\tilde{x})$. Följdaktligen är $|\varepsilon_y| = |\tilde{y} - y| = |f(\tilde{x}) - 0| \leq \delta$, dvs $E_y = \delta$. Formeln för felgränserna ger då

$$E_y \approx E_x |f'(\tilde{x})| \Rightarrow E_x \approx \frac{\delta}{|f'(\tilde{x})|}.$$

Notera att om $f'(\tilde{x})$ är liten kan felet i $\tilde{x}$ vara stort även om toleransen δ är liten. Det är därför normalt svårt att lösa ekvationer med dubbelrötter där $f(x) = f'(x) = 0$.

2.2 Experimentell störningsanalys

I många fall är F inte känd, eller för komplicerad för att kunna deriveras. Det är då svårt att använda analysen ovan. Exempelvis skulle $F(x)$ kunna vara given som lösningen till en ordinär differentialekvation vid en viss tid med begynnelsevärde x :

$$\frac{dy}{dt} = g(y), \quad y(0) = x, \quad F(x) := y(10).$$

I denna situation är det mer praktiskt att använda "experimentell" störningsanalys där $F(x)$ betraktas som en "svart låda". Det enda vi antar är att F är deriverbar.

Vi börjar med att beräkna $\tilde{y}$ från störda indata $\tilde{x}$ som tidigare. Sedan gör vi en "experimenträkning": en beräkning där vi medvetet stör indata ytterligare med värdet på indatafelgränsen E_x . Resultatet kallar vi $\bar{y}$,

$$\tilde{y} = F(\tilde{x}), \quad \bar{y} = F(\tilde{x} + E_x).$$

Skillnaden $|\bar{y} - \tilde{y}|$ är då en bra uppskattning av felgränsen E_y i utdata $\tilde{y}$ eftersom

$$|\bar{y} - \tilde{y}| = |F(\tilde{x} + E_x) - F(\tilde{x})| \approx E_x |F'(\tilde{x})| \approx E_y.$$

När F beror av två variabler stör vi dem en i sänder och beräknar,

$$\bar{y}_1 = F(x_1 + E_{x_1}, x_2), \quad \bar{y}_2 = F(x_1, x_2 + E_{x_2}).$$

Felet i utdata uppskattas med

$$E_y \approx |\tilde{y} - \bar{y}_1| + |\tilde{y} - \bar{y}_2|.$$

Vi gör på liknande sätt när F beror på fler variabler. Se tex ENM uppgift 8.8 för exempel.

3 Kondition och rättställdhet

Om felet i utdata är litet så snart felet i indata är litet brukar man säga att problemet är *vällkonditionerat* eller *stabilt*; små fel i indata "spelar ingen större roll." Om felet i utdata kan bli stort även för relativt små fel i indata säger man att problemet är *illa konditionerat*. Den maximala förstärkningen av fel i indata beskrivs av problemets *konditionstal* κ . Det absoluta konditionstalet är $\kappa_a = \max_{\varepsilon_x} |\varepsilon_y / \varepsilon_x|$ och från beräkningarna ovan framgår att $\kappa_a \approx |F'(x)|$ när F är en känd funktion. Ofta är man mer intresserad av det relativa konditionstalet, definierat som maximala förstärkningen av relativa felet,

$$\kappa_r = \max_{\varepsilon_x} \frac{|\varepsilon_y / y|}{|\varepsilon_x / x|}.$$

När F är en känd funktion har vi då

$$\kappa_r \approx \frac{|\varepsilon_x F'(x)/F(x)|}{|\varepsilon_x/x|} = \frac{|x F'(x)|}{|F(x)|}.$$

Vi har hittills hela tiden antagit att F motsvarar en "snäll" funktion, i själva verket en deriverbar funktion. Om F istället tex är en diskontinuerlig funktion kan ε_y bli stort även för godtyckligt små ε_x . Det betyder att även om vi har mycket små störningar i indata får vi ett utvärde som är helt fel. Formellt blir konditionstalet κ oändligt stort. Sådana problem kallas *icke rättställda* (ill-posed). Omvänt kallas problem där $F(x)$ är kontinuerlig för *rättställda* (well-posed) problem. Det är viktigt att se konsekvensen av icke rättställdhet: Eftersom vi i praktiken alltid har små störningar i indata *kan icke rättställda problem inte lösas med numeriska metoder* även om problemet i teorin har en entydig lösning. Begreppet rättställdhet är därför centralt inom tillämpad matematik. Ett mycket enkelt exempel på ett icke rättställt problem är följande. Lös $f(x) = 0$ när

$$f(x) = \begin{cases} x, & x \neq 0, x \neq 20, \\ 20, & x = 0, \\ 0, & x = 20. \end{cases}$$

Det är uppenbart att lösningen är $x = 20$, men en numerisk metod kommer inte kunna hitta den roten. Den numeriska svårigheten är ganska tydlig i det här enkla fallet. Den kan dock vara betydligt mer subtil i mer komplicerade problem. Speciellt svår är frågan om rättställdhet för partiella differentialekvationer där även till synes enkla ekvationer kan vara icke rättställda. I det fallet är både in- och utdata *funktioner* snarare än skalära tal eller vektorer.