

Lineáris egyenletrendszerek

Lineáris egyenletrendszer

- Lineáris egyenlet
 - algebrai egyenlet
 - konstansok és első fokú ismeretlenek
 - pl.: egyenes egyenlete $y = ax + b$
- Lineáris egyenletrendszer
 - lineáris egyenletek csoportja
 - ugyan azon a változó halmazon

Jakobi iteráció

- Lineáris egyenletrendszer

$$\underline{\underline{B}} \underline{x} = \underline{b}$$

$$\underline{x} + \underline{\underline{B}} \underline{x} = \underline{x} + \underline{b}$$

$$\underline{x} = \underbrace{\left(\underline{1} - \underline{\underline{B}} \right)}_{\underline{\underline{A}}} \underline{x} + \underline{b}$$



$$\boxed{\underline{x} = \underline{\underline{A}} \underline{x} + \underline{b}}$$

Jakobi iteráció

- Mikor oldható meg?

$$\underline{x} = \underline{\underline{A}} \underline{x} + \underline{b}$$

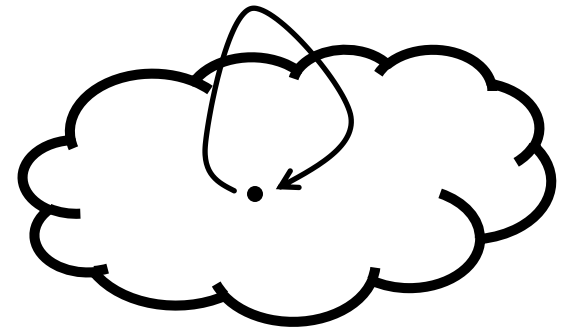
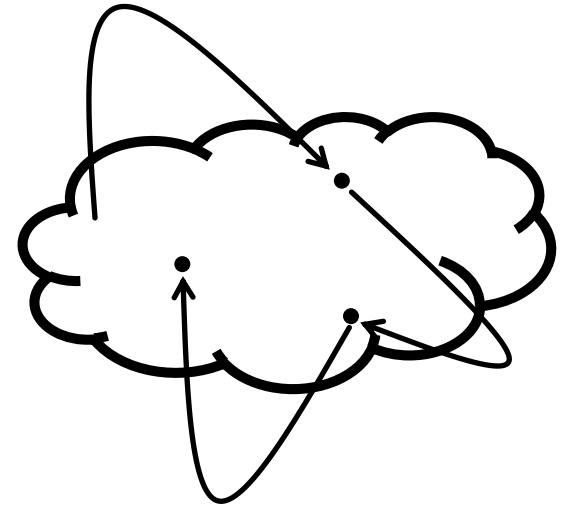
- Ha konvergens

$$\underline{x}_{n+1} = \underline{\underline{A}} \underline{x}_n + \underline{b}$$

$$\lim x_{n+1} \rightarrow x^*$$

$$\lim x_n \rightarrow x^*$$

$$\underline{x}^* = \underline{\underline{A}} \underline{x}^* + \underline{b}$$



Fix pont

Jakobi iteráció

- Mikor konvergens?

- Ha \underline{A} kompatibilis \underline{x} valamely normájával.
- Norma
 - Egy vektorteren értelmezett leképezés, amely a nullvektor kivételével a tér minden vektorához egy pozitív számot rendel.

$$d(x) \geq 0$$

$$d(x) = 0 \quad \text{a.c.s.a., ha} \quad x = 0$$

$$d(x + y) \leq d(x) + d(y)$$

$$d(\lambda x) = |\lambda| d(x)$$

Jakobi iteráció

- Normák

- p-norma (Hölder-norma)

$$\|x\|_p := \left(\sum_{i=1}^n |x_i|^p \right)^{1/p}$$

- 1-norma

$$\|x\|_1 = \sum_{i=1}^n |x_i|$$

- 2-norma

$$\|x\|_2 = \sqrt{\sum_{i=1}^n |x_i|^2}$$

- Végtelen norma

$$\|x\|_\infty = \max_{i=1}^n |x_i|$$

Jakobi iteráció

■ Mátrixnormák

- A vektornormák mátrixnormákat indukálnak.

$$\|A\|_M = \sup_{x \neq 0} \frac{\|Ax\|_v}{\|x\|_v} = \sup_{\|x\|_v=1} \|Ax\|_v$$

- Linearitás miatt elég az 1 normájú vektorokat tekinteni.
- Kompakt halmaz, így a folytonos $\|Ax\|_v$ függvény felveszi a maximumát.

- A mátrixnormákra teljesül

$$\|A \cdot B\| \leq \|A\| \cdot \|B\|$$

$$\|Ax\|_v \leq \|A\|_M \cdot \|x\|_v$$

Jakobi iteráció

■ Iterációs megoldás

$$\underline{x}_{n+1} = \underline{\underline{A}} \underline{x}_n + \underline{b}$$

$$\underline{x}_n = \underline{\underline{A}} \underline{x}_{n-1} + \underline{b}$$

■ Bizonyítás

$$(\underline{x}_{n+1} - \underline{x}_n) = \underline{\underline{A}}(\underline{x}_n - \underline{x}_{n-1})$$

$$\|\underline{x}_{n+1} - \underline{x}_n\| = \|\underline{\underline{A}}(\underline{x}_n - \underline{x}_{n-1})\| \leq \underbrace{\|\underline{\underline{A}}\|}_{\lambda} \cdot \|\underline{x}_n - \underline{x}_{n-1}\| \quad \|\underline{\underline{A}}\| < 1$$

$$0 \leq \underbrace{\|\underline{x}_{n+1} - \underline{x}_n\|}_{\downarrow 0} \leq \lambda \|\underline{x}_n - \underline{x}_{n-1}\| \leq \lambda^2 \|\underline{x}_{n-1} - \underline{x}_{n-2}\| \leq \dots \leq \underbrace{\lambda^n}_{\downarrow 0} \|\underline{x}_1 - \underline{x}_0\|$$

■ Rendőr szabály!

$$\boxed{\underline{0}, \underline{b}, \underline{\underline{A}}\underline{b}, \underline{\underline{A}}^2 \underline{b} \dots \leq \lambda^n \|\underline{b}\|}$$

Jakobi iteráció

■ Iterációs megoldás

```
void jakobi(){  
    ...  
    int inputBuffer = 0;  
    const int iterations = 20;  
    for(int i = 0; i < iterations; ++i){  
        mulMatrixVector(n, n, x[(inputBuffer + 1) % 2], A, x[inputBuffer], b);  
        inputBuffer = (inputBuffer + 1) % 2;  
    }  
    ...  
}
```

Jakobi iteráció

■ Iterációs megoldás

$$\underline{\underline{A}} = 0.5 \cdot \underline{\underline{I}} \quad \underline{b} = [1] \quad \underline{x} = [0]$$

```
Jakobi x: [1, 1, 1, 1, 1, 1, 1, 1]
Jakobi x: [1.5, 1.5, 1.5, 1.5, 1.5, 1.5, 1.5, 1.5]
Jakobi x: [1.75, 1.75, 1.75, 1.75, 1.75, 1.75, 1.75, 1.75]
Jakobi x: [1.875, 1.875, 1.875, 1.875, 1.875, 1.875, 1.875, 1.875]
Jakobi x: [1.9375, 1.9375, 1.9375, 1.9375, 1.9375, 1.9375, 1.9375, 1.9375]
Jakobi x: [1.96875, 1.96875, 1.96875, 1.96875, 1.96875, 1.96875, 1.96875, 1.96875]
Jakobi x: [1.98438, 1.98438, 1.98438, 1.98438, 1.98438, 1.98438, 1.98438, 1.98438]
Jakobi x: [1.99219, 1.99219, 1.99219, 1.99219, 1.99219, 1.99219, 1.99219, 1.99219]
Jakobi x: [1.99609, 1.99609, 1.99609, 1.99609, 1.99609, 1.99609, 1.99609, 1.99609]
Jakobi x: [1.99805, 1.99805, 1.99805, 1.99805, 1.99805, 1.99805, 1.99805, 1.99805]
Jakobi x: [1.99902, 1.99902, 1.99902, 1.99902, 1.99902, 1.99902, 1.99902, 1.99902]
Jakobi x: [1.99951, 1.99951, 1.99951, 1.99951, 1.99951, 1.99951, 1.99951, 1.99951]
Jakobi x: [1.99976, 1.99976, 1.99976, 1.99976, 1.99976, 1.99976, 1.99976, 1.99976]
Jakobi x: [1.99988, 1.99988, 1.99988, 1.99988, 1.99988, 1.99988, 1.99988, 1.99988]
Jakobi x: [1.99994, 1.99994, 1.99994, 1.99994, 1.99994, 1.99994, 1.99994, 1.99994]
Jakobi x: [1.99997, 1.99997, 1.99997, 1.99997, 1.99997, 1.99997, 1.99997, 1.99997]
Jakobi x: [1.99998, 1.99998, 1.99998, 1.99998, 1.99998, 1.99998, 1.99998, 1.99998]
Jakobi x: [1.99999, 1.99999, 1.99999, 1.99999, 1.99999, 1.99999, 1.99999, 1.99999]
Jakobi x: [2, 2, 2, 2, 2, 2, 2, 2]
Jakobi x: [2, 2, 2, 2, 2, 2, 2, 2]
```

Mátrix vektor szorzás

■ CPU implementáció

```
void scalarMV(int n, int m,  
              float* y, const float* A,  
              const float* x, const float* b){  
    for(int i=0; i<n; ++i){  
        float yi = b[i];  
        for(int j=0; j<m; ++j){  
            yi += A[i * m + j] * x[j];  
        }  
        y[i] = yi;  
    }  
}
```

Mátrix vektor szorzás

- Hogyan párhuzamosítható?
 - Eredmény szálakhoz rendelése
 - Gather típus: minden szál összegzi a bemenet minden elemének hozzájárulását
 - Bemenet szálakhoz rendelése
 - Scatter típus: minden szál kiszámítja a bemenet egy elemének hozzájárulását a kimenet minden eleméhez
 - Szinkronizáció szükséges!

Mátrix vektor szorzás II.

- Gather típusú megoldás
 - Az eredmény egy N elemű vektor
 - A munka méret N
- Minden szál kiszámítja a mátrix egy sora és bemeneti vektor alapján az eredmény vektor egy elemét.
- Ellenőrizni kell a túlcímzést!

Mátrix vektor szorzás II.

■ Host program

```
void simpleMV(int n, int m, float* y, const float* A, const float* x, const float* b){
    cl_kernel simpleMVKernel = createKernel(program, "simpleMV");

    cl_mem yGPU = clCreateBuffer(context, CL_MEM_WRITE_ONLY, sizeof(float)*m, NULL, NULL);
    cl_mem AGPU = clCreateBuffer(context, CL_MEM_READ_ONLY, sizeof(float)*m*n, NULL, NULL);
    clEnqueueWriteBuffer(commands, AGPU, CL_FALSE, 0, sizeof(float)*m*n, A, 0, NULL, NULL);
    cl_mem xGPU = clCreateBuffer(context, CL_MEM_READ_ONLY, sizeof(float) * n, NULL, NULL);
    clEnqueueWriteBuffer(commands, xGPU, CL_FALSE, 0, sizeof(float)*n, x, 0, NULL, NULL);
    cl_mem bGPU = clCreateBuffer(context, CL_MEM_READ_ONLY, sizeof(float) * m, NULL, NULL);
    clEnqueueWriteBuffer(commands, bGPU, CL_FALSE, 0, sizeof(float)*m, b, 0, NULL, NULL);

    clSetKernelArg(simpleMVKernel, 0, sizeof(int), &n);
    clSetKernelArg(simpleMVKernel, 1, sizeof(int), &m);
    clSetKernelArg(simpleMVKernel, 2, sizeof(cl_mem), &yGPU);
    clSetKernelArg(simpleMVKernel, 3, sizeof(cl_mem), &AGPU);
    clSetKernelArg(simpleMVKernel, 4, sizeof(cl_mem), &xGPU);
    clSetKernelArg(simpleMVKernel, 5, sizeof(cl_mem), &bGPU);

    clEnqueueBarrier(commands);
    // ...
}
```

Mátrix vektor szorzás II.

■ Host program

```
// ...
size_t workSize = m;
clEnqueueNDRangeKernel(commands, simpleMVKernel,
                        1, NULL, &workSize, NULL,
                        0, NULL, NULL);

clFinish(commands);

clEnqueueReadBuffer(commands, yGPU, CL_TRUE, 0, sizeof(float) * m,
                    y, 0, NULL, NULL);

clReleaseMemObject(yGPU);
clReleaseMemObject(AGPU);
clReleaseMemObject(xGPU);
clReleaseMemObject(bGPU);
clReleaseKernel(simpleMVKernel);
}
```

Mátrix vektor szorzás II.

■ OpenCL kernel

```
__kernel
void simpleMV(const int n, const int m, __global float* y,
              __global float* A, __global float* x,
              __global float* b){

    int i = get_global_id(0);
    if(i < n){
        float yi = b[i];
        for(int j = 0; j < m; ++j){
            yi += A[j + i * m] * x[j];
        }
        y[i] = yi;
    }
}
```

Soros számítás!

Mátrix vektor szorzás III.

- A skaláris szorzás párhuzamosítása bonyolult
- Az összegzés triviálisan párhuzamosítható!
 - Klasszikus redukciós megoldás
 - Munkacsoportonként dolgozunk fel egy-egy oszlopot
 - Minden szál elvégzi az elemi szorzást
 - Az eredményt a lokális memóriában gyűjtjük
 - Redukciós lépések
 - Minden lépésben felezzük a szálak számát
 - A még futó szálak összegzik a leállított szálak részösszegeit
 - Az utolsó szál kiírja az eredményt a globális memóriába

Mátrix vektor szorzás III.

- Feltételezések
 - $N \times M$ -es mátrix esetén
 - M szál indítható munkacsoportonként
 - N munkacsoport indítható
 - A lokális memória legalább M méretű
 - $M=2^k$ a redukcióhoz

Mátrix vektor szorzás II.

- Host program

[illegible]

Mátrix vektor szorzás III.

■ OpenCL kernel

```
#define M 32
__kernel
void reduceMV(const int n, __global float* y, __global float* A,
               __global float* x, __global float* b){

    int i = get_group_id(0);
    int j = get_local_id(0);

    __local float Q[M];

    Q[j] = A[i * M + j] * x[j];

    for(int stride = M / 2; stride > 0; stride >>= 1){
        barrier(CLK_LOCAL_MEM_FENCE);
        if(j + stride < M){
            Q[j] += Q[j + stride];
        }
    }

    if(j == 0){
        y[i] = Q[0] + b[i];
    }
}
```

Mátrix vektor szorzás IV.

- Megoldási lehetőség
 - Az egyszerűség kedvéért csak egy munkacsoport
 - Daraboljuk a kimenetet T hosszú darabokra
 - A munkacsoport egyszerre egy szegmensben dolgozik
 - Daraboljuk fel a bemenetet Z hosszú darabokra
 - A skaláris szorzatok összegét a részösszegekből számítjuk
 - A lokális memóriában tároljuk részösszegeket
 - $Q[T*Z]$ méretű lokális tömbben
 - Az eredmény T hosszú darabját redukcióval kapjuk

Mátrix vektor szorzás IV.

■ OpenCL kernel

```
#define T 8
#define Z 2
__kernel void largeMV(const int n, const int m, __global float* y,
                     __global float* A, __global float* x, __global float* b){
    __local float Q[T * Z];

    int t = get_local_id(0) / Z;
    int z = get_local_id(0) % Z;

    for(int i = t; i < n; i += T){
        // ... ciklus mag a következő oldalon

        if(z == 0){
            y[i] = Q[t * Z + 0] + b[i];
        }
    }
}
```

Mátrix vektor szorzás IV.

■ OpenCL kernel

```
// ciklus mag
Q[t * Z + z] = 0.0f;
for(int j = z; j < m; j+=Z){
    Q[t * Z + z] += A[j + i * m] * x[j];
}

for(int stride = Z / 2; stride > 0; stride >>= 1){
    barrier(CLK_LOCAL_MEM_FENCE);
    if(z + stride < Z){
        Q[t * Z + z] += Q[t * Z + z + stride];
    }
}
```


Mátrix vektor szorzás V.

- Ritka mátrixok

- Sok nulla elem
- Tömörítés és a tömörített reprezentáción számítás

- Compressed Sparse Row

$$\begin{bmatrix} a & 0 & b \\ c & d & e \\ 0 & 0 & f \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x \\ y \\ z \end{bmatrix}$$

Value: $[a \quad b \quad c \quad d \quad e \quad f]$

Column: $[0 \quad 2 \quad 0 \quad 1 \quad 2 \quad 2]$

Row Ptr: $[0 \quad 2 \quad 5]$

Mátrix vektor szorzás V.

$$\begin{bmatrix} a & 0 & b \\ c & d & e \\ 0 & 0 & f \end{bmatrix} \begin{bmatrix} x \\ y \\ z \end{bmatrix}$$

Value: $[a \quad b \quad c \quad d \quad e \quad f]$

Column: $[0 \quad 2 \quad 0 \quad 1 \quad 2 \quad 2]$

Row Ptr: $[0 \quad 2 \quad 5]$

Value + Row Ptr: $[a \quad b \mid c \quad d \quad e \mid f]$

Vector + Column: $[x \quad z \mid x \quad y \quad z \mid z]$

Elemenkénti szorzat: $[ax \quad bz \mid cx \quad dy \quad ez \mid fz]$

Inclusive szegmentált scan: $[O_1 \mid O_2 \mid O_3]$

Mátrix vektor szorzás V.

- Szegmentált scan
 - Feltételes scan
 - A feltétel egy külön tömbben

Inclusive scan:

$$(1 \ 2 \ 3 \ 4 \ 5 \ 6 \ 7 \ 8) \rightarrow (1 \ 3 \ 6 \ 10 \ 15 \ 21 \ 28 \ 36)$$

Head tömb

$$(1 \ 0 \ 1 \ 0 \ 0 \ 1 \ 0 \ 0)$$

Inclusive segmented scan:

$$(1 \ 2 \mid 3 \ 4 \ 5 \mid 6 \ 7 \ 8) \rightarrow (1 \ 3 \mid 3 \ 7 \ 12 \mid 6 \ 13 \ 21)$$

Gauss-Jordan elimináció

- Gauss elimináció
 - Visszavezetjük az egyenletrendszert háromszög mátrixra
 - Visszahelyettesítéses megoldás
- Gauss-Jordan elimináció
 - Csak a főátlóban lehet nemnulla elem

Gauss-Jordan elimináció

- Megengedett műveletek
 - Két egyenlet felcserélése
 - Egyenlet skalárral szorzása
 - Egy egyenlethez egy másik skalárszorosának hozzáadása

Gauss-Jordan elimináció

■ Példa

$$\begin{array}{l} 2x + y - z = 8 \\ -3x - y + 2z = -11 \\ -2x + y + 2z = -3 \end{array} \xrightarrow{\begin{array}{l} L_2 + \frac{3}{2}L_1 \rightarrow L_2 \\ L_3 + L_1 \rightarrow L_3 \end{array}} \begin{array}{l} 2x + y - z = 8 \\ \frac{1}{2}y + \frac{1}{2}z = 1 \\ 2y + z = 5 \end{array}$$

$$\begin{array}{l} 2x + y - z = 8 \\ \frac{1}{2}y + \frac{1}{2}z = 1 \\ 2y + z = 5 \end{array} \xrightarrow{L_3 - 4L_2 \rightarrow L_3} \begin{array}{l} 2x + y - z = 8 \\ \frac{1}{2}y + \frac{1}{2}z = 1 \\ -z = 1 \end{array}$$

$$z = -1 \longrightarrow y = 3 \longrightarrow x = 2$$

Gauss-Jordan elimináció

■ Példa

$$\begin{array}{rcl} 2x + y - z & = & 8 \\ -3x - y + 2z & = & -11 \\ -2x + y + 2z & = & -3 \end{array} \quad \longrightarrow \quad \left[\begin{array}{ccc|c} 2 & 1 & -1 & 8 \\ -3 & -1 & 2 & -11 \\ -2 & 1 & 2 & -3 \end{array} \right]$$

$$\left[\begin{array}{ccc|c} 1 & \frac{1}{3} & \frac{-2}{3} & \frac{11}{3} \\ 0 & 1 & \frac{2}{5} & \frac{13}{5} \\ 0 & 0 & 1 & -1 \end{array} \right] \quad \longrightarrow \quad \left[\begin{array}{ccc|c} 1 & 0 & 0 & 2 \\ 0 & 1 & 0 & 3 \\ 0 & 0 & 1 & -1 \end{array} \right]$$

Gauss-Jordan elimináció

■ Mátrix inverze

$$\left[\underline{\underline{A}} \underline{\underline{I}} \right] \Rightarrow \underline{\underline{A}}^{-1} \left[\underline{\underline{A}} \underline{\underline{I}} \right] \Rightarrow \left[\underline{\underline{I}} \underline{\underline{A}}^{-1} \right]$$

$$\underline{\underline{A}} = \begin{bmatrix} 2 & -1 & 0 \\ -1 & 2 & -1 \\ 0 & -1 & 2 \end{bmatrix} \longrightarrow \left[\underline{\underline{A}} \underline{\underline{I}} \right] = \left[\begin{array}{ccc|ccc} 2 & -1 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ -1 & 2 & -1 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & -1 & 2 & 0 & 0 & 1 \end{array} \right]$$

$$\left[\underline{\underline{I}} \underline{\underline{A}}^{-1} \right] = \left[\begin{array}{ccc|ccc} 1 & 0 & 0 & \frac{3}{4} & \frac{1}{2} & \frac{1}{4} \\ 0 & 1 & 0 & \frac{1}{4} & 1 & \frac{1}{4} \\ 0 & 0 & 1 & \frac{1}{4} & \frac{1}{2} & \frac{3}{4} \end{array} \right]$$

Gauss-Jordan elimináció

■ Algoritmus

```
for k := 1 .. n-1 do
  for i := k+1 .. n do
    l :=  $a_{ik}/a_{kk}$ 
     $b_i := b_i - l * b_k$ 
    for j := k .. n do
       $a_{ij} := a_{ij} - l * a_{kj}$ 
    end for
  end for
end for
```

Gauss-Jordan elimináció

■ Host program

```
void gaussian(){
    int n = 6;
    int m = 3;
    float A[] = { 2, -1, 0, 1, 0, 0,
                  -1, 2, -1, 0, 1, 0,
                  0, -1, 2, 0, 0, 1};

    cl_kernel gaussianKernel = createKernel(program, "gaussian");

    cl_mem AGPU = clCreateBuffer(context, CL_MEM_READ_WRITE, sizeof(float)*n*m, NULL, NULL);
    clEnqueueWriteBuffer(commands, AGPU, CL_TRUE, 0, sizeof(float)*n*m, A, 0, NULL, NULL);

    clSetKernelArg(gaussianKernel, 0, sizeof(int), &n);
    clSetKernelArg(gaussianKernel, 1, sizeof(int), &m);
    clSetKernelArg(gaussianKernel, 2, sizeof(cl_mem), &AGPU);

    clEnqueueBarrier(commands);

    // ...
}
```

Gauss-Jordan elimináció

■ Host program

```
// ...
size_t workSize = m;
size_t workGroupSize = m;
clEnqueueNDRangeKernel(commands, gaussianKernel,
                        1, NULL, &workSize, &workGroupSize,
                        0, NULL, NULL);

clFinish(commands);

clEnqueueReadBuffer(commands, AGPU, CL_TRUE, 0, sizeof(float)*n*m,
                    A, 0, NULL, NULL);

clReleaseMemObject(AGPU);
clReleaseKernel(gaussianKernel);
}
```

Gauss-Jordan elimináció

■ OpenCL kernel

```
__kernel
void gaussian(const int n, const int m, __global float* A){
    int id = get_local_id(0);
    for(int ma = 0; ma < m; ++ma){
        float pp = A[ma + ma * n];
        float coeff = A[ma + id * n] / pp;
        barrier(CLK_GLOBAL_MEM_FENCE);
        if(id != ma){
            for(int na = 0; na < n; ++na){
                A[na+id*n] = A[na+id*n] - coeff * A[na+n*ma];
            }
        }
        barrier(CLK_GLOBAL_MEM_FENCE);
    }
}
// ...
```

Gauss-Jordan elimináció

- OpenCL kernel

```
// ...  
float coeff = A[id + id * n];  
for(int na = 0; na < n; ++na){  
    A[na + id * n] = A[na + id * n] / coeff;  
}  
}
```

Gauss-Jordan elimináció

■ Példák

■
$$\begin{bmatrix} 2 & 1 & -1 & 8 \\ -3 & -1 & 2 & -11 \\ -2 & 1 & 2 & -3 \end{bmatrix} \longrightarrow \begin{bmatrix} 1, & 0, & 0, & 2 \\ 0, & 1, & 0, & 3 \\ -0, & -0, & 1, & -1 \end{bmatrix}$$

■
$$\begin{bmatrix} 2 & -1 & 0 & 1 & 0 & 0 \\ -1 & 2 & -1 & 0 & 1 & 0 \\ 0 & -1 & 2 & 0 & 0 & 1 \end{bmatrix} \longrightarrow \begin{bmatrix} 1, & 2.23\text{e-}08, & 9.93\text{e-}09, & 0.75, & 0.5, & 0.25 \\ 0, & 1, & 1.32\text{e-}08, & 0.5, & 1, & 0.5 \\ 0, & 2.23\text{e-}08, & 1, & 0.25, & 0.5, & 0.75 \end{bmatrix}$$