



UNIVERSITÀ
DEGLI STUDI DI MILANO-BICOCCA

SYLLABUS DEL CORSO

Numerical Linear Algebra

2627-1-F4002Q023

Obiettivi

Gli **obiettivi principali** del corso sono:

- Fornire **conoscenze** della SVD, gli algoritmi per il suo calcolo e le sue multiple applicazioni.
- Fornire **conoscenze** dei metodi numerici per la risoluzione di problemi matriciale (tra cui: sistemi lineari & calcolo autovalori)
- Fornire **conoscenze** della costruzione e analisi di algoritmi iterativi di Krylov
- Fornire **conoscenze** della costruzione e analisi di algoritmi randomizzati
- Capacità di **implementare** in modo **efficiente** i diversi algoritmi. Capacità di **interpretare** e **analizzare** i **risultati numerici**

Contenuti sintetici

Il corso inizia studiando gli algoritmi basilari per la risoluzione di problemi che coinvolgono le matrici, tra cui: decomposizione a valori singolari, sistemi lineari, calcolo autovalori e minimi quadrati. Verranno introdotte diverse tecniche basilari per la costruzione e analisi di algoritmi efficienti, a seconda della dimensione delle matrici. In particolare verranno considerati metodi diretti, metodi iterativi e metodi randomizzati.

Gli argomenti verranno coperti dal punto di vista matematico, studiando come costruire e analizzare esplorando le sue proprietà e validando gli algoritmi in problemi concreti.

Programma esteso

- 0- Introduction. Recap on Linear Algebra concepts and basic matrix decompositions.
- 1- SVD and its properties. Applications of SVD. Truncated SVD. Randomized SVD
- 2- Stability. Perturbation Theory. Backward Stability & error analysis
- 3- Direct methods for eigenvalue problems. Recap of direct methods for Linear Systems & LS
- 4- Iterative Methods. Krylov subspace methods (for linear systems and eigenvalue problems)
- 6- Randomised algorithms (for linear systems & least squares). Sketching. Randomized SVD
- 7- Further Applications in Data Mining, Pattern recognition and Machine Learning (this will be study mostly through projects)

Prerequisiti

Si assumono buone conoscenze di Analisi e di Algebra Lineare.

Si assumono conoscenze di Analisi Numerico di Base. Buona conoscenza di MATLAB

Auspicabile: buone conoscenze di base di probabilità

Modalità didattica

Lezioni frontali e nel laboratorio.

MATLAB verrà usato per gli esempi, esercizi, e progetti.

Si offrirà la possibilità (opzionale!) di usare "flipped classroom" (o inverse-blended teaching) per alcuni argomenti del corso, per gli studenti che vogliano aderire.

Materiale didattico

Verranno distribuite slides e note del corso e alcune note/dispense per diversi argomenti

Non si segue un libro unico. Si forniranno anche i programmi.

Bibliografia :

- Lars Elden, Matrix Methods in Data Mining and Pattern Recognition, SIAM (2019)
- N. J. Higham, : Accuracy and Stability of Algorithms, SIAM (2002)
- Horn and Johnson: Matrix Analysis (2012)
- D. S. Watkins, Fundamentals of Matrix Computation, Wiley, (2002)
- D. S. Watkins, The Matrix Eigenvalue Problem: GR and Krylov Subspace Methods, SIAM (2007)
- J. Demmel: Applied Numerical Linear Algebra (1997)
- Per-Gunnar Martinsson & J. Tropp, Randomized Numerical Linear Algebra: Foundations & Algorithms (2021)
- G. Strang, Linear Algebra and Learning from Data, SIAM, (2019)
- G. Strang, Linear Algebra for Everyone, Cambridge (2020)

-Golub-Van Loan : Matrix Computations (2012)
-Trefethen-Bau: Numerical Linear Algebra (1997) (also 2022)

Periodo di erogazione dell'insegnamento

Primo semestre

Modalità di verifica del profitto e valutazione

L'esame consiste di due parti:

- lo sviluppo e la esposizione di un piccolo progetto a scelta e
- una piccola prova finale (orale o scritta) individuale.

Ogni parte verrà valutata indipendentemente e concorrerà in egual misura alla determinazione del voto complessivo finale (sempre che entrambi voti siano maggiore o uguale a 18). Per sostenere la prova finale individuale è necessario ottenere un punteggio maggiore o uguale a 18 sull'progetto. Il voto finale, espresso in trentesimi con eventuale lode, è dato dalla media delle due prove (sempre che entrambi voti siano maggiore o uguale a 18).

Il progetto e la sua esposizione si valuta la conoscenza degli algoritmi sviluppati durante il corso richiedendo la scrittura di alcuni programmi in MATLAB per la risoluzione di problemi matriciali. Viene valutato in termini di completezza, rigore, accuratezza, nonché chiarezza espositiva e capacità di analisi.

Il colloquio orale individuale è teso ad approfondire il livello delle conoscenze acquisite; l'autonomia di analisi e giudizio; le capacità espositive dello studente. In particolare nella suddetta prova orale/scritta si richiede la capacità di esporre gli enunciati e le dimostrazioni dei teoremi, le definizioni, gli esempi/controesempi e le tecniche di calcolo introdotte.

Il progetto potrà essere scelto da un elenco, che verrà messo a disposizione verso la fine del corso e ha validità fino al primo appello della successiva edizione del corso. Solitamente si lavorerà su un argomento applicato o su un paper di ricerca.

È permesso svolgere il progetto in collaborazione con al più due altre persone (cioè, gruppi di un massimo di tre persone). La esposizione sarà individuale.

Una traccia del progetto va consegnata insieme ai nominativi del gruppo, tre-quattro giorni lavorativi prima della data concordata per la esposizione del progetto e la prova finale. Si raccomanda di scriverlo autonomamente. Parte dell'esame verterà sul contenuto dell'a esposizione del progetto, che permetterà valutare la applicazione delle conoscenze acquisite.

A parte del esame gli studenti potranno avere dei punti extra partecipando alle diverse attività di lezione:

Gli studenti che parteciperanno nella "didattica invertita" (flipped classroom) avranno anche il voto extra della loro esposizione.

Gli studenti che parteciperanno alla risoluzione in classe degli esercizi avranno anche un voto extra per la loro partecipazione- esposizione.

Orario di ricevimento

Il ricevimento e per appuntamento via email.

Sustainable Development Goals

ISTRUZIONE DI QUALITÀ | IMPRESE, INNOVAZIONE E INFRASTRUTTURE
