在 win10/11 下安装 WSL2+编译 SCIP 套件

笔者以 win11+Ubuntu22.04 为例

前言:

SCIP Opt Suite(https://scipopt.org/#scipoptsuite)是德国 ZIB(Zuse Institute Berlin)研究所开发的混合整数规划求解套装,可以求解 Pseudoboolean optimization,Satisfiability (SAT) and variants,CIP,MILP,不论凸还是非凸的 MINLP 以及其连续问题。该求解套装由 SCIP 分支定界框架+Soplex LP 求解器+ZIMPL 建模语言+UG 分布计算框架+GCG 通用列生成求解器构成,非线性求解器需要自行安装开源的 IPOPT 或者不开源的 WORHP 求解器,LP 求解器也可以在编译时替换成 Cplex、Gurobi、Xpress等商业求解器以提升效率。该求解器对各类优化问题和模型文件有着极好的兼容性,包括但不限于 AMPL 的 nl 格式模型,Cplex的 lp 格式模型和通用的 mps 格式模型等,并有原生的 C/C++ API 和 Python API。

特别需要指出的是:经过几个大版本的迭代,GCG 求解器已经具备了自动化和图示化的 Dantzig-Wolfe 分解和 Benders 分解功能,但是该求解器基于 GNU 开发,对 Linux 和 Unix 系统支持很好,不支持 Windows 系列,拉高了使用者的门槛。笔者同时拥有 Mac、Ubuntu 和 Window 电脑,以 Mac 电脑为办公主力,但是受限于 Mac 系统金子般的内存颗粒价格和分解问题巨大的内存开销,转而将求解转移到了 Ubuntu 上,但是 Ubuntu 不会是大多数人的主力操作系统,笔者也深感不变,后改为使用 WSL2+Ubuntu 方式,放在 Windows 电脑上,获得了非常好的体验,所以编写了这份教程。

最优化问题对处理器单核 ipc 和内存大小及带宽有极大需求,非常不推荐低配电脑使用该教程,会获得非常糟糕的体验,推荐配置: Windows11 专业版+32GB 以上RAM+12 代及以后的 Intel 酷睿处理器+50G 以上的硬盘空间

WSL2 是 Windows Subsystem for Linux 的简称,可以实现 Linux 系统二进制文件 在 Windows 上的转译执行,姑且就把它当成虚拟机吧,WSL2 的执行效率高于 VM、PD 等虚拟机软件,硬件开销也不大,能够有原生物理机的 9 成以上功力。

1.首先开启 win10/win11 下的虚拟机平台和适用于 Linux 的 windows 子系统,以管理员身份运行 Windows Powershell,输入以下代码:

#适用于 Linux 的 Windows 子系统

dism.exe /online /enable-feature /featurename:Microsoft-Windows-Subsystem-Linux /all /norestart

#虚拟机平台

dism.exe /online /enable-feature /featurename:VirtualMachinePlatform /all /norestart

如果本机有多台虚拟机,为了安全可以开启 Hyper-V,具体步骤请自行搜索,不影响主体功能。

以上功能开启后需重新启动, 随后输入:

获取现有 wsl 版本信息

wsl --list --verbose

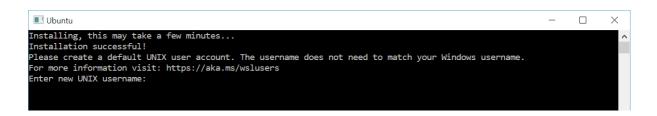
#开启管理员权限

wsl --set-default-version 2

2.重启完毕之后进入 windows 商店,搜素 Ubuntu22.04,点击下载,随后会自动安装。

下载完成后,点击图标进入,首次使用会需要几分钟执行安装。

完成安装后,设置 Ubuntu 用户名(非 root)及密码,正式开启 Ubuntu 系统。



3. 将你的 Ubuntu22.04 实例移动到其他磁盘(只有 C 盘可以跳过该节)

首先将你现在的 Ubuntu 实例导出,以在 D 盘新建 Linux 文件夹为例:

wsl --export Ubuntu-22.04 D:\Linux\ubuntu-22.04.tar

注销 Ubuntu 22.04 实例:

wsl --unregister Ubuntu-22.04

导入到新位置:

wsl --import Ubuntu-22.04 D:\Linux D:\Linux\ubuntu-22.04.tar

验证迁移:

wsl -d Ubuntu-22.04

验证完毕后在 Windows Powershell 输入 wsl,就进入了 Ubuntu22.04,很 抱歉该系统暂时没有支持图形界面的 wsl 镜像,如果对图形界面有刚性需求的请安 装 Ubuntu20.04-wsl 镜像版,该版本有图形界面,本文不做展开。

需要注意的是该系统较老,apt 等程序还没有更新,后续装软件时会报错,请首先更新 apt 并修复问题:

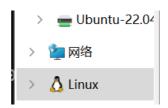
sudo apt-get update

sudo apt-get install -f —fix-missing

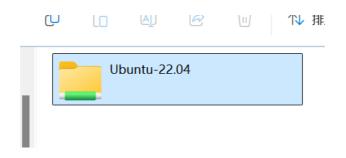
此时你的 Ubuntu22.04-WSL 已经准备就绪,同普通的 Ubuntu 无异。

4.实现 Linux 和 Windows 的文件互相管理

完成以上工作后,就可以将 Ubuntu 实例安装到 D 盘之外的地方,此时在我的电脑内可以看到



点击 Linux 的图标



右键 Ubuntu-22.04 文件夹,选择映射为网络驱动器,一路确认后,你的 Linux 文件夹就变成了电脑的 Z 盘,可以和 Windows 直接跨系统处理文件了。

*在 WSL 系统内输入 gcc -dM -E -march=native - < /dev/null | egrep "SSE|AVX" | sort, 如果是 clang 编译器就把 gcc 改成 clang, 笔者强烈推荐 clang 编译器。会显示支持的指令集,搜索一下是否有 AVX2,后续编译软件过程,笔者都启用了编译器的自动编译优化,面向 AVX2 指令集向量化编译优化,如果是 intel 酷睿 4 代之前的处理器,请改成 AVX 或者其他兼容的指令集。(可选)

```
(base) root@bbbb2210:/mnt/c/Users/shengtianyi# clang -dM -E -march=native - < /dev/null | egrep "SSE|AVX" | sort #define __AVX2__ 1 #define __AVXUNI__ 1 #define __SEZ_MATH__ 1 #define __SSE2_MATH__ 1 #define __SSE2_MATH__ 1 #define __SSE3__ 1 #define __SSE4_1__ 1 #define __SSE4_1__ 1 #define __SSE4_1_ 1 #define __SSE4_2_ 1 #define __SSE4_2_ 1 #define __SSE4_3_ 1 #define __SSE4_3__ 1 #define __SSE_MATH__ 1 #define __SSE__ 1 #define __SSE__ 1 #define __SSE__ 1
```

5.申请 Cplex 等求解器的 Linux 学术版(可选)

Cplex 等求解器可以作为 SCIP 的底层 LP 求解器,相比自带的开源求解器 Soplex 有一定提升,小规模问题能提升 10%左右,大规模问题可靠性则远胜 Soplex。笔者申请了学术版的 Linux 版 Cplex 并安装在了默认位置。关于求解器安装本人不做讲解,请自行咨询软件客服。

6.下载编译 SCIP 源代码

网址: https://www.scipopt.org/index.php#download

选择 scipoptsuite-9.1.0.tgz:

Download

The files you can download here come without warranty. Use at your own risk!



Source Code

You can either download SCIP alone or the SCIP Optimization Suite (recommended), a complete source code bundle of SCIP, SoPlex, ZIMPL, GCG, PaPILO and UG.

Source code archives (including applications and examples)

• scipoptsuite-9.1.0.tgz

scip-9.1.0.tgz

Click here for information on different platforms ...

按照要求填信息下载解压,并移动到 Linux 系统的文件夹内,请自行管理,本人安装在/opt/文件夹下。

安装必要的组件:

apt-get install wget cmake g++ m4 xz-utils libgmp-dev unzip zlib1g-dev libboost-program-options-dev libboost-serialization-dev libboost-regex-dev libboost-iostreams-dev libtbb-dev libreadline-dev pkg-config git liblapack-dev libgsl-dev flex bison libcliquer-dev gfortran file dpkg-dev libopenblas-dev rpm cliquer gnuplot

6.1 lpopt 非线性求解器的安装(难点)

首先安装 Ipopt 的几个必备库

sudo apt-get install gcc g++ gfortran git patch wget pkg-config liblapack-dev libmetis-dev

接下来安装 ASL(Ampl Solver Library),MUMPS Linear Solver,HSL (Harwell Subroutines Library),特别是 HSL ,他是 Ipopt 的线性求解库,该处为最难点,请务必按照介绍安装

先前往 https://licences.stfc.ac.uk/product/coin-hsl

使用学术邮箱注册,并申请 coinhsl-archive-2022.12.02 下载,更新的版本使用 meson 构建不稳定,并且与后续的包不兼容

下载 coinhsl-archive-2022.12.02.tar.gz 文件,解压到 coinhsl 文件夹,暂时放在那。

然后前往/opt/文件夹,使用 git 下载 ThirdParty-HSL:

git clone https://github.com/coin-or-tools/ThirdParty-HSL.git

cd ThirdParty-HSL

回到 coinhsl 文件的根目录,将刚才的 coinhsl 整体复制到当前文件夹,即 ThirdParty-HSL:

cp -r coinhsl /opt/ThirdParty-HSL

然后进入复制后的 coinhsl 文件夹,进行 HSL 构建:

./configure CFLAGS='-O3 -mavx2' FFLAGS='-O3 -mavx2' CXXFLAGS='-O3 -mavx2'

make

sudo make install

安装安装完成后退回上级 ThirdParty-HSL 文件夹,进行完全构建:

./configure CFLAGS='-O3 -mavx2' FFLAGS='-O3 -mavx2' CXXFLAGS='-O3 -mavx2'

make

sudo make install

这两步如果都不报错,则 HSL 就完整的构建好了。

下面构建 ASL 和 MUMPS,这两个都不难。先在/opt/文件夹构建 ASL:

git clone https://github.com/coin-or-tools/ThirdParty-ASL.git

cd ThirdParty-ASL

./get.ASL

./configure CFLAGS='-O3 -mavx2' FFLAGS='-O3 -mavx2' CXXFLAGS='-O3 -mavx2'

make

sudo make install

然后还是在/opt/文件夹构建 MUMPS:

git clone https://github.com/coin-or-tools/ThirdParty-Mumps.git

cd ThirdParty-Mumps

./get.Mumps

./configure CFLAGS='-O3 -mavx2' FFLAGS='-O3 -mavx2' CXXFLAGS='-O3 -mavx2'

```
make
```

sudo make install

接下来构建 Ipopt, 首先在/opt/文件夹下 git 克隆:

git clone https://github.com/coin-or/lpopt.git

然后就进去安装就行:

cd Ipopt

mkdir build

cd build

../configure CFLAGS='-O3 -mavx2' FFLAGS='-O3 -mavx2' CXXFLAGS='-O3 -mavx2'

make

make test

make install

安装过程请注意有无报错信息,安装完毕后务必更新动态链接库 sudo Idconfig。

6.2 SCIP 安装

进入/opt/scipoptsuite-9.1.0/文件夹下

首先找到 CMakeLists 文件,移动到 Win11 后在第一行 cmake_minimum_required(VERSION 3.9)下方加入插入一段:

set(CMAKE_C_FLAGS "\${CMAKE_C_FLAGS} -mavx2 -O3")

set(CMAKE_CXX_FLAGS "\${CMAKE_CXX_FLAGS} -mavx2 -O3")

option(BUILD_PARALLEL "Enable parallel build" ON)

if(BUILD PARALLEL)

set(CMAKE_BUILD_PARALLEL_LEVEL 6) # 设置默认的并行线程数,可以修改

endif()然后再复制替换原位的 CMakeLists 文件。如果会用 nano, vim, emacs 等编辑器的可以直接原位修改:

cmake minimum required(VERSION 3.9)

set(CMAKE CXX FLAGS "\${CMAKE CXX FLAGS} -mavx2 -O3") set(CMAKE C FLAGS "\${CMAKE CXX FLAGS} -mavx2 -O3") set(CMAKE VERBOSE MAKEFILE ON)

option(BUILD PARALLEL "Enable parallel build" ON) if(BUILD PARALLEL) set(CMAKE BUILD PARALLEL LEVEL 8) # 设置默认的并行线程数,可以修改endif()

以上代码作用是编译时进行 O3 优化提高 SCIP 的执行效率,而 O3 优化编译相当耗时,所以开启并行编译。

之后在当前文件夹下建立 build 文件夹:

#建立 build 文件夹

mkdir build

cd build

进入 build 文件夹后就可以开始 cmake 编译的过程。有必要说明一下笔者不需要其非线性求解功能,所以没有选装非线性求解器 IPOPT,编译时需要将该功能关闭,如果有非线性需求,请安装 IPOPT。

如果你顺利的安装了 Ipopt 在该文件夹下输入:

cmake .. -DLPS=cpx -DTPI=tny

如果你被 IPOPT 整崩溃了就别装了:

cmake .. -DIPOPT=false -DLPS=cpx -DTPI=tny

然后便可以自动寻找编译需要的组件,如果提示 cpx 功能有错误,原因是没有找到 cplex 的路径,可以在/opt/scipoptsuite-9.1.0/gcg/cmake/Modules 文件夹下找到 FindCPLEX.cmake 文件,打开并在第一行加入并保存:

set(CPLEX DIR = "/opt/ibm/ILOG/CPLEX Studio2211/cplex")

然后再将 FindCPLEX.cmake 复制到/opt/scipoptsuite-9.1.0/scip/cmake/Modules替换,再把 build 文件夹下内容删除,重新输入:

cmake .. -DIPOPT=false -DLPS=cpx -DTPI=tny

便不会报错,在日志内检查 CPLEX Found,即确定 Cplex 作为底层 LP 求解器

输入 sudo make,输入密码,进入冗长的编译过程,编译完不报错后输入 sudo make test 检查错误,由于没安装 IPOPT,所以会提示一些非线性模型错误,可以 忽略。test 完成后输入 sudo make install 便会自动安装软件到/usr/local/bin,头文件和 lib 文件会安装到/usr/local/include 和/usr/local/lib 文件夹下,供 C/C++建模用。安装完成后输入 objdump -d /usr/local/bin/scip | grep ymm,然后就能看到标红的 ymm 寄存器,这是 AVX2 指令集对应的寄存器,证明面向 AVX2 指令集的优化编译已经完成。

1887019: 188701e: 1887024: 1887029: 188702e:	c4 62 ed b8 d9 c4 e2 7d 19 51 90 c4 e2 ed b8 f0 c4 62 ed b8 e1 c4 e2 7d 19 51 98	vfmadd231pd %ymm1,%ymm2,%ymm11 vbroadcastsd -0x70(%rcx),%ymm2 vfmadd231pd %ymm0,%ymm2,%ymm6 vfmadd231pd %ymm1,%ymm2,%ymm12 vbroadcastsd -0x68(%rcx),%ymm2
1887034: 1887039: 188704c: 1887054: 188705c:	c4 e2 rd 19 51 98 c4 e2 ed b8 f8 c4 62 ed b8 e9 c5 fd 10 86 80 00 00 c5 fd 10 8e a0 00 00 c4 e2 7d 19 51 80	vfmadd231pd %ymm0,%ymm2,%ymm7 vfmadd231pd %ymm1,%ymm2,%ymm13 vmovupd 0x80(%rsi),%ymm0 vmovupd 0xa0(%rsi),%ymm1 vbroadcastsd -0x80(%rcx),%ymm2
1887062: 1887067: 188706c: 1887072: 1887077: 188707c:	c4 e2 7d 19 51 80 c4 e2 ed b8 e0 c4 62 ed b8 d1 c4 e2 7d 19 51 88 c4 e2 ed b8 e8 c4 62 ed b8 d9 c4 e2 7d 19 51 90	vfmadd231pd %ymm0,%ymm2,%ymm4 vfmadd231pd %ymm1,%ymm2,%ymm10 vbroadcastsd -0x78(%rcx),%ymm2 vfmadd231pd %ymm0,%ymm2,%ymm5 vfmadd231pd %ymm1,%ymm2,%ymm11 vbroadcastsd -0x70(%rcx),%ymm2

7.SCIP 和 GCG 的使用

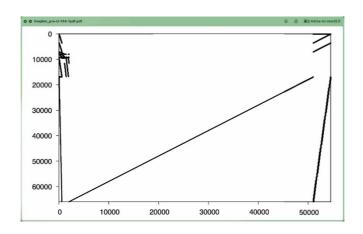
直接在命令行输入 scip 或者 gcg 即可进入求解器的交互界面,使用 read 命令读取模型,presolve 预处理模型,set 指令可以设置自己的策略,下面简单介绍 GCG(General Branch-and-Price & Column Generation Solver),该求解器可以对线性连续和线性混合整数模型进行 Dantizg-Wolfe 和 Benders 自动化分解并求解,实测材料切割问题远远快于 Gurobi 和 Cplex。

该求解器默认为 Dantzig-Wolfe 分解,开启 Benders 探测和分解参阅: https://gcg.or.rwth-aachen.de/doc-3.5.0/benders.html

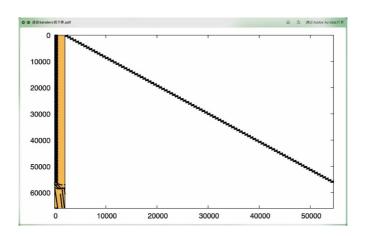
分解选择和图示化参阅: https://gcg.or.rwth-aachen.de/doc-3.5.0/explore-menu.html

以上网站有 SCIP 套件和 GCG 的详细文档,请自行探索。

分解效果,此为原问题:



分解后出现了典型的 benders 结构:



计算结果,下界提升明显:

非线性 MINLP 问题支持的运算符和求解效果:

```
class Op:
    const = 'const'
    varidx = 'var'
    exp, log, sqrt, sin, cos = 'exp', 'log', 'sqrt', 'sin', 'cos'
    plus, minus, mul, div, power = '+', '-', '*', '/', '**'
    add = 'sum'
    prod = 'prod'
    fabs = 'abs'
Operator = Op()
```

```
SCIP/set/nlpi> | Ipopt interface

SCIP/set/nlpi> | ipopt |

hessian_approximation | Indicates what Hessian information is to be used. Valid values if not empty: exact limited-memory [] |

ham of library containing HSL routines for load at runtime [] |

linear_solver | linear_system_scaling |

mu_strategy |

nlp_scaling_method |

optfile |

pardisolib |

print_level |

print_level |

priority |

warm_start_push |

warm_start_push |
```

```
| Pressiving: | 183 del vars, 99 del conss, 0 add conss, 3466 chg bounds, 98 chg sides, 98 chg coeffs, 0 upgd conss, 0 impls, 198 clqs (round 2, fast) | 3569 del vars, 196 del conss, 0 add conss, 3466 chg bounds, 98 chg sides, 98 chg coeffs, 0 upgd conss, 0 impls, 198 clqs (round 3, exhaustive) 3569 del vars, 1799 del conss, 0 add conss, 3466 chg bounds, 98 chg sides, 98 chg coeffs, 0 upgd conss, 0 impls, 198 clqs (round 4, exhaustive) 3569 del vars, 1799 del conss, 0 add conss, 3466 chg bounds, 198 bound changes (S. 83) probing aborted: 1080/1080 successive useless probings (S. 83) probing aborted: 1080/1080 successive useless probings (G. 648) probing in 197 del const, 0 add conss, 3664 chg bounds, 98 chg sides, 0 chg coeffs, 249 upgd conss, 1279 impls, 1281 clqs (G. 648) probing in 197 del const, 0 add conss, 3664 chg bounds, 98 chg sides, 0 chg coeffs, 249 upgd conss, 1279 impls, 1281 clqs (G. 648) probing in 197 del const, 0 add conss, 3664 chg bounds, 98 chg sides, 0 chg coeffs, 249 upgd conss, 1279 impls, 1281 clqs (G. 648) probing in 197 del const, 197 del const, 0 add const, 3664 chg bounds, 98 chg sides, 0 chg coeffs, 249 upgd conss, 1279 impls, 1281 clqs (G. 648) probing aborted: 1809/1808 successive useless probings (G. 648) probing aborted: 1809
```

同一个 MINLP 问题, 并行化求解:

```
primalbound
              dualbound
time |
      mem
                                             gap
300s|1980M|
                            9.263486e+04
                                           1148.13%
             7.421893e+03
                                             65.38%
483s|2325M|
             7.426828e+03
                            1.228218e+04
559s 2937M
                                             15.46%
             7.426828e+03
                            8.574798e+03
628s|3315M|
             7.433856e+03
                            8.528615e+03
                                             14.73%
716s|3680M|
             7.444320e+03
                            7.993501e+03
                                              7.38%
808s|3818M|
             7.445647e+03
                            7.607829e+03
                                              2.18%
                            7.584381e+03
                                              1.79%
855s|3950M|
             7.450898e+03
888s 4020M 7.473841e+03
                            7.584381e+03
                                              1.48%
```