

零知识证明与zk-SNARK

星辰实验室

钟林

lynndell2010@gmail.com

预备知识

多项式时间算法：能够快速计算出结果的算法。

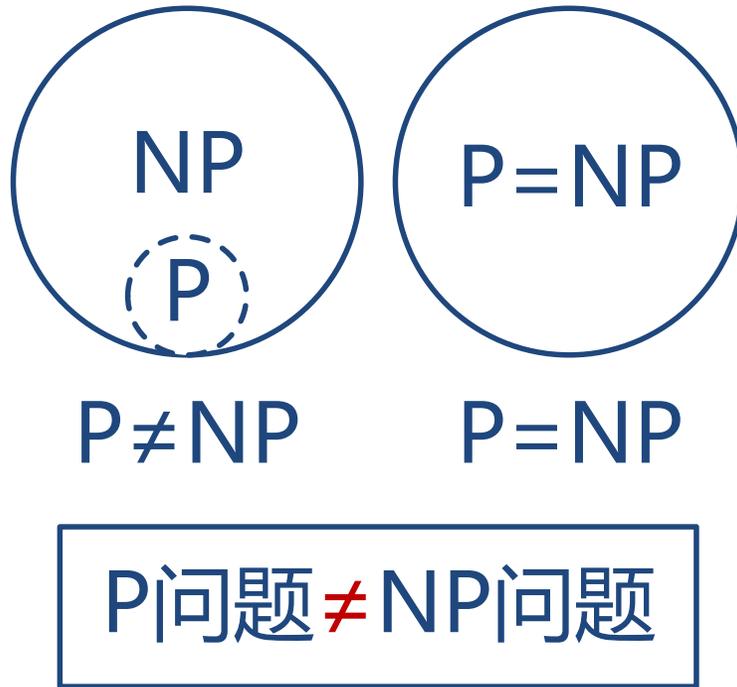
- ① 已知私钥 sk 和椭圆曲线生成元 G ，能够快速计算出公钥 $PK:=sk\cdot G$ 。
- ② 已知原象 x 和哈希函数SHA256，能够快速计算出函数值 $Y:=SHA256(x)$ 。

非多项式时间算法：包括指数时间算法、亚指数时间算法。

以下典型算法需要指数时间：

- ① 已知公钥 PK 和椭圆曲线生成元 G ，不能在多项式时间内计算出私钥 sk ，而需要指数时间才能计算出私钥 sk ，使得 $PK=sk\cdot G$ 成立。
- ② 已知函数值 Y 和哈希函数SHA256，不能在多项式时间内计算出原象 x ，而需要指数时间才能计算出原象 x ，使得 $Y=SHA256(x)$ 成立。

预备知识



预备知识

P问题：在多项式时间内可计算的问题。以下问题是典型的P问题

- ① 已知原象 x 和哈希函数 SHA256，能在多项式时间内计算出函数值 Y ，使得 $Y = \text{SHA256}(x)$ 成立。
- ② 已知私钥 sk 和椭圆曲线生成元 G ，能在多项式时间内计算出公钥 PK ，使得 $PK = sk \cdot G$ 成立。

NP问题：

(1) 多项式时间内不可计算的问题，需要指数时间或亚指数时间；

(2) 但是，一旦已知解，则能够在多项式时间内验证解是否正确。 以下问题是典型NP问题

- ① 已知函数值 Y 和哈希函数 SHA256，不能在多项式时间内计算出原象 x ，使得 $Y = \text{SHA256}(x)$ 成立。但是，一旦已知原象 x ，则能够在多项式时间内验证 x 是否正确。
- ② 已知公钥 PK 和椭圆曲线生成元 G ，不能在多项式时间内计算出私钥 sk ，使得 $PK = sk \cdot G$ 成立。但是，一旦已知私钥 sk ，则能够在多项式时间内验证 sk 是否正确。

NP问题的本质是单向性，不能快速逆向求解，但是能够快速正向验证！

预备知识：重要的NP问题：多项式整除

已知阶为 n 的多项式 $z(x)$ 、阶小于或等于 n 的三组多项式 $u_0(x), \dots, u_n(x); v_0(x), \dots, v_n(x); w_0(x), \dots, w_n(x)$ ，这些多项式等于零的解相同。不能在多项式时间内计算出向量 $s = (1, s_1, \dots, s_m)$ ，满足以下**整除关系**

$$z(x) \left| \left(\sum_{i=0}^m s_i \cdot u_i(x) \right) \cdot \left(\sum_{i=0}^m s_i \cdot v_i(x) \right) - \left(\sum_{i=0}^m s_i \cdot w_i(x) \right) \right.$$

原理分析：

- ① 如果向量元素 s_i 的取值空间为 a ，则将公式 $\left(\sum_{i=0}^m s_i \cdot u_i(x) \right) \cdot \left(\sum_{i=0}^m s_i \cdot v_i(x) \right) - \left(\sum_{i=0}^m s_i \cdot w_i(x) \right)$ 称为**二次算法多项式**，简称为**QAP多项式**。如果 s_i 的取值空间为 $0/1$ ，则称为**二次扩张多项式**，简称为**QSP多项式**。因此，QAP/QSP多项式的构造空间分别为 $a^m/2^m$ ，呈**指数空间**。
- ② $z(x)=0$ 有 n 个解，QAP/QSP多项式等于零的解数量范围为 $(n, 2n]$ 。所以，除 $z(x)=0$ 的 n 个解以外，QAP/QSP多项式等于零还有其他解。因此，可以将QAP/QSP多项式除以 $z(x)$ 得到商多项式 $h(x)$ 。 **$h(x)$ 本质上就是QAP/QSP多项式等于零的其他解构成的多项式。**
- ③ 如果不知道向量 s ，则只能随机选择一个向量 s ，计算QAP/QSP多项式，然后检测 $z(x)$ 与之是否满足整除关系。如果满足，则接受，否则拒绝。因此，需要**指数时间**才能够暴力搜索出向量 s 。但是，一旦给定向量 s ，则能够快速验证构造出的QAP/QSP多项式是否与 $z(x)$ 满足整除关系。

因此，多项式 $z(x)$ 与QAP/QSP多项式的整除关系，满足单项性**，构成NP问题！**

预备知识

密码学的本质：

- ① 将数据放到椭圆曲线离散对数点上，形成**离散对数困难**。
- ② 椭圆曲线离散对数点是群元素，群元素可进行**二元运算**。

零知识证明与zk-SNARK核心技术：

由于用户隐私保护、数据保密性、区块链扩容等应用需求，

- **证明方**：将上述NP问题中QAP/QSP多项式、商多项式和 $z(x)$ 多项式这三个多项式的**系数**放到椭圆曲线离散对数点上（专业术语称为：**多项式承诺**），形成离散对数困难。
- **验证方**：对生成的椭圆曲线离散对数点进行**二元运算，重构整除关系**，能够快速验证向量 s 的正确性，却不知道向量 s 。

预备知识

命题：多项式的值表达等价于多项式的系数表达

- ① 已知变量和多项式的值 $(x_1, f_1), \dots, (x_n, f_n)$ ，能够在多项式时间内求解多项式的系数 k_1, \dots, k_n 。设多项式为

$$f(x) = k_1 \cdot x^1 + k_2 \cdot x^2 + \dots + k_n \cdot x^n$$

因此，能够将方程中的系数 k_1, \dots, k_n 快速求解出来。

其他快速求解方法有：**拉格朗日插值法**、快速傅里叶变换等。

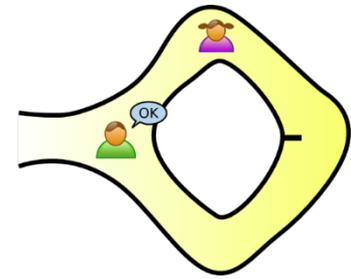
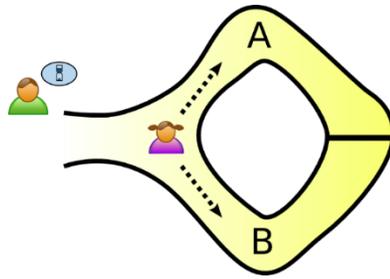
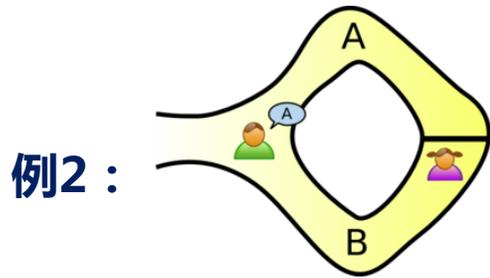
为计算方便，后续的举例将使用**拉格朗日插值法**求解多项式的系数。

- ② 已知变量 x_1, \dots, x_n 和多项式的系数 k_1, \dots, k_n ，能够在多项式时间内计算多项式的值 f_1, \dots, f_n

零知识证明概念

零知识证明：
证明方在不揭露秘密的情况下，使验证方相信某个论断是正确的。

例1：小明在不揭露私钥的情况下，把创世块上的比特币支付到其预先声明的区块，则验证方相信小明是中本聪。



- ① 小红向小明展示洞穴里有个门
- ② **小红向小明证明其知道开门秘诀，但是不能泄露开门秘诀**

- ① 小明去外面（看不见小红）
- ② 小红选择通道A或B藏起来

- ① 小明随机选择通道A或B，**要求小红从规定的通道中出来**
- ② **小红确实从规定的通道中出来**

核心思想

如果图2和图3的游戏仅运行几次，小红可能是碰巧藏在规定的通道中，则能够从规定的通道中走出来，她是不知道开门秘诀的！**但是**，如果游戏重复多次，则小红碰巧成功的概率呈指数降低 $1/2^n$ 。只有知道开门秘诀才可以每次都从规定的通道中走出来；因此，如果小红每次都正确，则小明肯定认可小红知道开门秘诀，但是开门秘诀没泄露。

Sigma零知识证明协议

预备知识

- ① 公钥与私钥满足椭圆曲线离散对数关系： $PK = sk \cdot G$
- ② 椭圆曲线离散对数困难问题：已知公钥PK和G，无法在多项式时间内计算私钥sk。

Sigma零知识证明的目标：证明方证明其知道 ω 且 ω 满足离散对数关系 $Q = \omega \cdot G$

Sigma协议包括以下5个步：

- ① **系统参数**：椭圆曲线生成元： G
- ② **承诺**：证明方选择一个随机数 r ，计算并发送椭圆曲线离散对数点： $C := r \cdot G$
- ③ **挑战**：验证方选择一个随机数 e 并发送
- ④ **响应**：证明方基于随机数 e 构造并发送**线性关系**： $z := r + e \cdot \omega$
- ⑤ **验证**：验证方首先，基于 e 和 z 分别计算椭圆曲线离散对数点： $z \cdot G, e \cdot Q$
然后，在椭圆曲线离散对数点上重构线性关系： $z \cdot G = C + e \cdot Q$
如果**线性关系**重构成功，则接受，否则拒绝

公式展开：左边： $z \cdot G = (r + e \cdot \omega) \cdot G$ ，右边： $C + e \cdot Q = r \cdot G + e \cdot \omega \cdot G = (r + e \cdot \omega) \cdot G$ ，等式成立，验证成功

系统参数： G （双方均知道）；**秘密知识**： r, ω （仅证明方知道）

公开参数： Q, C, e, z （双方均知道）； $z \cdot G, e \cdot Q$ （双方均可计算出）

零知识证明扩展

Sigma协议只证明：

$$\omega \text{ 满足离散对数关系 } Q = \omega \cdot G$$

Sigma协议扩展：zk-SNARK简洁非交互式零知识论证：

$$\omega \text{ 满足任意多项式时间运算关系 } Y = F(\omega)$$

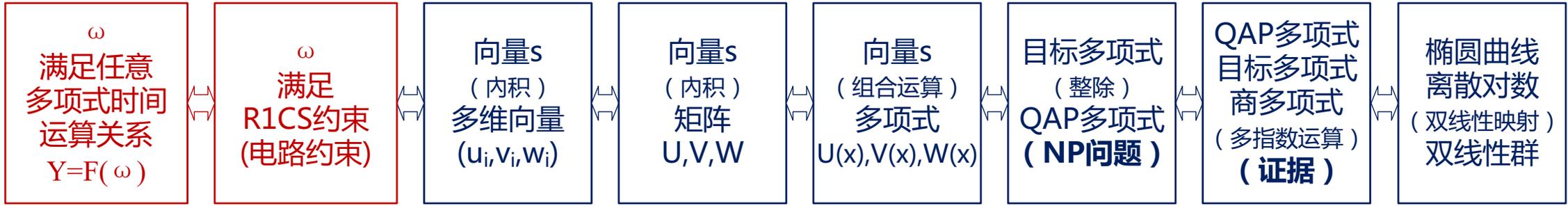
Sigma协议中的离散对数关系 $Q = \omega \cdot G$ 是天然的NP问题。但是，zk-SNARK协议中的任意多项式时间运算关系 $Y = F(\omega)$ 不是天然的NP问题。

接下来使用zk-SNARK中的7个等价转化关系：基于 $Y = F(\omega)$ 构造多项式整除关系，满足NP困难，并使用椭圆曲线离散对数困难，构造零知识。

zk-SNARK 7个等价转化关系如下：



zk-SNARK协议



$$\begin{array}{ccc}
 a \in \{0,1\} & a \oplus b = c & x^4 + x^3 + x^2 + x = 120 \\
 \Updownarrow & \Updownarrow & \Updownarrow \\
 \left. \begin{array}{l} \{(1-a) \times a = 0\} \\ (1-a) \times a = 0 \\ (1-b) \times b = 0 \\ (1-c) \times c = 0 \\ (2a) \times (b) = (a + b - c) \end{array} \right\} & & \left. \begin{array}{l} s_1 = x * x \\ s_2 = s_1 * x \\ s_3 = s_2 * x \\ s_4 = s_1 + x \\ s_5 = s_4 + s_2 \\ 120 = s_5 + s_3 \end{array} \right\}
 \end{array}$$

这些阶为1的等式限定了算法的运算规则，能够用电路约束表达同样的运算规则。电路约束即能用硬件电路或FPGA实现，也可用软件实现等价的功能。因此，阶为1的等式等价于电路约束。

阶为1的等式(R1CS约束)=电路约束
 阶为1的乘法等式=乘法约束
 阶为1的加法等式=加法约束

关键结论：任意多项式时间算法均可以拆为阶为1的等式，等价于电路约束

zk-SNARK协议



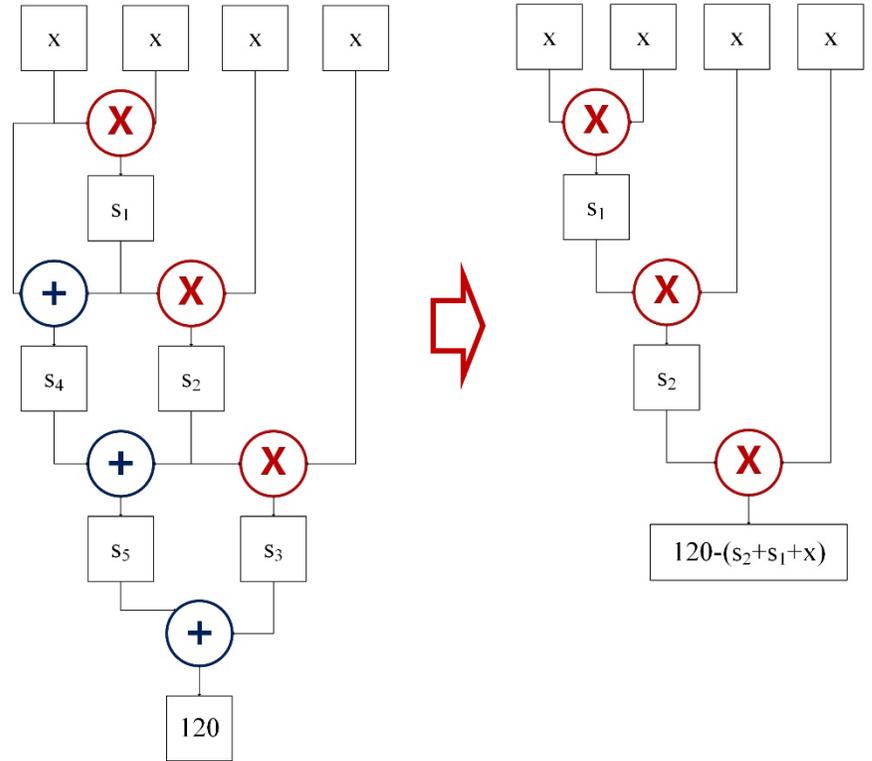
$$x^4 + x^3 + x^2 + x = 120$$

阶为1的等式=电路约束
 阶为1的乘法等式=乘法约束
 阶为1的加法等式=加法约束

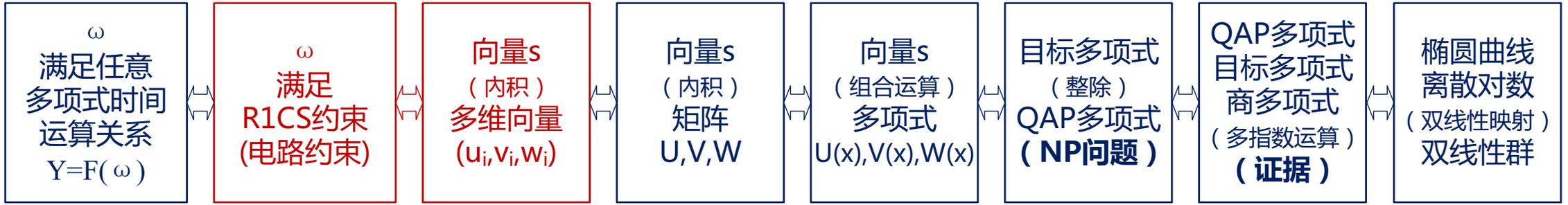
算法的R1CS约束优化：
 可将加法约束耦合到乘法约束中

$$\left\{ \begin{array}{l} s_1 = x * x \\ s_2 = s_1 * x \\ s_3 = s_2 * x \\ s_4 = s_1 + x \\ s_5 = s_4 + s_2 \\ 120 = s_5 + s_3 \end{array} \right.$$

$$\left\{ \begin{array}{l} s_1 = x * x \\ s_2 = s_1 * x \\ 120 - x - s_1 - s_2 = s_2 * x \end{array} \right.$$



zk-SNARK协议



$$s = (statement, witness) = (1, out, x, s_1, s_2)$$

$$\{s_1 = x * x\} \Leftrightarrow \begin{cases} \vec{s} \cdot [0, 0, 0, 1, 0] = [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 0, 0, 1, 0] = s_1 \\ \vec{s} \cdot [0, 0, 1, 0, 0] = [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 0, 1, 0, 0] = x \\ \vec{s} \cdot [0, 0, 1, 0, 0] = [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 0, 1, 0, 0] = x \end{cases}$$

$$\{s_2 = s_1 * x\} \Leftrightarrow \begin{cases} \vec{s} \cdot [0, 0, 0, 0, 1] = [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 0, 0, 0, 1] = s_2 \\ \vec{s} \cdot [0, 0, 0, 1, 0] = [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 0, 0, 1, 0] = s_1 \\ \vec{s} \cdot [0, 0, 1, 0, 0] = [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 0, 1, 0, 0] = x \end{cases}$$

$$\{120 - x - s_1 - s_2 = s_2 * x\} \Leftrightarrow \begin{cases} \vec{s} \cdot [0, 1, -1, -1, -1] = [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 1, -1, -1, -1] = 120 - (x + s_1 + s_2) \\ \vec{s} \cdot [0, 0, 0, 0, 1] = [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 0, 0, 0, 1] = s_2 \\ \vec{s} \cdot [0, 0, 1, 0, 0] = [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 0, 1, 0, 0] = x \end{cases}$$

$$s_1 = x * x$$

$$s_2 = s_1 * x$$

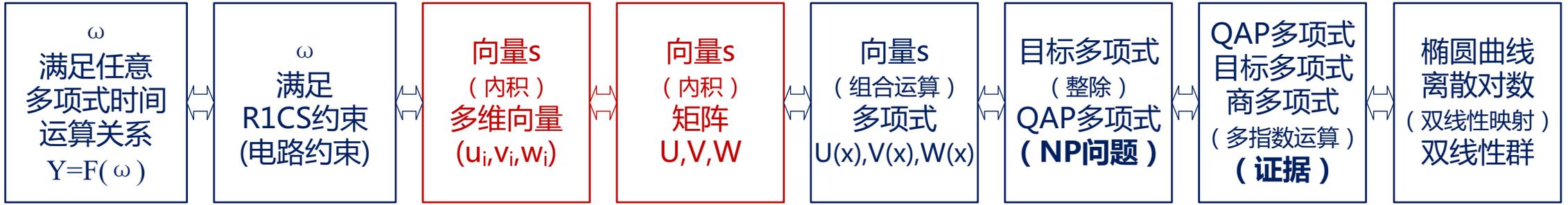
$$120 - x - s_1 - s_2 = s_2 * x$$



$$s(w_1(x), \dots, w_3(x)) = s(u_1(x), \dots, u_3(x)) * s(v_1(x), \dots, v_3(x))$$

关键结论：ω满足R1CS约束等价转化为向量与多维向量的内积

zk-SNARK协议



$$\begin{aligned}
 \{s_1 = x * x\} &\Leftrightarrow \left\{ \begin{aligned} \vec{s} \cdot [0, 0, 0, 1, 0] &= [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 0, 0, 1, 0] = s_1 \\ \vec{s} \cdot [0, 0, 1, 0, 0] &= [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 0, 1, 0, 0] = x \\ \vec{s} \cdot [0, 0, 1, 0, 0] &= [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 0, 1, 0, 0] = x \end{aligned} \right. & W = \begin{bmatrix} 0, 0, 0, 1, 0, \\ 0, 0, 0, 0, 1, \\ 0, 1, -1, -1, -1, \end{bmatrix} \\
 \{s_2 = s_1 * x\} &\Leftrightarrow \left\{ \begin{aligned} \vec{s} \cdot [0, 0, 0, 0, 1] &= [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 0, 0, 0, 1] = s_2 \\ \vec{s} \cdot [0, 0, 0, 1, 0] &= [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 0, 0, 1, 0] = s_1 \\ \vec{s} \cdot [0, 0, 1, 0, 0] &= [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 0, 1, 0, 0] = x \end{aligned} \right. & U = \begin{bmatrix} 0, 0, 1, 0, 0 \\ 0, 0, 0, 1, 0 \\ 0, 0, 0, 0, 1 \end{bmatrix} \\
 \{120 - x - s_1 - s_2 = s_2 * x\} &\Leftrightarrow \left\{ \begin{aligned} \vec{s} \cdot [0, 1, -1, -1, -1] &= [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 1, -1, -1, -1] = 120 - (s_2 + s_1 + x) \\ \vec{s} \cdot [0, 0, 0, 0, 1] &= [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 0, 0, 0, 1] = s_2 \\ \vec{s} \cdot [0, 0, 1, 0, 0] &= [1, out, x, s_1, s_2] \cdot [0, 0, 1, 0, 0] = x \end{aligned} \right. & V = \begin{bmatrix} 0, 0, 1, 0, 0 \\ 0, 0, 1, 0, 0 \\ 0, 0, 1, 0, 0 \end{bmatrix}
 \end{aligned}$$

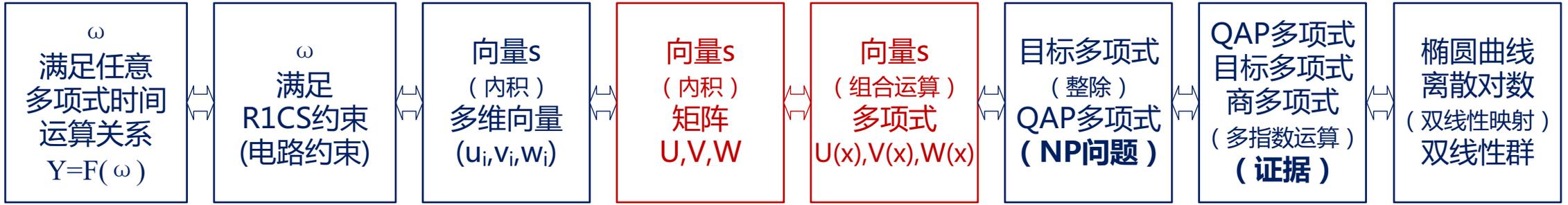
$$s(w_1(x), \dots, w_3(x)) = s(u_1(x), \dots, u_3(x)) * s(v_1(x), \dots, v_3(x))$$



$$s \cdot W = s \cdot U * s \cdot V$$

关键结论：向量与多维向量的内积等价转换为向量与矩阵的内积

zk-SNARK协议



$$W = \begin{bmatrix} 0, 0, 0, 1, 0, \\ 0, 0, 0, 0, 1, \\ 0, 1, -1, -1, -1, \end{bmatrix}, U = \begin{bmatrix} 0, 0, 1, 0, 0 \\ 0, 0, 0, 1, 0 \\ 0, 0, 0, 0, 1 \end{bmatrix}, V = \begin{bmatrix} 0, 0, 1, 0, 0 \\ 0, 0, 1, 0, 0 \\ 0, 0, 1, 0, 0 \end{bmatrix}$$

拉格朗日插值多项式

$$f(x) = \sum_{k=1}^t f_k \prod_{j=1, j \neq k}^t \frac{x - x_j}{x_k - x_j}$$

$$w_1(x) = 0 \frac{(x-2)(x-3)}{(1-2)(1-3)} + 0 \frac{(x-1)(x-3)}{(2-1)(2-3)} + 0 \frac{(x-1)(x-2)}{(3-1)(3-2)} = 0$$

$$w_2(x) = 0 \frac{(x-2)(x-3)}{(1-2)(1-3)} + 0 \frac{(x-1)(x-3)}{(2-1)(2-3)} + 1 \frac{(x-1)(x-2)}{(3-1)(3-2)} = \frac{1}{2}(x^2 - 3x + 2)$$

$$w_3(x) = 0 \frac{(x-2)(x-3)}{(1-2)(1-3)} + 0 \frac{(x-1)(x-3)}{(2-1)(2-3)} - 1 \frac{(x-1)(x-2)}{(3-1)(3-2)} = -\frac{1}{2}(x^2 - 3x + 2)$$

$$w_4(x) = 1 \frac{(x-2)(x-3)}{(1-2)(1-3)} + 0 \frac{(x-1)(x-3)}{(2-1)(2-3)} - 1 \frac{(x-1)(x-2)}{(3-1)(3-2)} = -x^2 + 4x - 4$$

$$w_5(x) = 0 \frac{(x-2)(x-3)}{(1-2)(1-3)} + 1 \frac{(x-1)(x-3)}{(2-1)(2-3)} - 1 \frac{(x-1)(x-2)}{(3-1)(3-2)} = -\frac{1}{2}(3x^2 - 11x + 8)$$

$$W(x) = [w_1(x), w_2(x), w_3(x), w_4(x), w_5(x)], U(x) = [u_1(x), u_2(x), u_3(x), u_4(x), u_5(x)], V(x) = [v_1(x), v_2(x), v_3(x), v_4(x), v_5(x)]$$

$$s \cdot W = s \cdot U * s \cdot V \Leftrightarrow s \cdot W(x) - s \cdot U(x) * s \cdot V(x) = 0$$

关键结论：向量与矩阵的内积等价于向量对多项式的组合运算

zk-SNARK协议



拉格朗日插值多项式的横坐标 $x=1,2,3$ ，所以引入目标多项式 $z(x)=(x-1)(x-2)(x-3)$

当 $x=1,2,3$ ， $z(x)=0$ QAP: $(s \cdot W(x) - s \cdot U(x) * s \cdot V(x)) = 0$

可以计算商多项式 $h(x) = (s \cdot W(x) - s \cdot U(x) * s \cdot V(x)) / z(x)$

$$s \cdot W(x) - s \cdot U(x) * s \cdot V(x) = 0$$

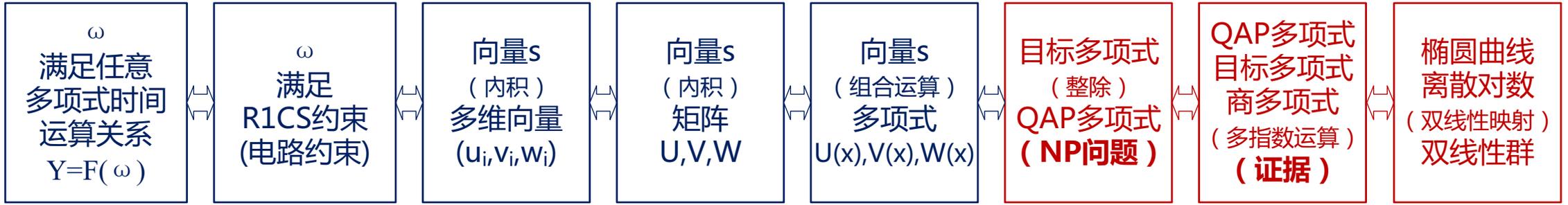


$$z(x) \mid s \cdot W(x) - s \cdot U(x) * s \cdot V(x)$$

关键结论：向量与多项式系数的组合运算等价于目标多项式整除QAP多项式

NP问题：已知目标多项式 $z(x)$ 和三组多项式 $w_1(x), \dots, w_n(x), u_1(x), \dots, u_n(x), v_1(x), \dots, v_n(x)$ ，求向量 s ，使得目标多项式 $z(x)$ 整除QAP多项式 $s \cdot W(x) - s \cdot U(x) * s \cdot V(x)$

zk-SNARK协议



证明方：基于3个多项式构造椭圆曲线离散对数点

| | | |
|--|----------------------------|---|
| $s \cdot W(x) - s \cdot U(x) * s \cdot V(x)$ | 取出系数 a_1, \dots, a_m | 构造椭圆曲线离散对数点 $a_1 \cdot G, \dots, a_m \cdot G$ |
| $z(x)$ | 取出系数 z_1, \dots, z_l | 构造椭圆曲线离散对数点 $z_1 \cdot G, \dots, z_l \cdot G$ |
| $h(x)$ | 取出系数 h_1, \dots, h_{m-l} | 构造椭圆曲线离散对数点 $h_1 \cdot G, \dots, h_{m-l} \cdot G$ |

验证方：基于椭圆曲线离散对数点，使用双线性映射，重构整除关系，完成向量s的正确性验证

$$\vec{e}(a_1 \cdot G, *) = \vec{e}(z_1 \cdot G, *) \cdot \vec{e}(h_1 \cdot G, *)$$

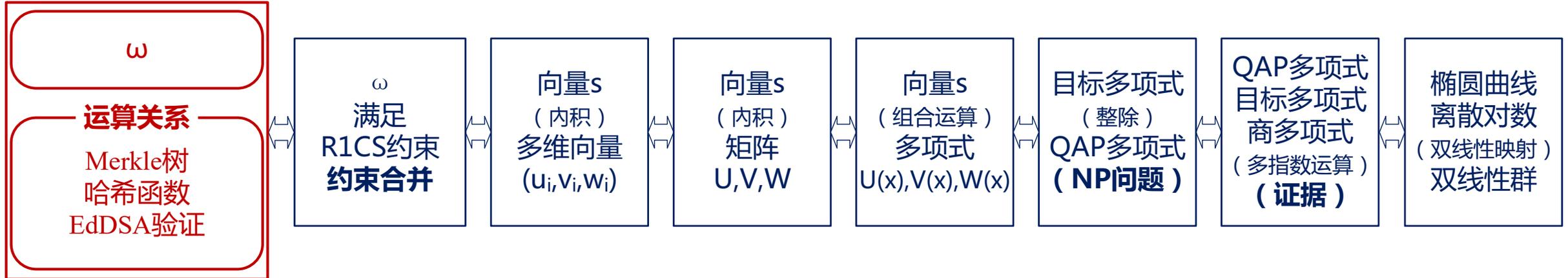
NP问题的可验证性表明：证明方天然知道解向量s，而验证方在椭圆曲线离散对数点上重构整除关系，验证NP问题的正确性，却不知道解向量s。

zk-SNARK典型应用

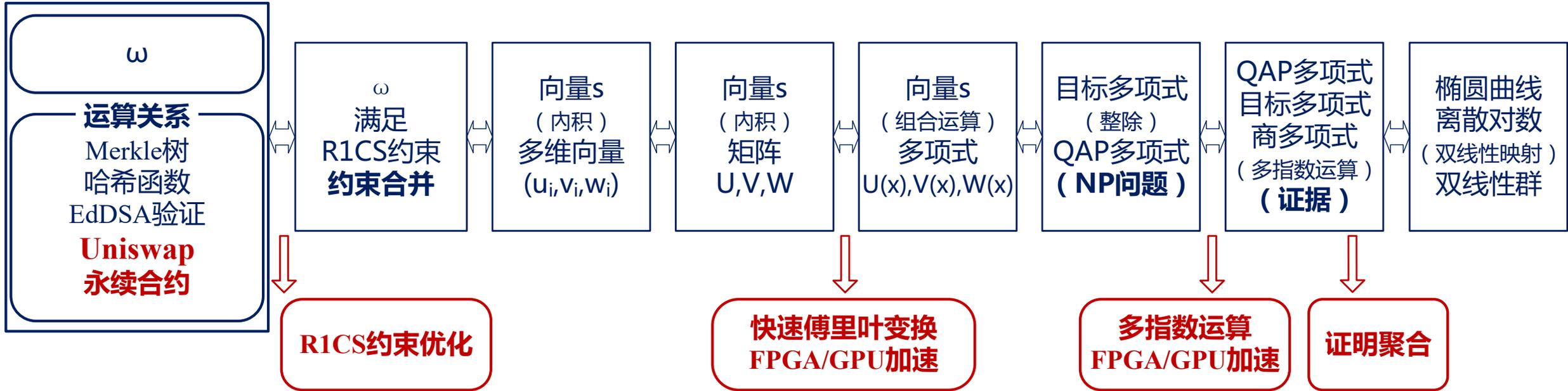
zk-Rollup

数据

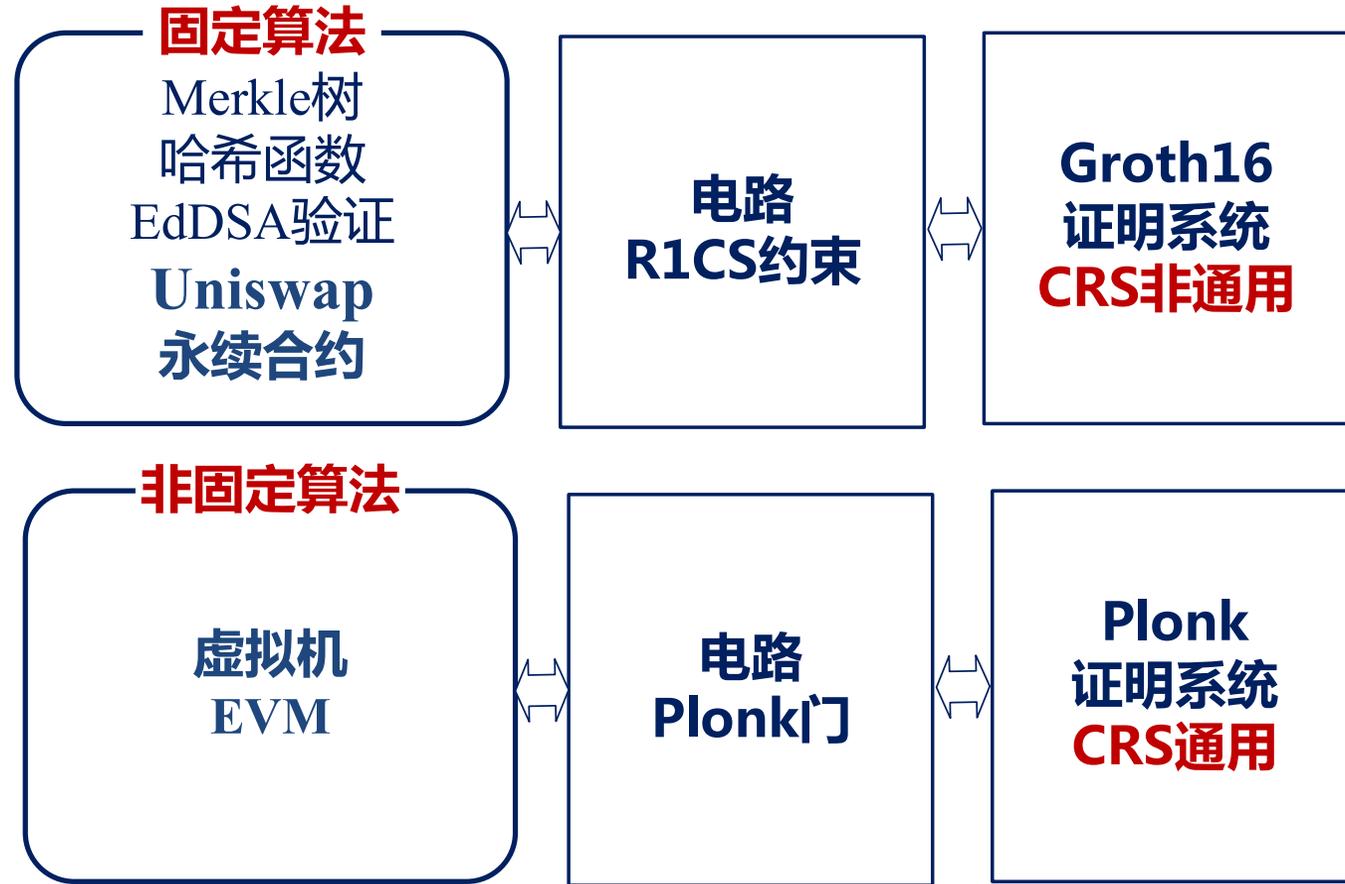
- ① 需要提交一层的数据是公开数据 $statement = (1, MerkleRoot, PubData)$
- ② 剩余的二层所有秘密数据 $witness = (s_1, \dots, s_n)$
- ③ 基于公开数据和隐私数据，构造向量 $s = (statement, witness) = (1, MerkleRoot, PubData; s_1, \dots, s_n)$



贡献



总结与展望



谢谢