

利用OSQP库计算标准二次规划(QP)问题的实例

利用OSQP库计算标准二次规划(QP)问题的实例

OSQP介绍

OSQP官网介绍,特点如下:

Ubuntu部署

C++接口

osqp-eigen部署与使用

标准问题构建

求解示例代码

OSQP介绍

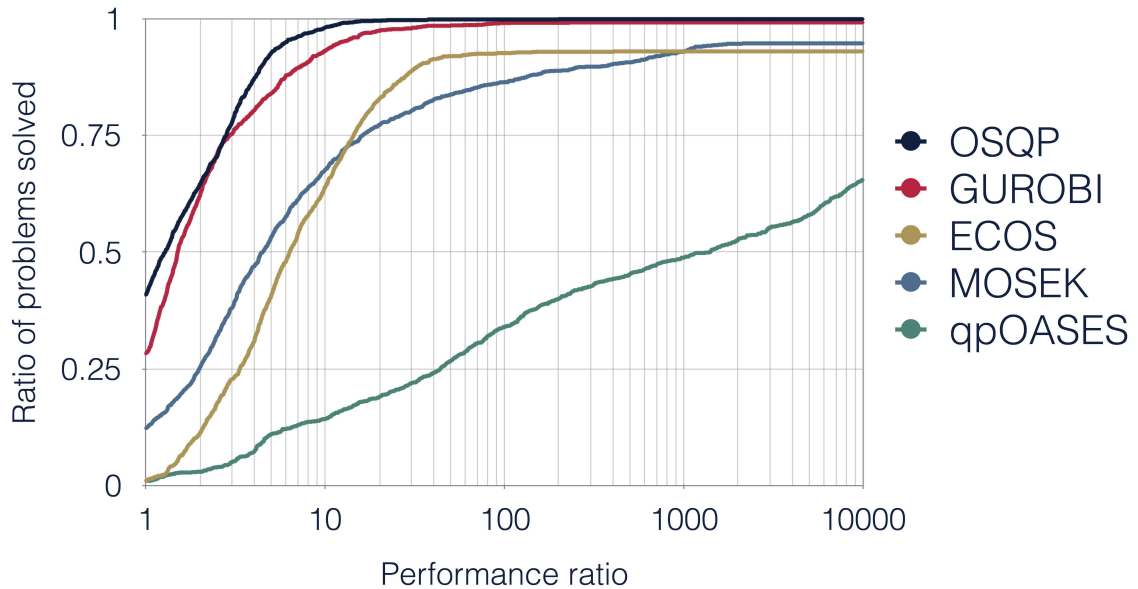
Apollo使用的二次规划求解使用的为OSQP,因此调查试用了一下.

由于github不支持公式,完整版请参照README.pdf.

OSQP官网介绍,特点如下:

- Efficient
采用了 `ADMM-based first-order` 算法(待学习)
- Robust
只需要问题本身为凸即可,对问题数据无要求(求解需要的problem data指的是?)
- Free
Apache 2.0 license
- Embaddable
生成嵌入式C代码,不需要管理内存
- Interface
多语言,跨平台,支持C/C++, Fortran, Matlab, Python, R, Julia, Rust.
- Library-Free
无需安装依赖

- 同类benchmark如下图



Ubuntu部署

参照[官网](#)说明即可.

由于Binary网页无法打开,使用源码安装方式.

预先安装 `gcc` 与 `cmake`. [代码](#) 下载后, `cmake-make-make install`.

C++接口

官方无C++接口,有两个推荐的第三方维护的接口:google的[osqp-cpp](#)与GiulioRomualdi的[osqp-eigen](#). **osqp-cpp**为**osqp-eigen**的类似.区别如下:

1. license

osqp-cpp为MIT(最宽松),osqp-eigen为LGPL(传染式开源).关于开源证书可以参考[知乎回答](#).

2. 两者除都依赖Eigen以外,osqp-cpp依赖google自家的abseil-cpp库.osqp-eigen没有其他依赖.

通过例子可以看出两者语法类似,为方便,本次实例采用了osqp-eigen.如果公司不能开源代码,可能需要使用osqp-cpp.另外注意一点,osqp-cpp不是official supported.

osqp-eigen部署与使用

按照官方说明安装即可, `cmake-make-make install`.

cmakelist示例:

```
cmake_minimum_required(VERSION 3.0)
project(myproject)
find_package(OpenCV REQUIRED)
add_executable(example example.cpp)
target_link_libraries(example OpenCV::OpenCV)
```

标准问题构建

\min

$$\frac{1}{2}X^T P X + Q^T X$$

$s.t.$

$$L \leq A X \leq U$$

X 为 $n \times 1$ 向量

A 为 $m \times n$ 约束矩阵,约束条件个数为 m 个

其中 P 为Hessian正定矩阵($n \times n$ 对称矩阵)

L 与 U 分别为上下限线性约束条件.

实际问题如下:

\min

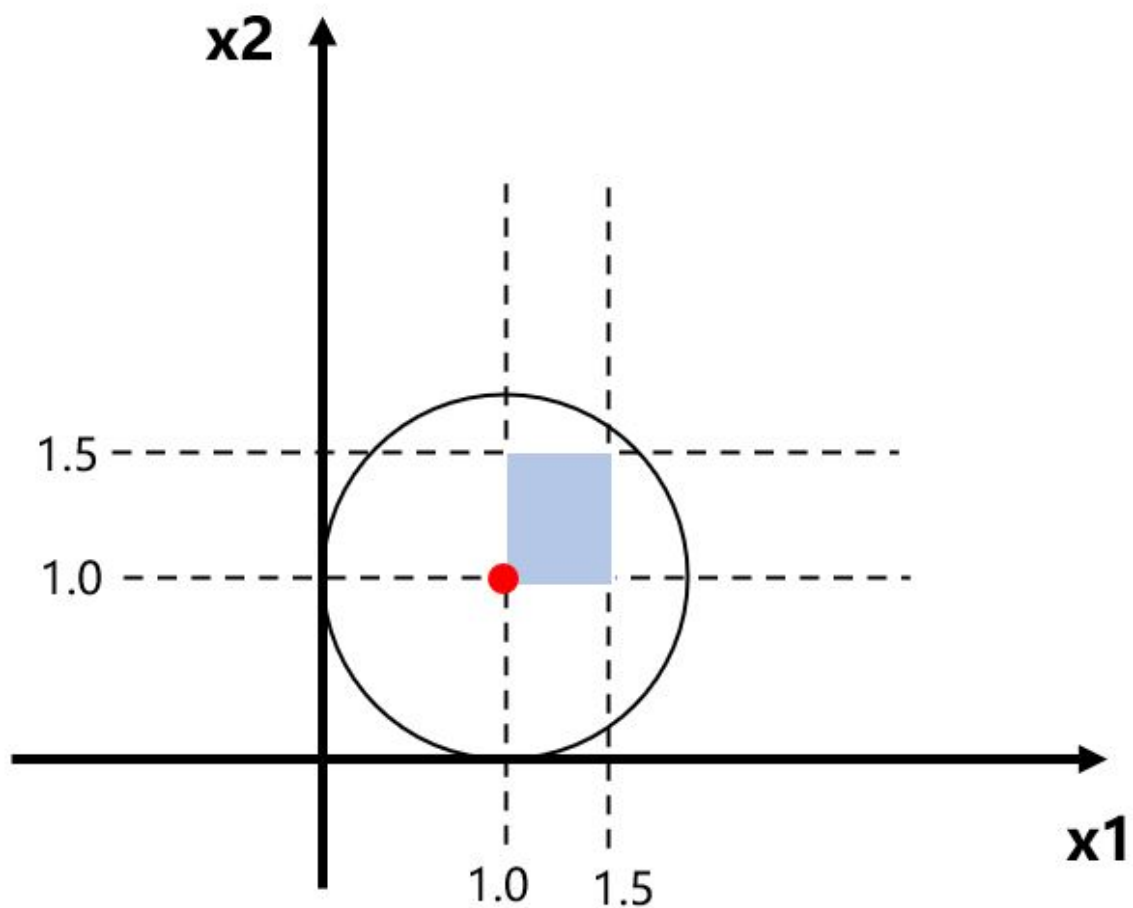
$$(x_1 - 1)^2 + (x_2 - 1)^2$$

$s.t.$

$$1 \leq x_1 \leq 1.5$$

$$1 \leq x_2 \leq 1.5$$

图解下图



显而易见,最优解为 $\begin{bmatrix} 1.0 \\ 1.0 \end{bmatrix}$

转化成矩阵形式:

\min

$$\frac{1}{2}X^T \begin{bmatrix} 2 & 0 \\ 0 & 2 \end{bmatrix} X + [-2 \quad -2]X$$

$s. t.$

$$\begin{bmatrix} 1 \\ 1 \end{bmatrix} \leq \begin{bmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 1 \end{bmatrix} X \leq \begin{bmatrix} 1.5 \\ 1.5 \end{bmatrix}$$

由此可得 P, Q, A, L, U .

求解示例代码

```
// osqp-eigen
#include "OsqpEigen/OsqpEigen.h"

// eigen
#include <Eigen/Dense>
#include <iostream>

int main()
```

```

{
    // allocate QP problem matrices and vectores
    Eigen::SparseMatrix<double> hessian(2, 2);          //P: n*n正定矩
    阵,必须为稀疏矩阵SparseMatrix
    Eigen::VectorXd gradient(2);                      //Q: n*1向量
    Eigen::SparseMatrix<double> linearMatrix(2, 2);    //A: m*n矩阵,必
    须为稀疏矩阵SparseMatrix
    Eigen::VectorXd lowerBound(2);                    //L: m*1下限向
    量
    Eigen::VectorXd upperBound(2);                    //U: m*1上限向
    量

    hessian.insert(0, 0) = 2.0; //注意稀疏矩阵的初始化方式,无法使用<<初
    始化
    hessian.insert(1, 1) = 2.0;
    // std::cout << "hessian:" << std::endl
    //          << hessian << std::endl;
    gradient << -2, -2;
    linearMatrix.insert(0, 0) = 1.0; //注意稀疏矩阵的初始化方式,无法使
    用<<初始化
    linearMatrix.insert(1, 1) = 1.0;
    // std::cout << "linearMatrix:" << std::endl
    //          << linearMatrix << std::endl;
    lowerBound << 1, 1;
    upperBound << 1.5, 1.5;

    // instantiate the solver
    OsqpEigen::Solver solver;

    // settings
    solver.settings()->setVerbosity(false);
    solver.settings()->setWarmStart(true);

    // set the initial data of the QP solver
    solver.data()->setNumberOfVariables(2);    //变量数n
    solver.data()->setNumberOfConstraints(2);  //约束数m
    if (!solver.data()->setHessianMatrix(hessian))
        return 1;
    if (!solver.data()->setGradient(gradient))
        return 1;
    if (!solver.data()->setLinearConstraintsMatrix(linearMatrix))
        return 1;
    if (!solver.data()->setLowerBound(lowerBound))
        return 1;
    if (!solver.data()->setUpperBound(upperBound))

```

```

        return 1;

// instantiate the solver
if (!solver.initSolver())
    return 1;

Eigen::VectorXd QPSolution;

// solve the QP problem
if (!solver.solve())
{
    return 1;
}

QPSolution = solver.getSolution();
std::cout << "QPSolution" << std::endl
           << QPSolution << std::endl; //输出为m*1的向量
return 0;
}

```

完整工程请参考[github](#)

运算输出结果为

```

QPSolution
1.0003
1.0003

```

与最优解误差很小.

- 注意点:
 1. Eigen::SparseMatrix的初始化方式与一般Matrix不同,有两种方式:一是创建一个元素类型为 `triplets` 的列表,然后再将其转换为稀疏矩阵.二是调用稀疏矩阵的成员函数 `.insert()` 直接插入数值.稀疏矩阵的介绍可参考[博文](#).
 2. 需要保证 `NumberOfVariables` 与 `NumberOfConstraints` 跟Hessian矩阵等维数对应上.