

Über Komplexität mathematischer Probleme: der Solvability Complexity Index

J. Ben-Artzi, A. C. Hansen, O. Nevanlinna, M. Seidel

Workshop Mathematik in Forschung und Lehre

September, 2016

Betr. stetige lineare Abbildungen auf $l^2 = l^2(\mathbb{N}, \mathbb{C})$

$$A = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} & \cdots \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} & \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} & \\ \vdots & & & \ddots \end{pmatrix} \in \mathcal{L}(l^2)$$



Betr. stetige lineare Abbildungen auf $l^2 = l^2(\mathbb{N}, \mathbb{C})$

$$A = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} & \cdots \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} & \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} & \\ \vdots & & & \ddots \end{pmatrix} \in \mathcal{L}(l^2)$$

und suchen das Spektrum

$$\text{sp}(A) := \{z \in \mathbb{C} : A - zI \text{ nicht inv.bar}\}$$

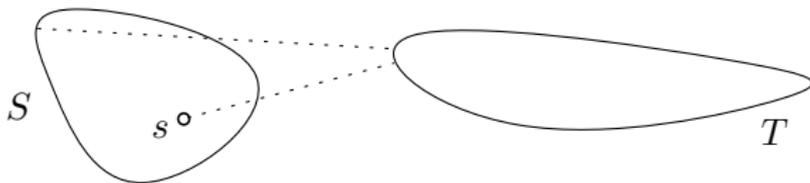


Betr. stetige lineare Abbildungen auf $l^2 = l^2(\mathbb{N}, \mathbb{C})$

$$A = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} & \cdots \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} & \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} & \\ \vdots & & & \ddots \end{pmatrix} \in \mathcal{L}(l^2)$$

(\mathbb{C}, d_H) - Menge d. kompakten $S, T \subset \mathbb{C}$ mit Hausdorff-Abstand

$$d_H(S, T) := \max \left\{ \max_{s \in S} \text{dist}(s, T), \max_{t \in T} \text{dist}(t, S) \right\}.$$

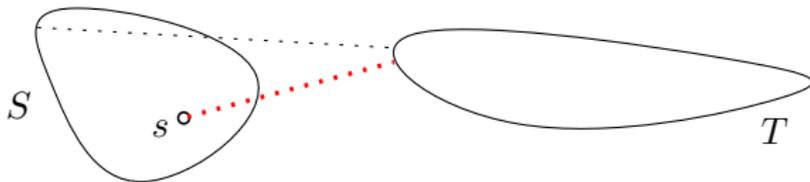


Betr. stetige lineare Abbildungen auf $l^2 = l^2(\mathbb{N}, \mathbb{C})$

$$A = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} & \cdots \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} & \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} & \\ \vdots & & & \ddots \end{pmatrix} \in \mathcal{L}(l^2)$$

(\mathbb{C}, d_H) - Menge d. kompakten $S, T \subset \mathbb{C}$ mit Hausdorff-Abstand

$$d_H(S, T) := \max \left\{ \max_{s \in S} \text{dist}(s, T), \max_{t \in T} \text{dist}(t, S) \right\}.$$

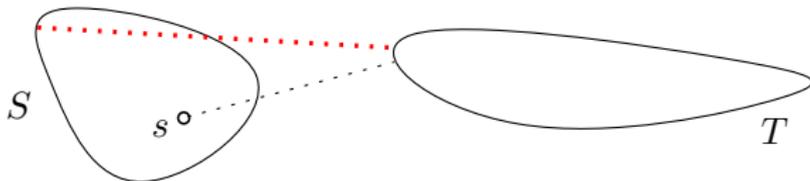


Betr. stetige lineare Abbildungen auf $l^2 = l^2(\mathbb{N}, \mathbb{C})$

$$A = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} & \cdots \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} & \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} & \\ \vdots & & & \ddots \end{pmatrix} \in \mathcal{L}(l^2)$$

(\mathbb{C}, d_H) - Menge d. kompakten $S, T \subset \mathbb{C}$ mit Hausdorff-Abstand

$$d_H(S, T) := \max \left\{ \max_{s \in S} \text{dist}(s, T), \max_{t \in T} \text{dist}(t, S) \right\}.$$

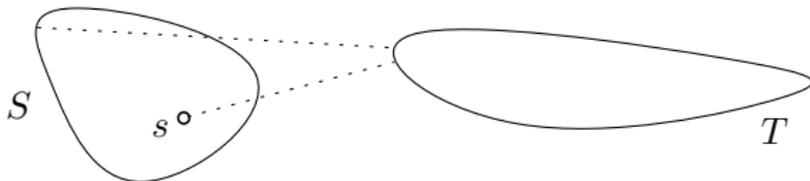


Betr. stetige lineare Abbildungen auf $l^2 = l^2(\mathbb{N}, \mathbb{C})$

$$A = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} & \cdots \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} & \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} & \\ \vdots & & & \ddots \end{pmatrix} \in \mathcal{L}(l^2)$$

(\mathbb{C}, d_H) - Menge d. kompakten $S, T \subset \mathbb{C}$ mit Hausdorff-Abstand

$$d_H(S, T) := \max \left\{ \max_{s \in S} \text{dist}(s, T), \max_{t \in T} \text{dist}(t, S) \right\}.$$



$$\text{sp} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H), \quad A \mapsto \text{sp}(A)$$



$$\text{sp} : \mathcal{L}(I^2) \rightarrow (C, d_H), \quad A \mapsto \text{sp}(A)$$

Berechnen des Spektrums

Suchen Algorithmus $\Gamma : \mathcal{L}(I^2) \rightarrow (C, d_H)$ mit

- Γ besteht aus

endlich vielen Operationen auf
endlich vielen Matrixeinträgen $(a_{ij})_{i,j=1}^r$ von A

- $\Gamma(A) = \text{sp}(A)$



$$\text{sp} : \mathcal{L}(I^2) \rightarrow (C, d_H), \quad A \mapsto \text{sp}(A)$$

Berechnen des Spektrums

Suchen Algorithmus $\Gamma : \mathcal{L}(I^2) \rightarrow (C, d_H)$ mit

- Γ besteht aus

endlich vielen Operationen auf

endlich vielen Matrixeinträgen $(a_{ij})_{i,j=1}^r$ von A

- $\Gamma(A) = \text{sp}(A)$



$$\text{sp} : \mathcal{L}(I^2) \rightarrow (C, d_H), \quad A \mapsto \text{sp}(A)$$

Berechnen des Spektrums

Suchen Algorithmus $\Gamma : \mathcal{L}(I^2) \rightarrow (C, d_H)$ mit

- Γ besteht aus

endlich vielen Operationen auf

endlich vielen Matrixeinträgen $(a_{ij})_{i,j=1}^r$ von A

- $\Gamma(A) = \text{sp}(A)$



$$\text{sp} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H), \quad A \mapsto \text{sp}(A)$$

Berechnen des Spektrums

Suchen Folge von Algorithmen $\Gamma_n : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H)$ mit

- Jedes Γ_n besteht aus

endlich vielen Operationen auf

endlich vielen Matrixeinträgen $(a_{ij})_{i,j=1}^r$ von A

(r abh. von n)

- $\lim_{n \rightarrow \infty} \Gamma_n(A) = \text{sp}(A)$



$$\text{sp} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H), \quad A \mapsto \text{sp}(A)$$

Berechnen des Spektrums

Suchen Familie von Algorithmen $\Gamma_{n_1, \dots, n_k} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H)$ mit

- Jedes Γ_{n_1, \dots, n_k} besteht aus

endlich vielen Operationen auf

endlich vielen Matrixeinträgen $(a_{ij})_{i,j=1}^r$ von A

(r abh. von n_1, \dots, n_k)

- $\lim_{n_1 \rightarrow \infty} \lim_{n_2 \rightarrow \infty} \cdots \lim_{n_k \rightarrow \infty} \Gamma_{n_1, \dots, n_k}(A) = \text{sp}(A)$



$$\text{sp} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H), \quad A \mapsto \text{sp}(A)$$

Berechnen des Spektrums

Suchen Familie von Algorithmen $\Gamma_{n_1, \dots, n_k} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H)$ mit

- Jedes Γ_{n_1, \dots, n_k} besteht aus **berechenbare**
endlich vielen Operationen auf
endlich vielen Matrixeinträgen $(a_{ij})_{i,j=1}^r$ von A

(r abh. von n_1, \dots, n_k)

- $\lim_{n_1 \rightarrow \infty} \lim_{n_2 \rightarrow \infty} \dots \lim_{n_k \rightarrow \infty} \Gamma_{n_1, \dots, n_k}(A) = \text{sp}(A)$



$$\text{sp} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H), \quad A \mapsto \text{sp}(A)$$

Berechnen des Spektrums

Suchen Familie von Algorithmen $\Gamma_{n_1, \dots, n_k} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H)$ mit

- Jedes Γ_{n_1, \dots, n_k} besteht aus **berechenbare**
endlich vielen Operationen auf
endlich vielen Matrixeinträgen $(a_{ij})_{i,j=1}^r$ von A

(r abh. von n_1, \dots, n_k)

- $\lim_{n_1 \rightarrow \infty} \lim_{n_2 \rightarrow \infty} \dots \lim_{n_k \rightarrow \infty} \Gamma_{n_1, \dots, n_k}(A) = \text{sp}(A)$ **Approximationen**



$$\text{sp} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H), \quad A \mapsto \text{sp}(A)$$

Berechnen des Spektrums

Suchen Familie von Algorithmen $\Gamma_{n_1, \dots, n_k} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H)$ mit

- Jedes Γ_{n_1, \dots, n_k} besteht aus **berechenbare**
endlich vielen Operationen auf
endlich vielen Matrixeinträgen $(a_{ij})_{i,j=1}^r$ von A

(r abh. von n_1, \dots, n_k)

- $\lim_{n_1 \rightarrow \infty} \lim_{n_2 \rightarrow \infty} \dots \lim_{n_k \rightarrow \infty} \Gamma_{n_1, \dots, n_k}(A) = \text{sp}(A)$ **Approximationen**

Wie viele Limits sind nötig ?



Reboot: Computational problems



Reboot: Computational problems

Computational Problem

$$(\Sigma, \Omega, \mathcal{M}, \Lambda)$$

- $\Sigma : \Omega \rightarrow \mathcal{M}$ - *problem function*
- Ω - *primary set* (Menge von interessierenden Objekten)
- \mathcal{M} - metrischer Raum (der Ergebnisse)
- Λ - *evaluation set* (Menge von Funktionen $\lambda : \Omega \rightarrow \mathbb{C}$)



Reboot: Computational problems

Computational Problem

$$(\Sigma, \Omega, \mathcal{M}, \Lambda)$$

- $\Sigma : \Omega \rightarrow \mathcal{M}$ - *problem function*
- Ω - *primary set* (Menge von interessierenden Objekten)
- \mathcal{M} - metrischer Raum (der Ergebnisse)
- Λ - *evaluation set* (Menge von Funktionen $\lambda : \Omega \rightarrow \mathbb{C}$)

$$\Sigma = \text{sp} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H)$$

$$\Lambda = \{\lambda_{ij} : i, j \in \mathbb{N}\} - \text{Matrixeinträge } \lambda_{ij}(A) = a_{ij}$$



Reboot: Computational problems

$$\Sigma : \Omega \rightarrow \mathcal{M}$$

Towers of Algorithms

Definieren Familie/Turm von Algorithmen $\Gamma_{n_1, \dots, n_k} : \Omega \rightarrow \mathcal{M}$ mit

- Jedes Γ_{n_1, \dots, n_k} besteht aus

endlich vielen Operationen auf
endlich vielen Evaluationen $f_{ij}(\omega)$ von ω

- $\lim_{n_1 \rightarrow \infty} \lim_{n_2 \rightarrow \infty} \cdots \lim_{n_k \rightarrow \infty} \Gamma_{n_1, \dots, n_k}(\omega) = \Sigma(\omega)$



Reboot: Computational problems

$$\Sigma : \Omega \rightarrow \mathcal{M}$$

Towers of Algorithms

Definieren Familie/Turm von Algorithmen $\Gamma_{n_1, \dots, n_k} : \Omega \rightarrow \mathcal{M}$ mit

- Jedes Γ_{n_1, \dots, n_k} besteht aus **berechenbare**

endlich vielen Operationen auf
endlich vielen Evaluationen $f_{ij}(\omega)$ von ω

- $\lim_{n_1 \rightarrow \infty} \lim_{n_2 \rightarrow \infty} \cdots \lim_{n_k \rightarrow \infty} \Gamma_{n_1, \dots, n_k}(\omega) = \Sigma(\omega)$



Reboot: Computational problems

$$\Sigma : \Omega \rightarrow \mathcal{M}$$

Towers of Algorithms

Definieren Familie/Turm von Algorithmen $\Gamma_{n_1, \dots, n_k} : \Omega \rightarrow \mathcal{M}$ mit

- Jedes Γ_{n_1, \dots, n_k} besteht aus **berechenbare**
endlich vielen Operationen auf
endlich vielen Evaluationen $f_{ij}(\omega)$ von ω
- $\lim_{n_1 \rightarrow \infty} \lim_{n_2 \rightarrow \infty} \cdots \lim_{n_k \rightarrow \infty} \Gamma_{n_1, \dots, n_k}(\omega) = \Sigma(\omega)$ **Approximationen**



Reboot: Computational problems

$$\Sigma : \Omega \rightarrow \mathcal{M}$$

Towers of Algorithms

Definieren Familie/Turm von Algorithmen $\Gamma_{n_1, \dots, n_k} : \Omega \rightarrow \mathcal{M}$ mit

- Jedes Γ_{n_1, \dots, n_k} besteht aus **berechenbare**
endlich vielen Operationen auf
endlich vielen Evaluationen $f_{ij}(\omega)$ von ω
- $\lim_{n_1 \rightarrow \infty} \lim_{n_2 \rightarrow \infty} \dots \lim_{n_k \rightarrow \infty} \Gamma_{n_1, \dots, n_k}(\omega) = \Sigma(\omega)$ **Approximationen**

Der Solvability Complexity Index **SCI**(Σ) von Σ ist die kleinste Anzahl k an Limits, für die es einen solchen Algorithmenturm gibt.



Warm Up: einfache Entscheidungsprobleme

Betrachten Entscheidungsprobleme

$$\Sigma : \Omega \rightarrow \mathcal{M} := \{ja, nein\},$$



Warm Up: einfache Entscheidungsprobleme

Betrachten Entscheidungsprobleme

$$\Sigma : \Omega \rightarrow \mathcal{M} := \{ja, nein\},$$

speziell für die Menge aller 0 – 1–Folgen

$$\Omega := \{(a_i)_{i \in \mathbb{N}} : a_i \in \{0, 1\}\}$$

Σ_1 Hat (a_i) eine 1?

Σ_2 Hat (a_i) unendlich viele 1en?

Σ_3 Hat $(a_{i,j})$ unendlich viele 1en?

Σ_4 Hat $(a_{i,j})$ eine Spalte mit unendlich vielen 1en?

$SCI(\Sigma_1) = 1, \quad SCI(\Sigma_2) = 2, \dots$



Warm Up: einfache Entscheidungsprobleme

Betrachten Entscheidungsprobleme

$$\Sigma : \Omega \rightarrow \mathcal{M} := \{ja, nein\},$$

speziell für die Menge aller 0 – 1–Folgen

$$\Omega := \{(a_i)_{i \in \mathbb{N}} : a_i \in \{0, 1\}\}$$

Σ_1 Hat (a_i) eine 1?

Σ_2 Hat (a_i) unendlich viele 1en?

Σ_3 Hat $(a_{i,j})$ unendlich viele 1en?

Σ_4 Hat $(a_{i,j})$ eine Spalte mit unendlich vielen 1en?

$SCI(\Sigma_1) = 1, \quad SCI(\Sigma_2) = 2, \dots$



Warm Up: einfache Entscheidungsprobleme

Betrachten Entscheidungsprobleme

$$\Sigma : \Omega \rightarrow \mathcal{M} := \{ja, nein\},$$

speziell für die Menge aller 0 – 1–Folgen

$$\Omega := \{(a_i)_{i \in \mathbb{N}} : a_i \in \{0, 1\}\}$$

Σ_1 Hat (a_i) eine 1?

Σ_2 Hat (a_i) unendlich viele 1en?

Σ_3 Hat $(a_{i,j})$ unendlich viele 1en?

Σ_4 Hat $(a_{i,j})$ eine Spalte mit unendlich vielen 1en?

$SCI(\Sigma_1) = 1, \quad SCI(\Sigma_2) = 2, \dots$



Warm Up: einfache Entscheidungsprobleme

Betrachten Entscheidungsprobleme

$$\Sigma : \Omega \rightarrow \mathcal{M} := \{ja, nein\},$$

speziell für die Menge aller 0 – 1–Folgen

$$\Omega := \{(a_i)_{i \in \mathbb{N}} : a_i \in \{0, 1\}\}$$

Σ_1 Hat (a_i) eine 1?

Σ_2 Hat (a_i) unendlich viele 1en?

Σ_3 Hat $(a_{i,j})$ unendlich viele 1en?

Σ_4 Hat $(a_{i,j})$ eine Spalte mit unendlich vielen 1en?

$$SCI(\Sigma_1) = 1, \quad SCI(\Sigma_2) = 2, \dots$$



Warm Up: einfache Entscheidungsprobleme

Betrachten Entscheidungsprobleme

$$\Sigma : \Omega \rightarrow \mathcal{M} := \{ja, nein\},$$

speziell für die Menge aller 0 – 1–Folgen

$$\Omega := \{(a_i)_{i \in \mathbb{N}} : a_i \in \{0, 1\}\}$$

Σ_1 Hat (a_i) eine 1?

Σ_2 Hat (a_i) unendlich viele 1en?

Σ_3 Hat $(a_{i,j})$ unendlich viele 1en?

Σ_4 Hat $(a_{i,j})$ eine Spalte mit unendlich vielen 1en?

$\text{SCI}(\Sigma_1) = 1, \quad \text{SCI}(\Sigma_2) = 2, \dots$



Warm Up: einfache Entscheidungsprobleme

Einbettung “klassischer” Rekursionstheorie

(Gödel, Kleene, Mostowski, Turing, Church)

Lage in der arithmetischen Hierarchie $\hat{=}$ SCI

(Lemma von Shoenfield '59)



Weitere Beispiele

Lösen linearer Gleichungen

Für $A \in GL(I^2)$, $b \in I^2$ ist $x \in I^2$ mit $Ax = b$ gesucht, d.h.

$$\Sigma : GL(I^2) \times I^2 \rightarrow I^2, \quad (A, b) \mapsto x.$$

(Die Algorithmen Γ . lesen nur endlich viele Einträge von A und b)

Proposition

S. '13

Die Lösung x von $Ax = b$ mit $A \in GL(I^2)$ kann i.A. nicht in einem Limit berechnet werden.

Bem: gilt schon für selbstadjungierte A .



Weitere Beispiele

Lösen linearer Gleichungen

Für $A \in GL(I^2)$, $b \in I^2$ ist $x \in I^2$ mit $Ax = b$ gesucht, d.h.

$$\Sigma : GL(I^2) \times I^2 \rightarrow I^2, \quad (A, b) \mapsto x.$$

(Die Algorithmen Γ . lesen nur endlich viele Einträge von A und b)

Proposition

S. '13

Die Lösung x von $Ax = b$ mit $A \in GL(I^2)$ kann i.A. nicht in einem Limit berechnet werden.

Bem: gilt schon für selbstadjungierte A .



Weitere Beispiele

Lösen linearer Gleichungen

Für $A \in GL(I^2)$, $b \in I^2$ ist $x \in I^2$ mit $Ax = b$ gesucht, d.h.

$$\Sigma : GL(I^2) \times I^2 \rightarrow I^2, \quad (A, b) \mapsto x.$$

(Die Algorithmen Γ . lesen nur endlich viele Einträge von A und b)

Proposition

S. '13

Die Lösung x von $Ax = b$ mit $A \in GL(I^2)$ kann i.A. nicht in einem Limit berechnet werden.

Bem: gilt schon für selbstadjungierte A .



Weitere Beispiele

Lösen linearer Gleichungen

Für $A \in GL(I^2)$, $b \in I^2$ ist $x \in I^2$ mit $Ax = b$ gesucht, d.h.

$$\Sigma : GL(I^2) \times I^2 \rightarrow I^2, \quad (A, b) \mapsto x.$$

(Die Algorithmen Γ . lesen nur endlich viele Einträge von A und b)

Theorem

Die Lösung x von $Ax = b$ mit $A \in GL(I^2)$ kann in zwei Limits berechnet werden.

Idee: Moore-Penrose-Inversion für rechteckige Finite Sections

$$\Gamma_{m,n}(A, b) := (P_m A^* P_n A P_m)^{-1} P_m A^* P_n b.$$



Weitere Beispiele

Nullstellen von Polynomen

Für Polynom $p \in \mathcal{P}_k$ k ten Grades ist die Nullstellenmenge gesucht, d.h.

$$\Sigma : \mathcal{P}_k \rightarrow (\mathbb{C}, d_H), \quad p \mapsto \{z \in \mathbb{C} : p(z) = 0\}.$$

- Abel-Ruffini, Galois, Newton's Method
- Doyle, McMullen '80s: $SCI = 1$ für $k = 2, 3$;
 $< \infty$ für $k = 4, 5$; $= \infty$ für $k \geq 6$
(fast) beliebige Startnäherungen
- Hubbard, Schleicher, Sutherland 2000: $SCI = 1$ für alle k
(durch clevere Startnäherungen)



Weitere Beispiele

Nullstellen von Polynomen

Für Polynom $p \in \mathcal{P}_k$ k ten Grades ist die Nullstellenmenge gesucht, d.h.

$$\Sigma : \mathcal{P}_k \rightarrow (\mathbb{C}, d_H), \quad p \mapsto \{z \in \mathbb{C} : p(z) = 0\}.$$

- Abel-Ruffini, Galois, Newton's Method
- Doyle, McMullen '80s: $SCI = 1$ für $k = 2, 3$;
 $< \infty$ für $k = 4, 5$; $= \infty$ für $k \geq 6$
(fast) beliebige Startnäherungen
- Hubbard, Schleicher, Sutherland 2000: $SCI = 1$ für alle k
(durch clevere Startnäherungen)



Weitere Beispiele

Nullstellen von Polynomen

Für Polynom $p \in \mathcal{P}_k$ k ten Grades ist die Nullstellenmenge gesucht, d.h.

$$\Sigma : \mathcal{P}_k \rightarrow (\mathbb{C}, d_H), \quad p \mapsto \{z \in \mathbb{C} : p(z) = 0\}.$$

- Abel-Ruffini, Galois, Newton's Method
- Doyle, McMullen '80s: $SCI = 1$ für $k = 2, 3$;
 $< \infty$ für $k = 4, 5$; $= \infty$ für $k \geq 6$
(fast) beliebige Startnäherungen)
- Hubbard, Schleicher, Sutherland 2000: $SCI = 1$ für alle k
(durch clevere Startnäherungen)



Weitere Beispiele

Nullstellen von Polynomen

Für Polynom $p \in \mathcal{P}_k$ k ten Grades ist die Nullstellenmenge gesucht, d.h.

$$\Sigma : \mathcal{P}_k \rightarrow (\mathbb{C}, d_H), \quad p \mapsto \{z \in \mathbb{C} : p(z) = 0\}.$$

- Abel-Ruffini, Galois, Newton's Method
- Doyle, McMullen '80s: $SCI = 1$ für $k = 2, 3$;
 $< \infty$ für $k = 4, 5$; $= \infty$ für $k \geq 6$
(fast beliebige Startnäherungen)
- Hubbard, Schleicher, Sutherland 2000: $SCI = 1$ für alle k
(durch clevere Startnäherungen)



Weitere Beispiele

Nullstellen von Polynomen

Für Polynom $p \in \mathcal{P}_k$ k ten Grades ist die Nullstellenmenge gesucht, d.h.

$$\Sigma : \mathcal{P}_k \rightarrow (\mathbb{C}, d_H), \quad p \mapsto \{z \in \mathbb{C} : p(z) = 0\}.$$

- Abel-Ruffini, Galois, Newton's Method
- Doyle, McMullen '80s: $SCI = 1$ für $k = 2, 3$;
 $< \infty$ für $k = 4, 5$; $= \infty$ für $k \geq 6$
(fast beliebige Startnäherungen)
- Hubbard, Schleicher, Sutherland 2000: $SCI = 1$ für alle k
(durch clevere Startnäherungen)



Weitere Beispiele

Nullstellen von Polynomen

Für Polynom $p \in \mathcal{P}_k$ k ten Grades ist die Nullstellenmenge gesucht, d.h.

$$\Sigma : \mathcal{P}_k \rightarrow (\mathbb{C}, d_H), \quad p \mapsto \{z \in \mathbb{C} : p(z) = 0\}.$$

- Abel-Ruffini, Galois, Newton's Method
- Doyle, McMullen '80s: $SCI = 1$ für $k = 2, 3$;
 $< \infty$ für $k = 4, 5$; $= \infty$ für $k \geq 6$
(*(fast) beliebige Startnherungen*)
- Hubbard, Schleicher, Sutherland 2000: $SCI = 1$ für alle k
(*durch clevere Startnherungen*)



Weitere Beispiele

Nullstellen von Polynomen

Für Polynom $p \in \mathcal{P}_k$ k ten Grades ist die Nullstellenmenge gesucht, d.h.

$$\Sigma : \mathcal{P}_k \rightarrow (\mathbb{C}, d_H), \quad p \mapsto \{z \in \mathbb{C} : p(z) = 0\}.$$

- Abel-Ruffini, Galois, Newton's Method
- Doyle, McMullen '80s: $SCI = 1$ für $k = 2, 3$;
 $< \infty$ für $k = 4, 5$; $= \infty$ für $k \geq 6$
(fast) beliebige Startnäherungen)
- Hubbard, Schleicher, Sutherland 2000: $SCI = 1$ für alle k
(durch clevere Startnäherungen)



- 1 Einführung: Algorithmentürme und Komplexität
 - Berechnung von Spektren
 - Computational problems: pur und rein
 - Weitere Beispiele

- 2 Untere und obere Schranken beim Spektrum
 - Zwei Beispiele \rightarrow $\text{SCI}(\text{sp} \geq 2)$
 - Ein Turm für selbstadjungierte Operatoren
 - Der Kreis schließt sich



Zurück zu Operatorspektren

$$\Sigma = \text{sp} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H)$$

$$\Lambda = \{\lambda_{ij} : i, j \in \mathbb{N}\} - \text{Matrixeinträge } \lambda_{ij}(A) = a_{ij}$$



Zurück zu Operatorspektren

$$\Sigma = \text{sp} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H)$$

$$\Lambda = \{\lambda_{ij} : i, j \in \mathbb{N}\} - \text{Matrixeinträge } \lambda_{ij}(A) = a_{ij}$$

Theorem

Hansen '08

$$\text{SCI}(\text{sp}) \leq 3.$$

*A. C. Hansen, On the solvability complexity index, the n -pseudospectrum and approximations of spectra of operators, J. Amer. Math. Soc. **24** (2011), 81-124.*



Zurück zu Operatorspektren

$$\Sigma = \text{sp} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H)$$

$$\Lambda = \{\lambda_{ij} : i, j \in \mathbb{N}\} - \text{Matrixeinträge } \lambda_{ij}(A) = a_{ij}$$

Theorem

Hansen '08

$$\text{SCI}(\text{sp}) \leq 3.$$

A. C. Hansen, *On the solvability complexity index, the n -pseudospectrum and approximations of spectra of operators*, *J. Amer. Math. Soc.* **24** (2011), 81-124.

Ist er 2 ?



Zurück zu Operatorspektren

$$\Sigma = \text{sp} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H)$$

$$\Lambda = \{\lambda_{ij} : i, j \in \mathbb{N}\} - \text{Matrixeinträge } \lambda_{ij}(A) = a_{ij}$$

Theorem

Hansen '08

$$\text{SCI}(\text{sp}) \leq 3.$$

A. C. Hansen, *On the solvability complexity index, the n -pseudospectrum and approximations of spectra of operators*, *J. Amer. Math. Soc.* **24** (2011), 81-124.

Ist er 2 ?

oder sogar 1 ?



Zurück zu Operatorspektren

$$\Sigma = \text{sp} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H)$$

$$\Lambda = \{\lambda_{ij} : i, j \in \mathbb{N}\} - \text{Matrixeinträge } \lambda_{ij}(A) = a_{ij}$$

Theorem

Hansen '08

$$\text{SCI}(\text{sp}) \leq 3.$$

A. C. Hansen, *On the solvability complexity index, the n -pseudospectrum and approximations of spectra of operators*, *J. Amer. Math. Soc.* **24** (2011), 81-124.

Ist er 2 ?

oder sogar 1 ?

Wird es besser für speziellere Klassen, z.B. für selbstadjungierte oder Band-Operatoren ?



Angenommen $\text{SCI}(\text{sp}) = 1$ und $\{\Gamma_m : m \in \mathbb{N}\}$ tut's.

Betrachten Block-diagonal-matrizen

$$A := \text{diag}\{B_{n_1}, B_{n_2}, B_{n_3}, \dots\}$$

mit Blöcken

$$B_n = \begin{pmatrix} 1 & & & 1 \\ & 0 & & \\ & & \ddots & \\ & & & 0 \\ 1 & & & 1 \end{pmatrix} \in \mathbb{C}^{n \times n}$$

$$\text{sp}(A) = \{0, 2\}$$



Angenommen $\text{SCI}(\text{sp}) = 1$ und $\{\Gamma_m : m \in \mathbb{N}\}$ tut's.

Betrachten Block-diagonal-matrizen

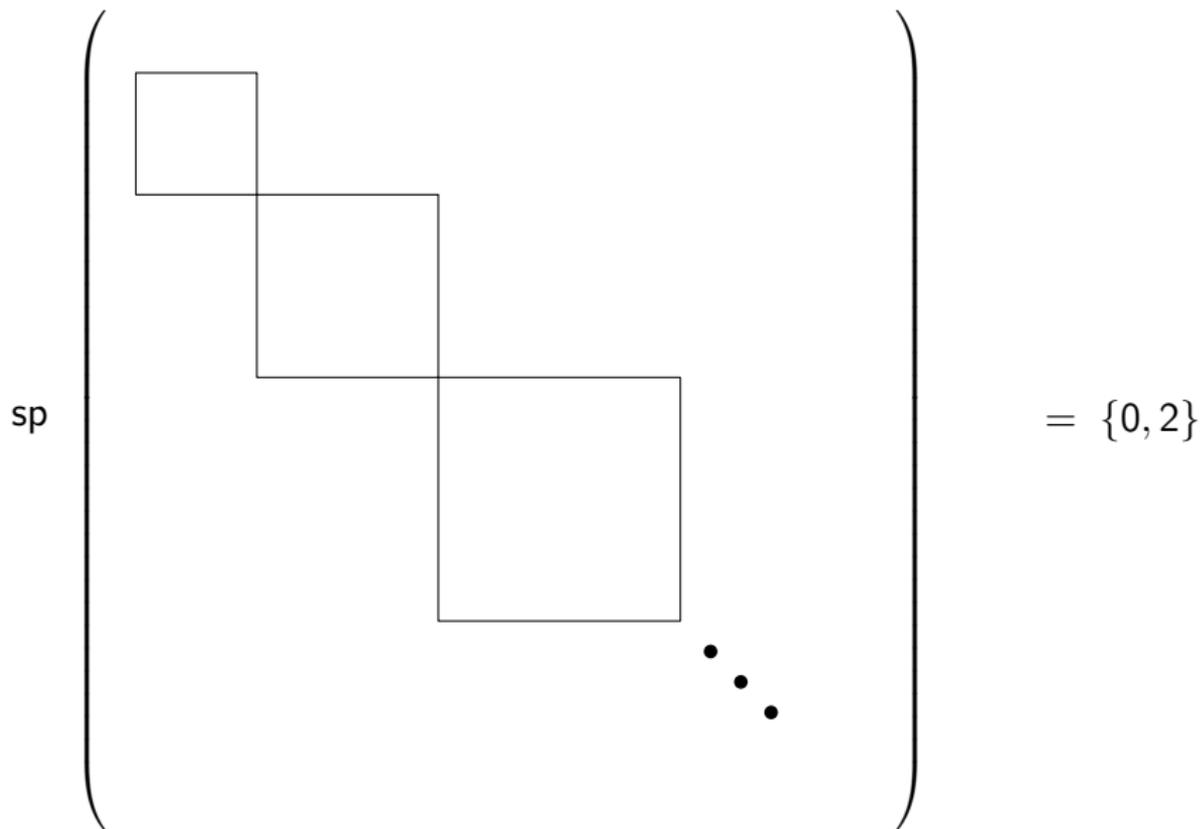
$$A := \text{diag}\{B_{n_1}, B_{n_2}, B_{n_3}, \dots\}$$

mit Blöcken

$$B_n = \begin{pmatrix} 1 & & & 1 \\ & 0 & & \\ & & \ddots & \\ & & & 0 \\ 1 & & & 1 \end{pmatrix} \in \mathbb{C}^{n \times n}$$

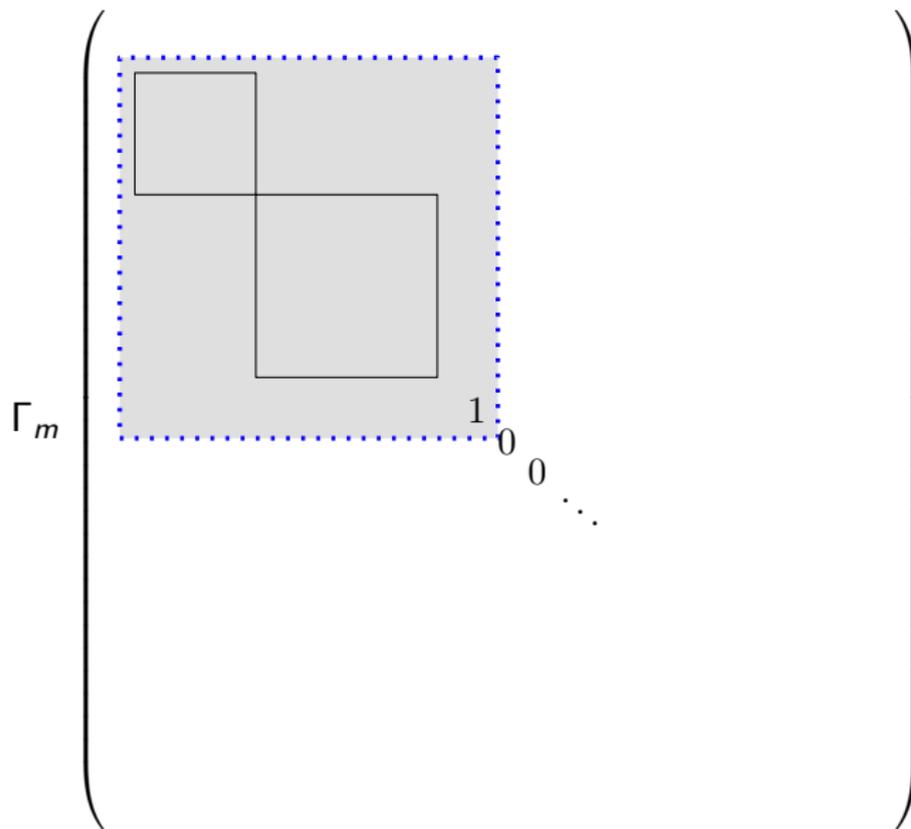
$$\text{sp}(A) = \{0, 2\}$$

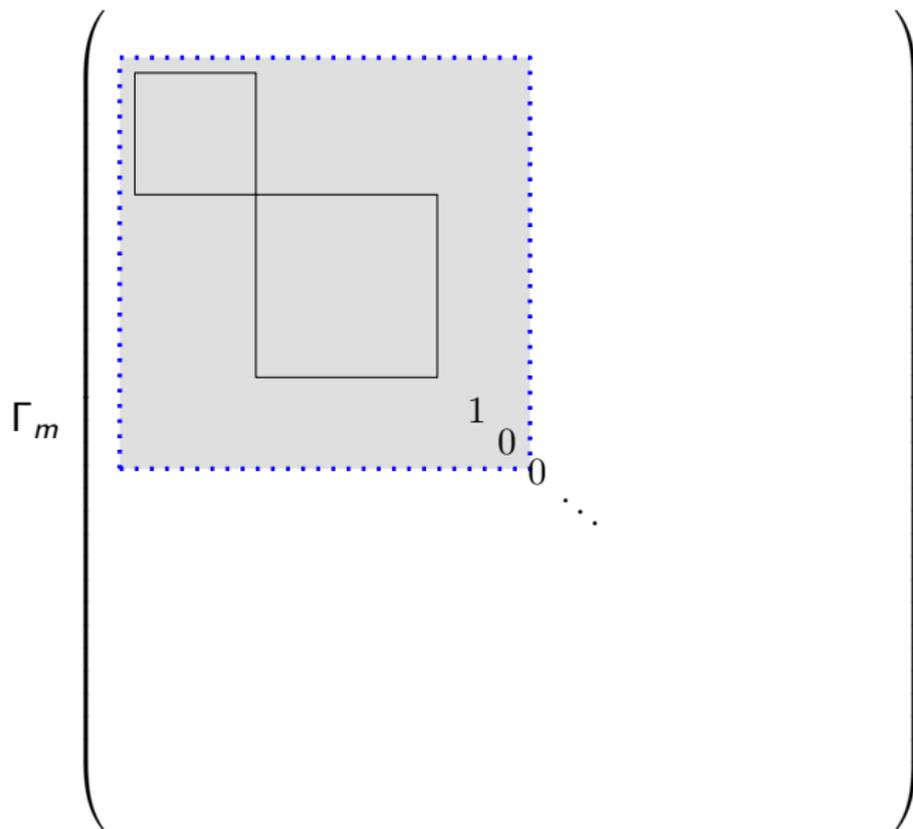


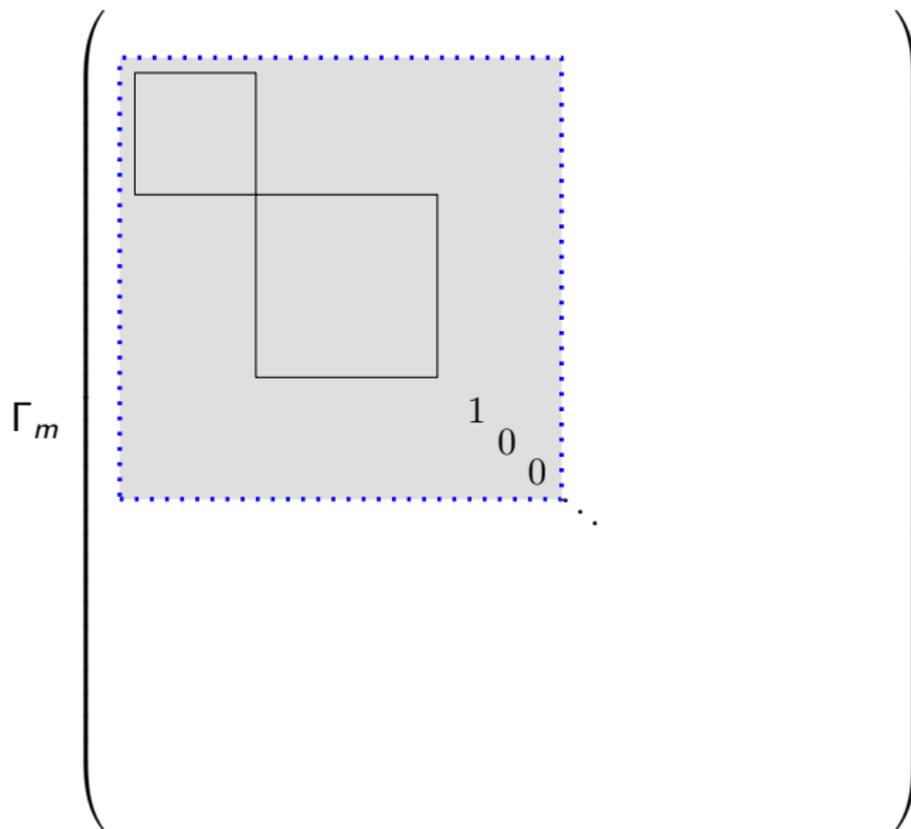


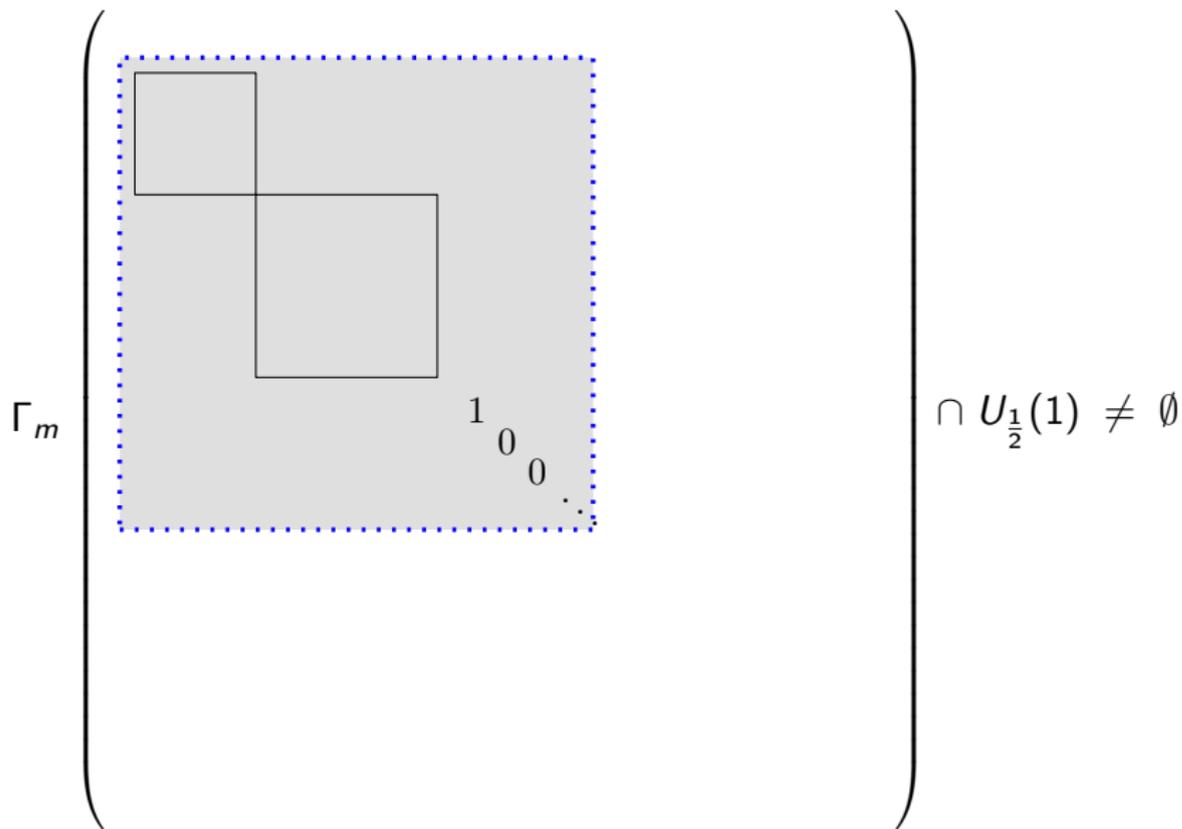
$$\text{sp} \left(\begin{array}{cccc} \square & & & \\ & \square & & \\ & & 1 & \\ & & 0 & \\ & & 0 & \ddots \end{array} \right) = \{0, 1, 2\}$$

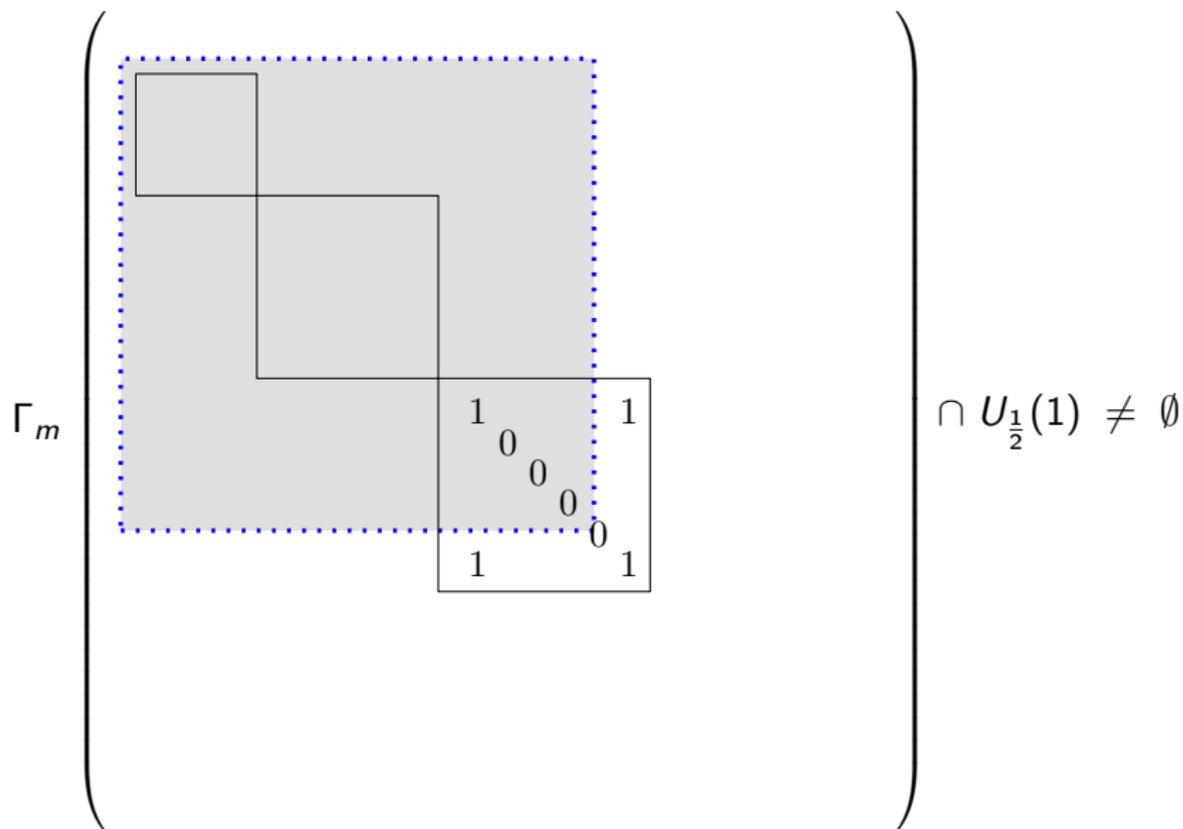


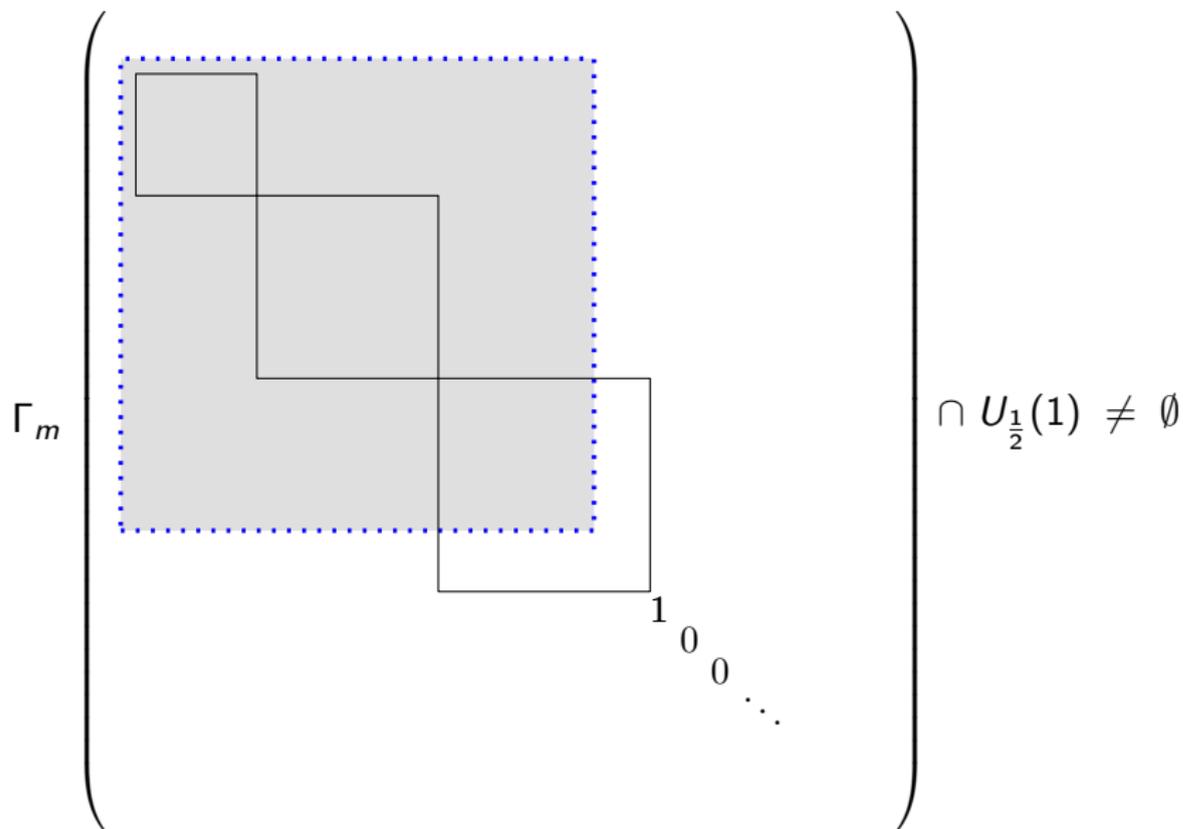


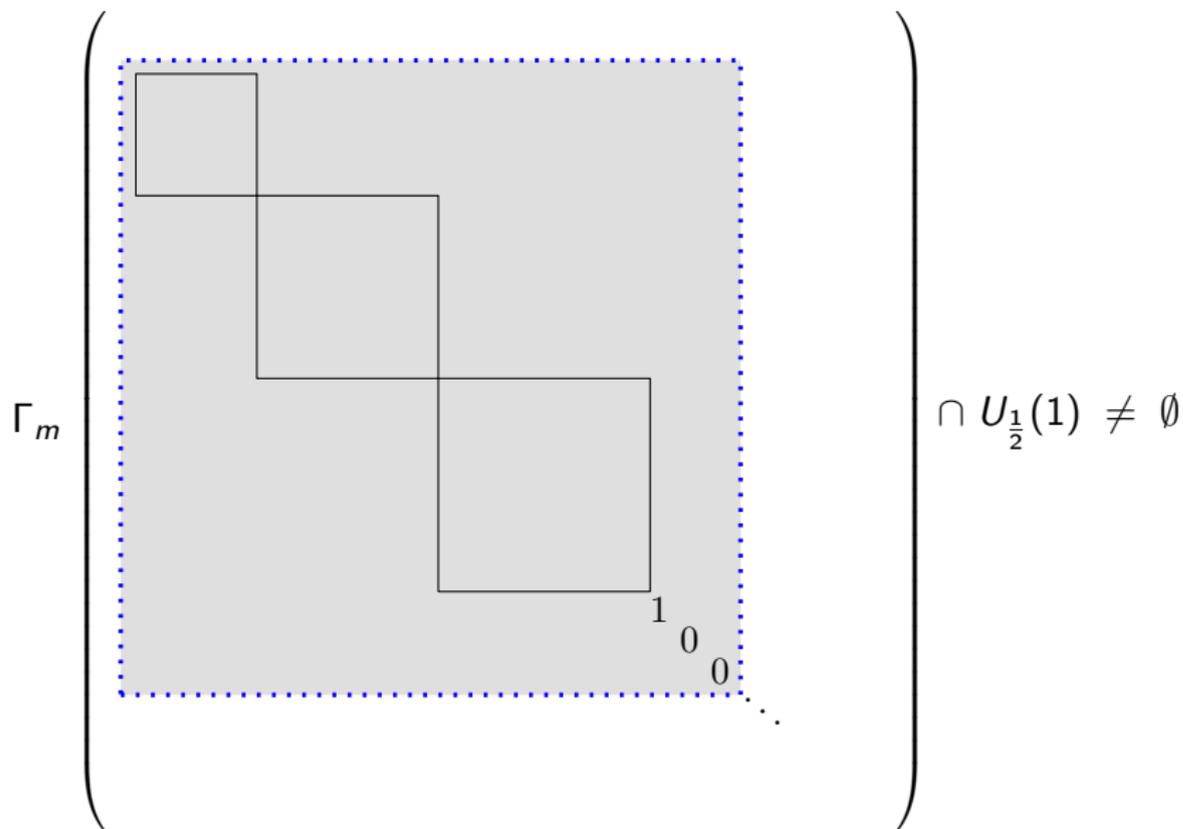


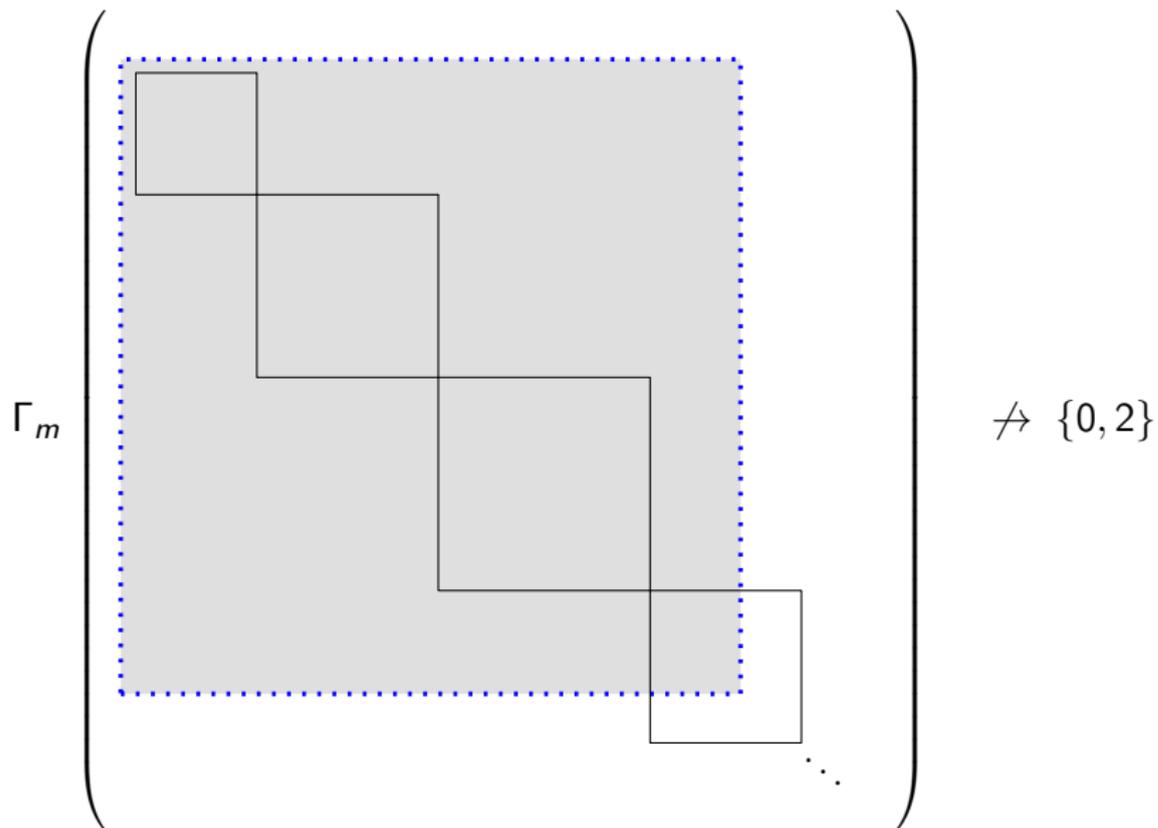












Proposition

Ben-Artzi, Hansen, S. '12

$$\text{sp} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H), \quad A \mapsto \text{sp}(A)$$

hat

$$\text{SCI}(\text{sp}) \geq 2.$$



Proposition

Ben-Artzi, Hansen, S. '12

$$\text{sp} : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow (C, d_H), \quad A \mapsto \text{sp}(A)$$

hat

$$\text{SCI}(\text{sp}) \geq 2.$$

Proposition - selbstadjungierte Operatoren

Ben-Artzi, Hansen, S. '12

$$\text{sp}^{sa} : \{A \in \mathcal{L}(l^2) : A \text{ s.a.}\} \rightarrow (C, d_H), \quad A \mapsto \text{sp}(A)$$

hat

$$\text{SCI}(\text{sp}^{sa}) \geq 2.$$



Proposition - Band-Operatoren

S. '12

$$\text{sp}^{\text{band}} : \{A \in \mathcal{L}(l^2) : A \text{ Bandoperator}\} \rightarrow (C, d_H), A \mapsto \text{sp}(A)$$

hat

$$\text{SCI}(\text{sp}^{\text{band}}) \geq 2.$$



Proposition - Band-Operatoren

S. '12

$$\text{sp}^{\text{band}} : \{A \in \mathcal{L}(l^2) : A \text{ Bandoperator}\} \rightarrow (C, d_H), A \mapsto \text{sp}(A)$$

hat

$$\text{SCI}(\text{sp}^{\text{band}}) \geq 2.$$

$\text{SCI}(\text{sp}^{\dots})$	band	allgemein
selbstadjungiert		≥ 2
allgemein	≥ 2	2 oder 3



- 1 Einführung: Algorithmentürme und Komplexität
 - Berechnung von Spektren
 - Computational problems: pur und rein
 - Weitere Beispiele

- 2 Untere und obere Schranken beim Spektrum
 - Zwei Beispiele \rightarrow $SCI(sp \geq 2)$
 - Ein Turm für selbstadjungierte Operatoren
 - Der Kreis schließt sich



Sei A selbstadjungiert.

\Rightarrow

- $sp(A) \subset \mathbb{R}$
- $\gamma(x) = \sigma_1(A - xI)$

σ_1 - kleinster Singulärwert



Sei A selbstadjungiert.

\Rightarrow

- $sp(A) \subset \mathbb{R}$

- $\gamma(x) = \sigma_1(A - xI)$

σ_1 - kleinster Singulärwert

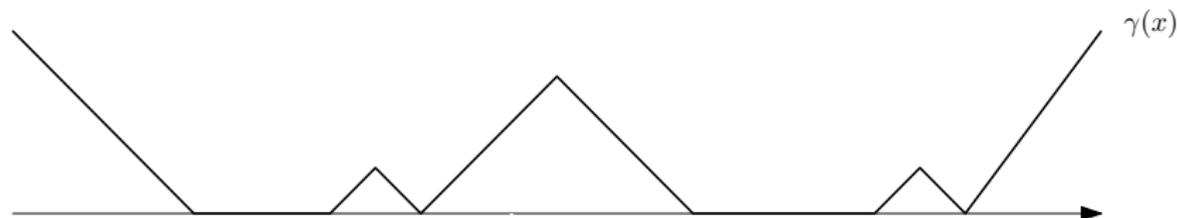


Sei A selbstadjungiert.

\Rightarrow

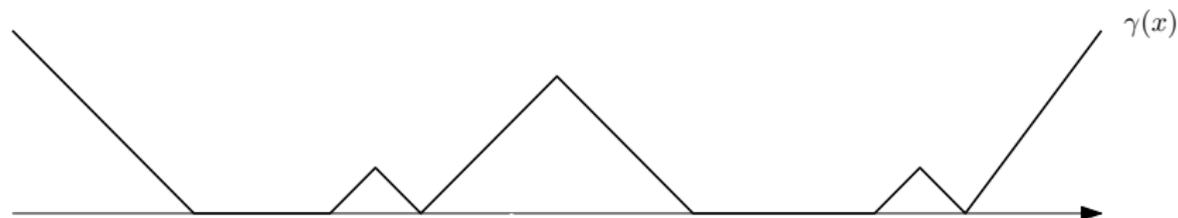
- $sp(A) \subset \mathbb{R}$
- $\gamma(x) = \sigma_1(A - xI)$
 $= \text{dist}(x, sp(A))$

σ_1 - kleinster Singulärwert



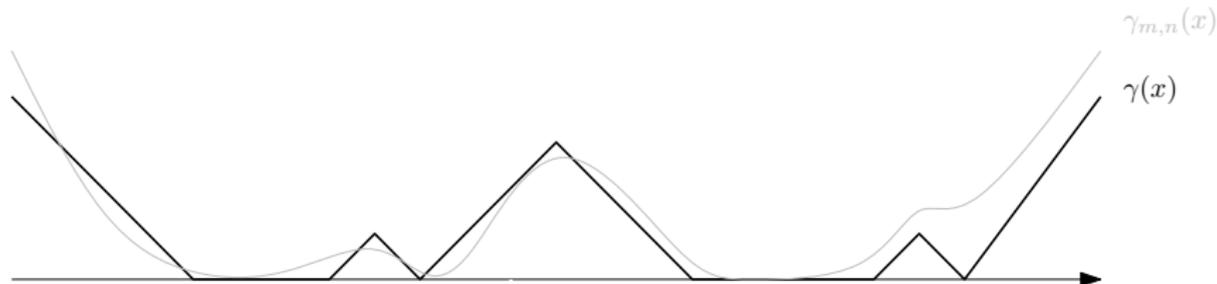
Sei A selbstadjungiert.

$$\gamma(x) = \sigma_1(A - xI)$$



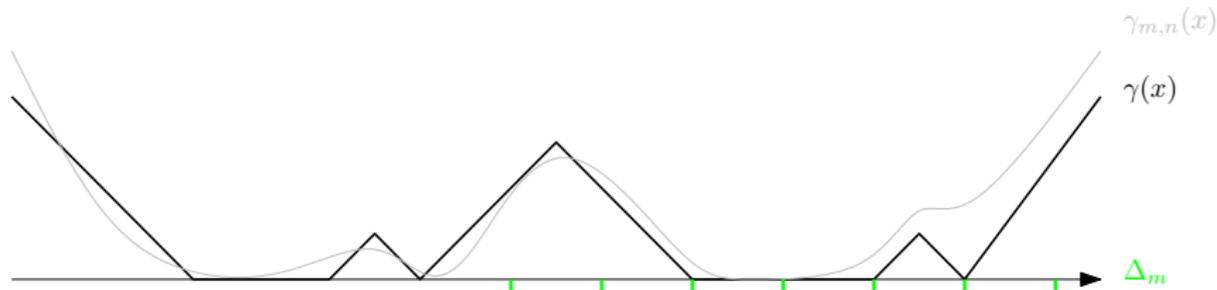
Sei A selbstadjungiert.

$$\gamma(x) = \sigma_1(A - xI)$$
$$\gamma_{m,n}(x) = \sigma_1(P_n(A - xI)P_m)$$



Sei A selbstadjungiert.

$$\begin{aligned}\gamma(x) &= \sigma_1(A - xI) \\ \gamma_{m,n}(x) &= \sigma_1(P_n(A - xI)P_m) \\ \Delta_m &= \{s/m : s = -m^2, \dots, m^2\}\end{aligned}$$

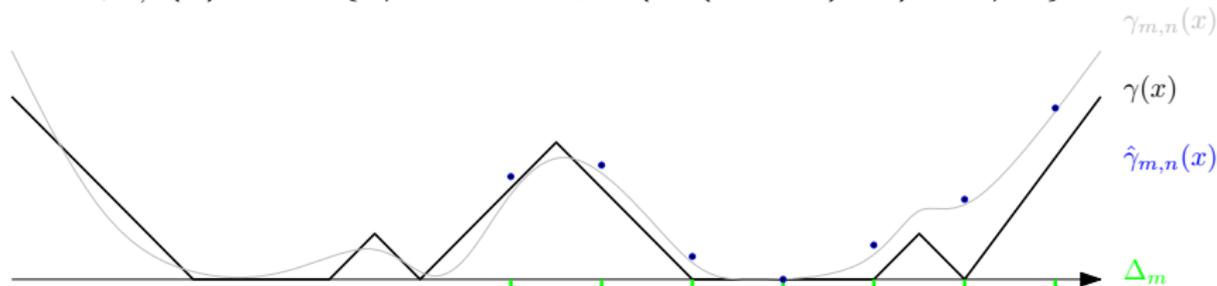


Sei A selbstadjungiert.

$$\begin{aligned}\gamma(x) &= \sigma_1(A - xI) \\ \gamma_{m,n}(x) &= \sigma_1(P_n(A - xI)P_m) \\ \Delta_m &= \{s/m : s = -m^2, \dots, m^2\}\end{aligned}$$

für $x \in \Delta_m$

$$\hat{\gamma}_{m,n}(x) = \min\{k/m : k \in \mathbb{N}, \sigma_1(P_n(A - xI)P_m) \leq k/m\}$$



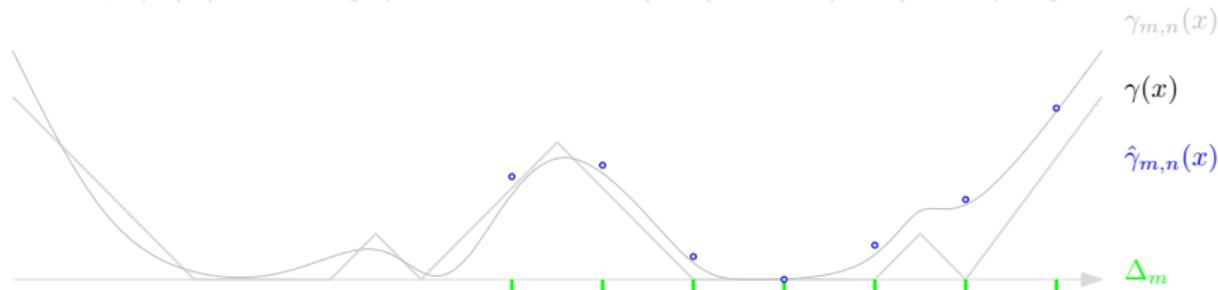
Sei A selbstadjungiert.

Konstruieren $\Gamma_{m,n}(A)$ wie folgt:

- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}(x) \geq 1$: —
- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}$ in x wächst: $x - \hat{\gamma}_{m,n}(x) \mapsto \Gamma_{m,n}(A)$
- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}$ in x fällt: $x + \hat{\gamma}_{m,n}(x) \mapsto \Gamma_{m,n}(A)$

für $x \in \Delta_m$

$$\hat{\gamma}_{m,n}(x) = \min\{k/m : k \in \mathbb{N}, \sigma_1(P_n(A - xI)P_m) \leq k/m\}$$



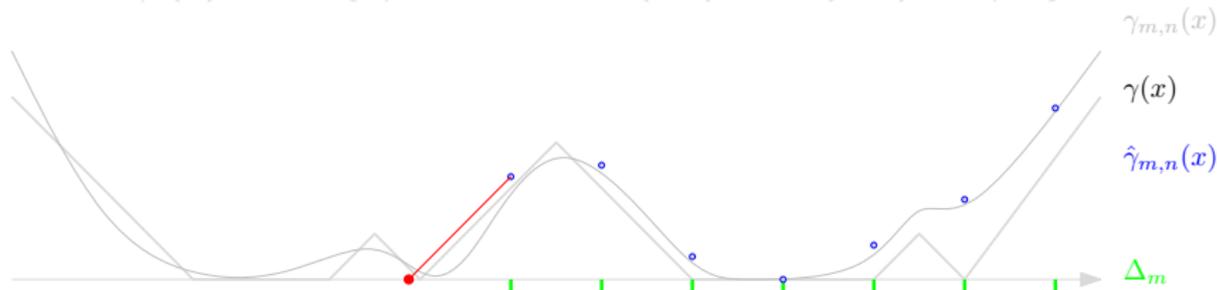
Sei A selbstadjungiert.

Konstruieren $\Gamma_{m,n}(A)$ wie folgt:

- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}(x) \geq 1$: —
- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}$ in x wächst: $x - \hat{\gamma}_{m,n}(x) \mapsto \Gamma_{m,n}(A)$
- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}$ in x fällt: $x + \hat{\gamma}_{m,n}(x) \mapsto \Gamma_{m,n}(A)$

für $x \in \Delta_m$

$$\hat{\gamma}_{m,n}(x) = \min\{k/m : k \in \mathbb{N}, \sigma_1(P_n(A - xI)P_m) \leq k/m\}$$



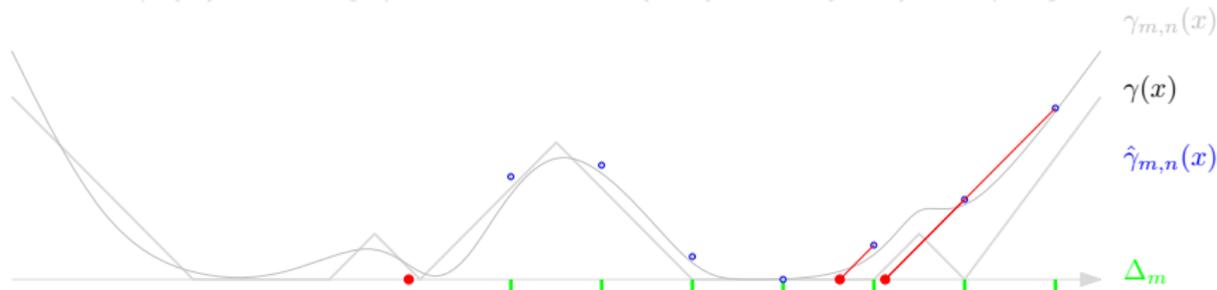
Sei A selbstadjungiert.

Konstruieren $\Gamma_{m,n}(A)$ wie folgt:

- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}(x) \geq 1$: —
- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}$ in x wächst: $x - \hat{\gamma}_{m,n}(x) \mapsto \Gamma_{m,n}(A)$
- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}$ in x fällt: $x + \hat{\gamma}_{m,n}(x) \mapsto \Gamma_{m,n}(A)$

für $x \in \Delta_m$

$$\hat{\gamma}_{m,n}(x) = \min\{k/m : k \in \mathbb{N}, \sigma_1(P_n(A - xI)P_m) \leq k/m\}$$



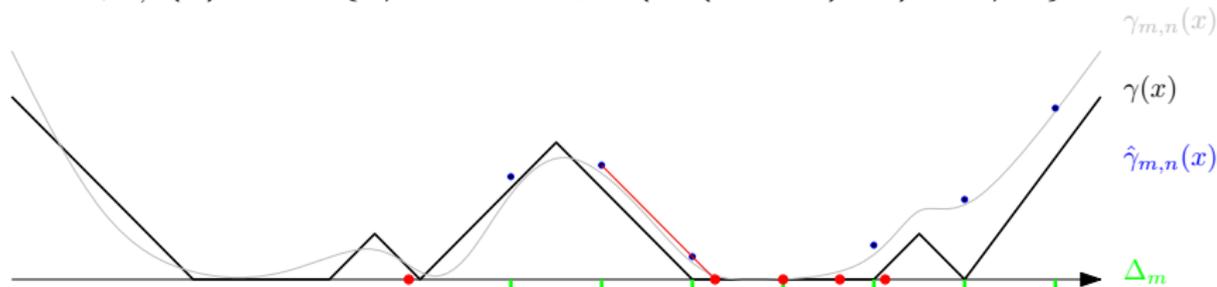
Sei A selbstadjungiert.

Konstruieren $\Gamma_{m,n}(A)$ wie folgt:

- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}(x) \geq 1$: —
- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}$ in x wächst: $x - \hat{\gamma}_{m,n}(x) \mapsto \Gamma_{m,n}(A)$
- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}$ in x fällt: $x + \hat{\gamma}_{m,n}(x) \mapsto \Gamma_{m,n}(A)$

für $x \in \Delta_m$

$$\hat{\gamma}_{m,n}(x) = \min\{k/m : k \in \mathbb{N}, \sigma_1(P_n(A - xI)P_m) \leq k/m\}$$



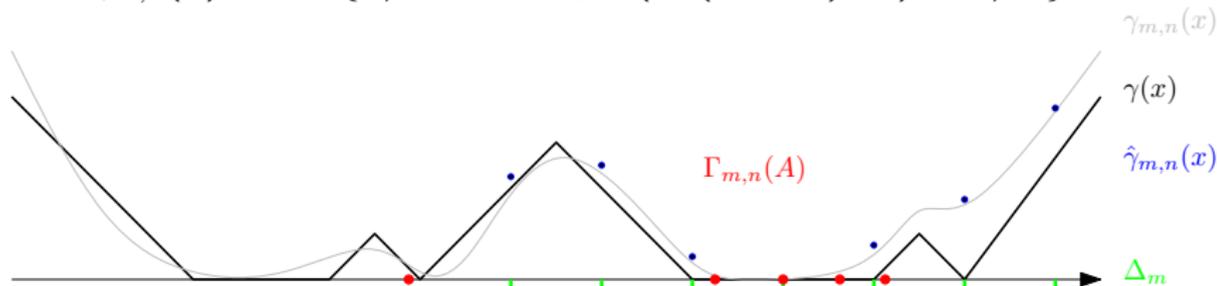
Sei A selbstadjungiert.

Konstruieren $\Gamma_{m,n}(A)$ wie folgt:

- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}(x) \geq 1$: —
- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}$ in x wächst: $x - \hat{\gamma}_{m,n}(x) \mapsto \Gamma_{m,n}(A)$
- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}$ in x fällt: $x + \hat{\gamma}_{m,n}(x) \mapsto \Gamma_{m,n}(A)$

für $x \in \Delta_m$

$$\hat{\gamma}_{m,n}(x) = \min\{k/m : k \in \mathbb{N}, \sigma_1(P_n(A - xI)P_m) \leq k/m\}$$



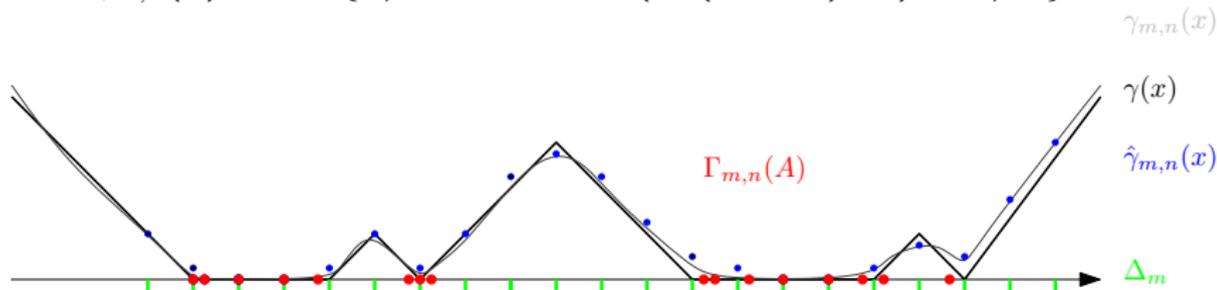
Sei A selbstadjungiert.

Konstruieren $\Gamma_{m,n}(A)$ wie folgt:

- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}(x) \geq 1$: —
- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}$ in x wächst: $x - \hat{\gamma}_{m,n}(x) \mapsto \Gamma_{m,n}(A)$
- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}$ in x fällt: $x + \hat{\gamma}_{m,n}(x) \mapsto \Gamma_{m,n}(A)$

für $x \in \Delta_m$

$$\hat{\gamma}_{m,n}(x) = \min\{k/m : k \in \mathbb{N}, \sigma_1(P_n(A - xI)P_m) \leq k/m\}$$



Sei A selbstadjungiert.

Konstruieren $\Gamma_{m,n}(A)$ wie folgt:

- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}(x) \geq 1$: —
- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}$ in x wächst: $x - \hat{\gamma}_{m,n}(x) \mapsto \Gamma_{m,n}(A)$
- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}$ in x fällt: $x + \hat{\gamma}_{m,n}(x) \mapsto \Gamma_{m,n}(A)$

für $x \in \Delta_m$

$$\hat{\gamma}_{m,n}(x) = \min\{k/m : k \in \mathbb{N}, \sigma_1(P_n(A - xI)P_m) \leq k/m\}$$

Theorem - s.a. Operatoren

S. '13

$$\lim_{m \rightarrow \infty} \lim_{n \rightarrow \infty} \Gamma_{m,n}(A) = \text{sp}(A)$$

folglich

$$SCI(\text{sp}^{sa}) = 2.$$



Sei A selbstadjungiert.

Konstruieren $\Gamma_{m,n}(A)$ wie folgt:

- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}(x) \geq 1$: —
- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}$ in x wächst: $x - \hat{\gamma}_{m,n}(x) \mapsto \Gamma_{m,n}(A)$
- Falls $\hat{\gamma}_{m,n}$ in x fällt: $x + \hat{\gamma}_{m,n}(x) \mapsto \Gamma_{m,n}(A)$

für $x \in \Delta_m$

$$\hat{\gamma}_{m,n}(x) = \min\{k/m : k \in \mathbb{N}, \sigma_1(P_n(A - xI)P_m) \leq k/m\}$$

Theorem - s.a. Band-Operatoren

S. '13

$$\lim_{m \rightarrow \infty} \Gamma_{m,m+b}(A) = sp(A)$$

folglich

$$SCI(sp^{sa,band}) = 1.$$



Der Kreis schließt sich

$\text{SCI}(\text{sp}^{\dots})$	band	allgemein
selbstadjungiert	1	2
allgemein	≥ 2	2 oder 3



Der Kreis schließt sich

$\text{SCI}(\text{sp}^{\dots})$	band	allgemein
selbstadjungiert	1	2
allgemein	2	2 oder 3



Der Kreis schließt sich

$SCI(sp^{\dots})$	band	allgemein
selbstadjungiert	1	2
allgemein	2	3

Umweg über Entscheidungsproblem:

Nevanlinna; S. '14

$$\Sigma : \{a_{i,j}\}_{i,j \in \mathbb{Z}} \mapsto \left(\exists D \forall j \left(\left(\forall i \sum_{k=-i}^i a_{k,j} < D \right) \vee \left(\forall R \exists i \sum_{k=0}^i a_{k,j} > R \wedge \sum_{k=-i}^0 a_{k,j} > R \right) \right) \right)$$



... heavy

$\Sigma : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow \{ja, nein\}, \quad A \mapsto (0 \in sp A)$ Gehört 0 zu $sp A$?



$$\Sigma : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow \{ja, nein\}, \quad A \mapsto (0 \in \text{sp } A) \quad \text{Gehört } 0 \text{ zu } \text{sp } A?$$

Betr. Diagonaloperatoren

$$A = (a_{ij}) = \text{diag} \left\{ 1, \dots, 1, \frac{1}{2}, \dots, \frac{1}{2}, \frac{1}{4}, \dots, \frac{1}{4}, \frac{1}{8}, \dots \right\}$$



$$\Sigma : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow \{ja, nein\}, \quad A \mapsto (0 \in \text{sp } A) \quad \text{Gehört } 0 \text{ zu } \text{sp } A?$$

Betr. Diagonaloperatoren

$$A = (a_{ij}) = \text{diag} \left\{ 1, \dots, 1, \frac{1}{2}, \dots, \frac{1}{2}, \frac{1}{4}, \dots, \frac{1}{4}, \frac{1}{8}, \dots \right\}$$

Offenbar

$$\begin{aligned} 0 \in \text{sp}(A) &\Leftrightarrow a_{ii} \rightarrow_{i \rightarrow \infty} 0 \\ &\Leftrightarrow (b_i) = \left(\frac{1}{2}(a_{i+1,i+1} - a_{ii}) \right) \text{ hat } \infty \text{ viele Einsen} \\ &\quad (\text{"} \infty \text{ viele Stufen auf der Diagonalen"}) \end{aligned}$$



$$\Sigma : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow \{ja, nein\}, \quad A \mapsto (0 \in \text{sp } A) \quad \text{Gehört } 0 \text{ zu } \text{sp } A?$$

Betr. Diagonaloperatoren

$$A = (a_{ij}) = \text{diag} \left\{ 1, \dots, 1, \frac{1}{2}, \dots, \frac{1}{2}, \frac{1}{4}, \dots, \frac{1}{4}, \frac{1}{8}, \dots \right\}$$

Offenbar

$$\begin{aligned} 0 \in \text{sp}(A) &\Leftrightarrow a_{ii} \rightarrow_{i \rightarrow \infty} 0 \\ &\Leftrightarrow (b_i) = \left(\frac{1}{2}(a_{i+1,i+1} - a_{ii}) \right) \text{ hat } \infty \text{ viele Einsen} \\ &\quad (\text{"} \infty \text{ viele Stufen auf der Diagonalen"}) \end{aligned}$$



$$\Sigma : \mathcal{L}(l^2) \rightarrow \{ja, nein\}, \quad A \mapsto (0 \in \text{sp } A) \quad \text{Gehört } 0 \text{ zu } \text{sp } A?$$

Betr. Diagonaloperatoren

$$A = (a_{ij}) = \text{diag} \left\{ 1, \dots, 1, \frac{1}{2}, \dots, \frac{1}{2}, \frac{1}{4}, \dots, \frac{1}{4}, \frac{1}{8}, \dots \right\}$$

Offenbar

$$\begin{aligned} 0 \in \text{sp}(A) &\Leftrightarrow a_{ii} \rightarrow_{i \rightarrow \infty} 0 \\ &\Leftrightarrow (b_i) = \left(\frac{1}{2}(a_{i+1,i+1} - a_{ii}) \right) \text{ hat } \infty \text{ viele Einsen} \\ &\quad (\text{"} \infty \text{ viele Stufen auf der Diagonalen"}) \end{aligned}$$

$$\Rightarrow \text{SCI}(\Sigma^{sa,diag}) \geq 2 \text{ obwohl } \text{SCI}(\text{sp}^{sa,diag}) = 1$$



Über Komplexität mathematischer Probleme: der Solvability Complexity Index

J. Ben-Artzi, A. C. Hansen, O. Nevanlinna, M. Seidel

Workshop Mathematik in Forschung und Lehre

September, 2016