

加法的 Schwarz 前処理の実装

鈴木 厚¹

¹ 理研計算科学研究センター 大規模並列数値計算技術研究チーム
atsushi.suzuki.aj@a.riken.jp

METIS を用いた重なりの無い部分行列への分解

```
int nrow, nnz;
int xadj[nrow];           // connectivity of the sparse matrix
int adjcy[nnz - nrow];    // excluding diagonal from CSR
int part[nrow];
int ncon = 1, objval;
idx_t options[METIS_NOPTIONS] = {0} ;
METIS_SetDefaultOptions(options);
options[METIS_OPTION_NUMBERING] = 0;
options[METIS_OPTION_DBGLVL] = METIS_DBG_INFO;
METIS_PartGraphRecursive(&nrow, &ncon, xadj, adjcy,
                        NULL, NULL, NULL,
                        &nparts,
                        NULL, NULL,
                        options, &objval, part);
```

添字集合 $\Lambda = \{1, 2, \dots, N\}$ は重なりのない分割の添字集合 Λ_p の和集合からなる

$$\Lambda = \bigoplus_{1 \leq p \leq P} \Lambda_p \quad \Lambda_p \cap \Lambda_q = \emptyset \quad (p \neq q)$$

配列 $\text{part}[k]$ $1 \leq k \leq N$ 添字 $1 \leq p \leq P$ の部分行列への対応を表わす

$$\Lambda_p = \{k \in \{1, \dots, N\}; \text{part}[k] = p\}$$

重なりの無い分割から重なりのある分割の生成

重なりの無い分割 $\Lambda = \bigoplus_{1 \leq p \leq P} \Lambda_p$ $\Lambda_p \cap \Lambda_q = \emptyset$ の部分行列の添字集合 $\Lambda_p^{(0)} = \Lambda_p$ から始めて l 回目から $l+1$ 回目の集合

$$\Lambda_p^{(l+1)} = \{j; [A]_{ij} \neq 0 \ i \in \Lambda_p^{(l)}\}$$

を生成する: $\Lambda_p = \Lambda_p^{(0)} \subset \Lambda_p^{(1)} \subset \dots$

この操作はマスクベクトルを更新することで実現する

```
structure CSRformat acsr;
std::vector<std::vector<int> > mask[nparts];
for (int n = 0; n < nparts; n++) mask[n].resize(nrow, 0);

for (int i = 0; i < nrow; i++)
    mask[part[i]][i] = 1;           // masking domain n == part[i]

for (int n = 0; n < nparts; n++) {
    for (int ll = 0; ll < noverlap; ll++) {
        std::vector<int> itmp(mask[n]); // copy mask[n] to itmp
        for (int i = 0; i < nrow; i++) {
            if (itmp[i] == 1) {
                for (int k = acsr.ptrow[i]; k < acsr.ptrow[i + 1]; k++)
                    mask[n][acsr.indcol[k]] = 1;
            }
        }
    }
}
```

単位の分解の構成

離散的な単位の分解

$$\sum_{p=1}^P R_p^T D_p R_p = I_N,$$

$$[D_p]_{kk} = \begin{cases} 1 & k \in \Lambda_p, k \notin \Lambda_q, \forall q \neq p, \\ 1/\#\{p; k \in \Lambda_p\} & \text{それ以外} \end{cases}$$

重なりのある添字分割を保持する mask 配列から, 制限作用素 R_p と重み D_p を次のように生成する

```
std::vector<std::vector<int> > local2global(nparts);  
std::vector<double> weightPTU(nrow, 0.0);
```

```
for (int n = 0; n < nparts; n++) {  
    for (int i = 0; i < nrow; i++) {  
        if (mask[n][i] == 1) {  
            local2global[n].push_back(i);  
            weightPTU[i] += 1.0;  
        }  
    }  
}  
for (int i = 0; i < nrow; i++) {  
    weightPTU[i] = 1.0 / weightPTU[i];  
}
```

全体行列から添字 n の部分行列を抜きだすことは $\text{mask}[n]$ ベクトルと写像 $\text{local2global}[n]$ によって行う.

重なりのある部分領域への疎行列のデータ分散 : 1/5

添字 p の行列は制限作用素 R_p から次のように生成される

$$A_p = R_p A R_p^T, \quad A = \sum_p R_p^T D_p A_p R_p$$

行列-ベクトル積は部分行列 A_p 毎の積の重み付きの和から計算される

$$\begin{aligned} \vec{y} = A\vec{x} &= \sum_p R_p^T D_p A_p R_p \vec{x} \\ &= \sum_p R_p^T D_p A_p \vec{x}_p \end{aligned}$$

$\vec{x}_p$: は添字集合 Λ_p の部分ベクトル

- ▶ 部分行列での疎行列-ベクトル積演算 (SpMV) $\vec{y}_p = A_p \vec{x}_p$
- ▶ 重み D_p 付き総和計算, $\vec{y} = \sum_p R_p^T D_p \vec{y}_p$

総和計算には異なるプロセッサに割り当てられたデータの通信が必要

重なりのある部分領域への疎行列のデータ分散 : 2/5

重み付き総和計算 $\vec{y} = \sum_p R_p^T D_p \vec{y}_p$ の最も簡単な実装方法

- ▶ $\vec{y}_p = A_p \vec{x}_p$ を部分行列毎に実行する
- ▶ 長さ N の全体配列 $\vec{z}_p \in \mathbb{R}^N$ を準備して部分添字集合 Λ_p 以外を零で埋める

$$[\vec{z}_p]_{i \neq \Lambda_p} = 0$$

$$[\vec{z}_p]_{\lambda_p(j)} = [\vec{y}_p]_j \quad \lambda_p : \{1, \dots, N_p\} \rightarrow \Lambda_p \subset \{1, \dots, N\}$$

プロセッサ全にあるデータ $\vec{z}_p$ を全て足し込む総和演算を実行する

```
MPI_Allreduce( $\vec{z}_p, \vec{y}$ , nrow, MPI_DOUBLE, MPI_SUM,  
MPI_COMM_WORLD);
```

部分行列の内部にある (部分行列の重なりのある部分を除いた) データの添字は $\Lambda_{p,I} \cap \Lambda_q = \emptyset (\forall q \neq p)$ と表現されるが, そこでは他の部分行列での値は 0 として和の演算が実行される

重なりのある部分領域への疎行列のデータ分散 : 3/5

部分行列の内部で 0 を足し込む不要な演算を避けるために
部分行列の添え字集合を部分行列内部と境界に分割する

$$\Lambda_p = \Lambda_{p,I} \oplus \Lambda_{p,B} \quad \Lambda_{p,I} \cap \Lambda_q = \emptyset \quad \forall q \neq p \quad \exists r \Lambda_{p,B} \cap \Lambda_r \neq \emptyset$$

この分割により総和計算は部分行列の境界で実行して, 部分行列内部はそのままデータを移動するだけで済むことが分る

$$\begin{aligned} \vec{y} &= \sum_p R_p^T D_p \vec{y}_p \\ &= \left(\{R_{p,I}^T D_{p,I} \vec{y}_{p,I}\}, \sum_q R_{q,B}^T D_{q,B} \vec{y}_{q,B} \right) \end{aligned}$$

部分行列の添え字集合の内部と境界への分割 $\Lambda_p = \Lambda_{p,I} \cup \Lambda_{p,B}$ は単位の分解により設定できる

$$i \in \Lambda_{p,I} \Leftrightarrow [D_p]_i = 1$$

$$i \in \Lambda_{p,B} \Leftrightarrow [D_p]_i < 1$$

```
std::vector<std::vector<int> > localI2global(nparts);  
std::vector<std::vector<int> > localB2global(nparts);  
// n fixed  
for (std::vector<int>::iterator it = local2global[n].begin();  
     it != local2global[n].end(); ++it) {  
    if (weightPTU((*it) == 1.0)  
        localI2global[n].push_back((*it));  
    else  
        localB2global[n].push_back((*it));  
}
```

重なりのある部分領域への疎行列のデータ分散 : 4/5

近接間通信による部分領域毎のデータの更新

$$\Lambda_p = \Lambda_{p,I} \oplus \Lambda_{p,B} \quad \Lambda_{p,I} \cap \Lambda_q = \emptyset \quad \forall q \neq p \quad \text{に追加して } \exists r \quad \Lambda_{p,B} \cap \Lambda_r \neq \emptyset$$
$$\Lambda_{p,r} = \Lambda_{p,B} \cap \Lambda_{r,B} \quad p \text{ と } r \text{ の間でのデータ転送}$$

部分領域とその境界の添え字の間の対応

$$\{1, \dots, N_p\} \ni i \mapsto \lambda_p(i) \in \Lambda_p \subset \Lambda \quad \text{全体}$$
$$\{1, \dots, N_{p,B}\} \ni i \mapsto \lambda_{p,B}(i) \in \Lambda_{p,B} \subset \Lambda_p \quad \text{全体}$$
$$\{1, \dots, N_{p,B}\} \ni i \mapsto \hat{\lambda}_{p,B}(i) \in \{1, \dots, N_p\} \quad \hat{\Lambda}_{p,B} = \{\hat{\lambda}_{p,B}(i); i \in \{1, \dots, N_{p,B}\}\}$$

$\hat{\Lambda}_{p,r} \subset \hat{\Lambda}_{p,B} : \hat{\Lambda}_{r,B}$ のデータを共有する境界での部分添字

- ▶ 領域 p でデータ $\hat{\Lambda}_{p,r}$ を準備
- ▶ データを領域 r へ送信
- ▶ 領域 r からのデータを受信
- ▶ 領域 p でデータ $\hat{\Lambda}_{p,r}$ を展開

```
MPI_Isend( &senddata[0], nsenddata, MPI_DOUBLE, destrank, 0,  
          MPI_COMM_WORLD, &requests[0]);  
MPI_Irecv( &recvdata[0], nsenddata, MPI_DOUBLE, srcrank, 0,  
          MPI_COMM_WORLD, &requests[1]);  
MPI_Waitall( 2, &requests[0], &statuses[0]);
```

重なりのある部分領域への疎行列のデータ分散 : 5/5

内積演算は単位の分解の重みよりベクトルのデータの移動は不要

$$\begin{aligned}(\vec{x}, \vec{y}) &= (\vec{x}, \sum_p R_p^T D_p \vec{y}_p) \\&= \sum_p (R_p \vec{x}, D_p \vec{y}_p) \\&= \sum_p (\vec{x}_p, D_p \vec{y}_p) \\&= \sum_p (\vec{x}_{p,I}, \vec{y}_{p,I}) + \sum_p (\vec{x}_{p,B}, \vec{y}_{p,B})\end{aligned}$$

部分行列での重み付き内積の演算結果をスカラーの総和計算でまとめる
`MPI_Allreduce(local, global, 1, MPI_DOUBLE, MPI_SUM,
MPI_COMM_WORLD);`

実習：IML++ の C++ で記述された GMRES を実装する：1/3

IML++, <https://math.nist.gov/iml++/gmres.h.txt> では GMRES は C++ で記述されている

最初の実装は前処理 `const Preconditioner &M` 無しで `Operator`, `Vector` と `Matrix` クラスを簡単なもので置き換える

- ▶ `Real` は `double`
- ▶ `Vector` は `std::vector<double>`
- ▶ `Operator` は `struct CSRformat`
- ▶ `Matrix` は 一次元配列 `std::vector<double>` を二つの添え字で参照するものとして

```
std::vector<double> HH((max_iter + 1) * (max_iter + 1));  
#define H(i, j) HH((i) + (j) * (max_iter + 1))
```

残差ベクトルを計算する

```
r = b - A * x;
```

は C++ の演算子で記述されているが、疎行列の GEMV ルーチンで置き換える

```
std::vector<double> r(b);  
SparseGEMV(A, (-1.0), x, 1.0, r);
```

実習 : IML++ の C++ で記述された GMRES を実装する : 2/3

```
template < class Operator, class Vector, class Preconditioner,
           class Matrix, class Real >
int
GMRES(const Operator &A, Vector &x, const Vector &b,
      const Preconditioner &M, Matrix &H, int &m, int &max_iter,
      Real &tol)
{
    Real resid;
    int i, j = 1, k;
    Vector s(m+1), cs(m+1), sn(m+1), w;

    Real normb = norm(M.solve(b));
    Vector r = M.solve(b - A * x);
```

→ テンプレートの利用を止める

```
int
GMRES(csr_matrix &A, std::vector<double> &x, std::vector<double> &b,
      int &m, int &max_iter,
      double &tol)
{
    double resid;
    int nrow = x.size();
    int i, j = 1, k;
    std::vector<double> s(m+1, 0.0), cs(m+1), sn(m+1), w(nrow);
    std::vector<double> HH((max_iter + 1) * (max_iter + 1));

    double normb = norm(b);
    // r = Precond(A, b, x);
```

実習 : IML++ の C++ で記述された GMRES を実装する : 3/3

- ▶ 前処理操作 `const Preconditioner &M` に加法的 **Schwarz** 法 を用いる
 - ▶ 部分行列の生成は **METIS** を用いる
 - ▶ 部分行列の解法は直接法を用いる (シンボリック分解 + 数値分解+ 前進消去/後退代入)
- ▶ 総和計算には **MPI** の **Allreduce** 関数を用いる.

```
int mpi_id, mpi_procs;
MPI_Init(&argc, &argv);
MPI_Comm_rank(MPI_COMM_WORLD, &mpi_id);
MPI_Comm_size(MPI_COMM_WORLD, &mpi_procs);

MPI_Allreduce(&tmps[0], &rhs[0], nrow, MPI_DOUBLE, MPI_SUM,
              MPI_COMM_WORLD);

MPI_Finalize();
```

C/C++ からの Pardiso の利用

```
MKL_INT *ptrow = new MKL_INT[n + 1]; // CSR data
MKL_INT *indcol = new MKL_INT[nnz];
double *coef = new double[nnz];
double *x = new double[n]; // solution
double *y = new double[n]; // RHS
void *pt[64]; // to keep internal pointers
for (int i = 0; i < 64; i++)
    pt[i] = (void *)0; // zero clear
MKL_INT *iparm = new MKL_INT[64]; // parameters!
MKL_INT mtype = 11; // structurally symmetric
MKL_INT nrhs = 1;
MKL_INT phase;
MKL_INT maxfct = 1, mnum = 1, msglvl = 1, error;
MKL_INT idum; // dummy pointer instead of user
                // providing permutation
phase = 11; // symbolic factorization
pardiso(pt, &maxfct, &mnum, &mtype, &phase, &n,
        (void *)coef, ptrow, indcol, &idum, &nrhs,
        iparm, &msglvl, (void *)y, (void *)x,
        &error);
phase = 22; // numeric factorization
phase = 33; // Fw/Bw substitution
phase = -1; // free working data
```

C/C++ からの MUMPS の利用

```
MUMPS_INT *irow = new MUMPS_INT[nnz];
MUMPS_INT *jcol = new MUMPS_INT[nnz];
double *coef = new double[nnz];
double *x = new double[n]; // solution&RHS
DMUMPS_STRUC_C id;
id.job = (-1); // job init
id.par = 1;
id.sym = isSym ? 2 : 0;
id.comm_fortran = USE_COMM_WORLD; // dummy MPI communicator
dmumps_c(&id);
id.job = 1; // symbolic facotrization
id.n = n; id.nz = nnz; id.irn = irow; id.jcn = jcol;
// id.icntl[] set parameters
dmumps_c(&id);
id.job = 2; // numeric factorization
id.a = coef;
dmumps_c(&id);
id.job = 3; // Fw/Bw substitution
id.nrhs = 1;
id.rhs = x;
dmumps_c(&id);
id.job = -2; // free working data
```

PETSc ライブラリー : 6/7

ksp/tutorial/ex8.c は加法的 Schwarz 前処理の例を示す

```
#include <petscksp.h>

int main(int argc, char **args)
{
    Vec x, b, u;           /* approx solution, RHS, exact solution */
    Mat A;                 /* linear system matrix */
    KSP ksp;               /* linear solver context */
    PC pc;                 /* PC context */
    IS *is, *is_local;     //
    PetscInt overlap = 1;  /* width of subdomain overlap */
    PetscInt Nsub;         /* number of subdomains */
    PetscInt m = 15, n = 17; /* mesh dimensions in x- and y- directions */
    PetscInt M = 2, N = 1;  /* number of subdomains in x- and y- directions */
    PetscInt i, j, Ii, J, Istart, Iend;
    PetscMPIInt size;

    PetscInitialize(&argc, &args, (char *)0, help);
    MPI_Comm_size(PETSC_COMM_WORLD, &size);

    MatCreate(PETSC_COMM_WORLD, &A);
    MatSetSizes(A, PETSC_DECIDE, PETSC_DECIDE, m * n, m * n);
    MatSetFromOptions(A);
    MatSetUp(A);
    MatGetOwnershipRange(A, &Istart, &Iend);
    for (Ii = Istart; Ii < Iend; Ii++) {
        // MatSetValues(A, 1, &Ii, 1, &J, &v, INSERT_VALUES);
    }
}
```

[ksp/tutorial/ex8.c](#) は加法的 Schwarz 前処理の例を示す

```
MatAssemblyBegin(A, MAT_FINAL_ASSEMBLY);
MatAssemblyEnd(A, MAT_FINAL_ASSEMBLY);

KSPCreate(PETSC_COMM_WORLD, &ksp);
KSPSetOperators(ksp, A, A);
KSPGetPC(ksp, &pc);
PCSetType(pc, PCASM);
PCASMSetOverlap(pc, overlap);
KSPSetFromOptions(ksp);
KSPSolve(ksp, b, x);
```

行列の分割の指定方法

- ▶ $m \times n$ の直交格子からなる計算領域を $M \times N$ の部分領域に分割するには

```
PCASMCCreateSubdomains2D(m, n, M, N, 1, overlap, &Nsub,
                          &is, &is_local);
PCASMSetLocalSubdomains(pc, Nsub, is, is_local);
```

- ▶ ユーザー定義の分割を実現するには

```
PCASMSetLocalSubdomains(pc, Nsub, is, is_local);
```

整数 Nsub : 部分行列の総数

ポインター IS *is : 重なりのある部分行列の添字集合

ポインター IS *is_local : 部分行列の内部の自由度の添字集合