



ulm university universität
uulm

**Fakultät für
Mathematik und
Wirtschafts-
wissenschaften**

Institut für Numerische
Mathematik

Cache-optimierte QR-Zerlegung

Bachelorarbeit an der Universität Ulm

Vorgelegt von:

Florian Krötz
florian.kroetz@uni-ulm.de

Gutachter:

Dr. Michael Lehn
Dr. Andreas Borchert

Betreuer:

Dr. Michael Lehn

2018

Fassung 23. Juni 2018

© 2018 Florian Krötz

Satz: PDF- \LaTeX 2 _{ϵ}

Inhaltsverzeichnis

1	Einleitung	1
1.1	Intel MKL	1
2	BLAS	2
2.1	Datenstruktur für Matrizen	2
2.2	Einige BLAS-Routinen	4
2.2.1	Matrix-Matrix Produkt (gemm)	4
2.2.2	Matrix-Vektor Produkt (gemv)	4
2.2.3	Rank1 update (ger)	5
2.2.4	Matrix-Matrix Produkt (trmm)	5
2.2.5	Matrix-Vektor Produkt (trmv)	5
3	QR-Zerlegung	6
3.1	Definition	6
3.1.1	Beispiel für eine Anwendung	6
3.2	Householder-Transformation	7
3.2.1	Householder Vector	9
3.2.2	Householder-Transformation anwenden	10
3.2.3	QR-Zerlegung mittels Householder-Transformationen	11
3.3	Geblockte QR-Zerlegung	13
3.3.1	Berechnung der Matrix T	14
3.3.2	Anwenden von $I - VTV^T$	15
4	Implementierung und Benchmarks	19
4.1	Bibliothek	19
4.1.1	Algorithmus	20
4.2	Aufwand	20
4.2.1	FLOPS	21
4.3	Fehlerschätzer	21
4.4	Benchmarks	21
4.4.1	Test System	21

Inhaltsverzeichnis

A Block Reflector	23
A.0.1 Orthogonal	27
Literaturverzeichnis	28

1 Einleitung

- Wozu dient die QR-Zerlegung?
- Besser beim lösen von Gleichungssystemen mit schlechter Kondition.
- Lösen von Linearen Lineare Ausgleichsproblemen
- QR-Verfahren (Eigenwerte)
- Warum muss die QR-Zerlegung schnell sein?
- Warum Cache-Optimiert?

1.1 Intel MKL

Kapitel über die Wichtigkeit der Intel MKL.

2 BLAS

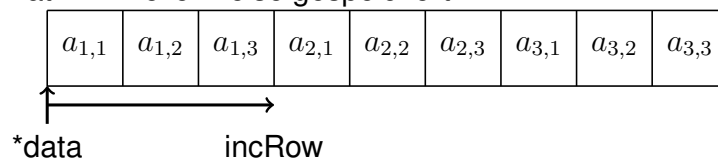
Die Abkürzung BLAS steht für Basic Linear Algebra Subprograms. BLAS-Bibliotheken enthalten elementare Operationen der linearen Algebra.

2.1 Datenstruktur für Matrizen

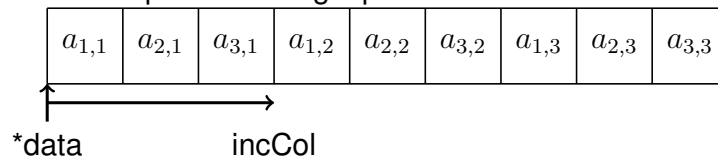
Vollbesetzte Matrizen werden bei BLAS entweder zeilen- oder spaltenweise abgespeichert. Das bedeutet, dass entweder die Zeilen- oder die Spalten der Matrix hintereinander im Speicher stehen.

$$A = \begin{pmatrix} a_{1,1} & a_{1,2} & a_{1,3} \\ a_{2,1} & a_{2,2} & a_{2,3} \\ a_{3,1} & a_{3,2} & a_{3,3} \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{m \times n}$$

Matrix A Zeilenweise gespeichert



Matrix A Spaltenweise gespeichert



Eine Datenstruktur benötigt folgende Elemente:

- einen Zeiger auf eine Speicherfläche
- Informationen ob die Matrix zeilen- oder spaltenweise gespeichert ist

- die Dimension der Matrix.

Eine derartige Datenstruktur könnte in C so aussehen.

```
1 struct Matrix {  
2     double * data;  
3     std::ptrdiff_t incRow, incCol;  
4     std::size_t numRows, numCols;  
5 }
```

Für Intel MKL Routinen müssen die Matrizen zeilenweise gespeichert sein.

Eine C/C++

unterschiede zwischen ptrdiff_t und size_t

möglichkeitsweise inc row inc diff unterchied

2.2 Einige BLAS-Routinen

Im Folgenden werden einige BLAS-Routinen beschrieben, die bei der QR-Zerlegung benutzt werden. BLAS-Routinen werden nach folgendem Schema benannt: Der erste Buchstabe im Namen gibt an für welchen Datentype die Funktion implementiert wurde. Der Rest beschreibt die Funktion der Funktion.

Beispiel „dgemm“: Das „d“ zeigt, dass die Funktion ist für Doubles gilt und „gemm“ steht für „general Matrix Matrix“. Die Funktion berechnet also das Matrix-Matrix Produkt für Matrizen, deren Einträge Doubles sind.

2.2.1 Matrix-Matrix Produkt (gemm)

Die Funktion „gemm“ berechnet das Matrix-Matrix Produkt. Der Funktion werden die Matrizen A , B und C und die Skalare α und β übergeben. Außerdem werden 2 Flags übergeben ob die Matrizen A und B transponiert werden sollen.

Die Funktion berechnet

$$C \leftarrow \beta C + \alpha AB \quad (2.1)$$

Falls $\beta = 0$ wird die Matrix C zuerst mit Nullen initialisiert. Falls C Einträge hat die NaN (Not a Number) sind, werden diese somit mit 0 überschrieben.

[8] Blas tecnica forum netlib

2.2.2 Matrix-Vektor Produkt (gemv)

Die Funktion „gemv“ berechnet das Matrix-Vektor Produkt. Der Funktion werden die Matrix A , die Vektoren x und y , und die Skalare α und β übergeben. Außerdem wird ein Flag übergeben, das anzeigt ob die Matrix A transponiert werden soll.

Die Funktion berechnet

$$y \leftarrow \beta y + \alpha Ax \quad (2.2)$$

Falls $\beta = 0$ wird der Vektor y zuerst mit Nullen initialisiert. Falls y Einträge hat, die NaN (Not a Number) sind, werden diese mit 0 überschrieben.

2.2.3 Rank1 update (ger)

Die Funktion „ger“ berechnet ein dyadisches Produkt aus den Vektoren x und y , skaliert die daraus resultierende Matrix mit α und addiert das Ergebnis auf A .

Der Funktion werden die Matrix A , die Vektoren x und y und das Skalar α übergeben.

Die Funktion berechnet

$$A \leftarrow A + \alpha xy^T \quad (2.3)$$

2.2.4 Matrix-Matrix Produkt (trmm)

Die Funktion „trmm“ berechnet das Matrix-Matrix Produkt einer Dreiecksmatrix mit einer voll besetzten Matrix. Der Funktion wird die Dreiecksmatrix A , die Matrix B und das Skalar α übergeben. Außerdem werden Flags mit übergeben, die anzeigen ob A eine obere oder untere Dreiecksmatrix ist, ob A eine strikte oder unipotente Dreiecksmatrix ist, ob A von links oder rechts auf B multipliziert werden soll und ob A transponiert werden soll. Diese Eigenschaften werden unten in $op(\cdot)$ zusammengefasst.

Die Funktion berechnet

$$B \leftarrow \alpha \cdot op(A) \cdot B \quad \text{oder} \quad B \leftarrow \alpha \cdot B \cdot op(A) \quad (2.4)$$

2.2.5 Matrix-Vektor Produkt (trmv)

Die Funktion „trmv“ berechnet das Matrix-Vektor Produkt für Dreiecksmatrizen. Die Funktion berechnet

$$x \leftarrow \alpha Ax \quad (2.5)$$

Dreiecks matrizen sind quadartiesch matiyen die nur die ober oder untere dteiche betrachnten betrechten nur

3 QR-Zerlegung

3.1 Definition

Eine Matrix $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$, $m \geq n$ besitzt eine eindeutige QR-Zerlegung

$$A = QR \quad (3.1)$$

mit einer orthogonalen Matrix $Q \in \mathbb{R}^{m \times m}$ und einer oberen Dreiecksmatrix $R \in \mathbb{R}^{n \times n}$ [4].

Eine QR Zerlegung kann mit einer Householder-Transformation berechnet werden.

3.1.1 Beispiel für eine Anwendung

Lösung eines Minimierungsproblems

$$\min_{x \in \mathbb{R}^n} \|Ax - b\|^2 \quad (3.2)$$

mit Matrix $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$ mit $\text{rang}(A) = n < m$ für die eine QR Zerlegung existiert. R besitzt die Gestalt

$$R = \begin{pmatrix} * & * & * \\ & * & * \\ \hline & & * \\ & & 0 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \hat{R} \\ 0 \end{pmatrix}$$

\hat{R} stellt eine obere Dreiecksmatrix dar. Damit kann man das Minimierungsproblem wie folgt mit $A = QR$ modifizieren

$$\min_{x \in \mathbb{R}^n} \|Ax - b\|^2 = \min_{x \in \mathbb{R}^n} \|Q^T(Ax - b)\|^2 = \min_{x \in \mathbb{R}^n} \|Rx - Q^T b\|^2 \quad (3.3)$$

Also löst

$$\hat{R}x = Q^T b \quad (3.4)$$

das Minimierungsproblem (3.2). Da R eine Dreiecksmatrix ist, lässt sich (3.4) leicht mit Rückwärtseinsetzen lösen.

Eine Lösung ist eine auch eine Lösung des Minimierungsproblems

3.2 Householder-Transformation

Eine Matrix $H \in \mathbb{R}^{n \times n}$

$$H = I - 2 \frac{vv^T}{v^T v} \quad (3.5)$$

wird als Householder-Transformation und der Vektor $v \in \mathbb{R}^n$ als Householder-Vektor bezeichnet. Eine Householder-Transformation $H = I - 2 \frac{vv^T}{v^T v}$ ist orthogonal und symmetrisch [4].

Die Householder-Transformation spiegelt den Vektor x auf die Achse x_1 . Dazu multipliziert man H von links auf x

$$Hx = \alpha e_1 \quad (3.6)$$

mit dem Skalar $\alpha \in \mathbb{R}$ und e_1 als ersten kanonischen Einheitsvektor. Der Householder-Vektor steht senkrecht auf der Ebene an welcher x gespiegelt wird.

Die Abbildung 3.1 veranschaulicht die Spiegelung des Vektors x an der gestrichelt eingezeichneten Ebene auf die Achse x_1 .

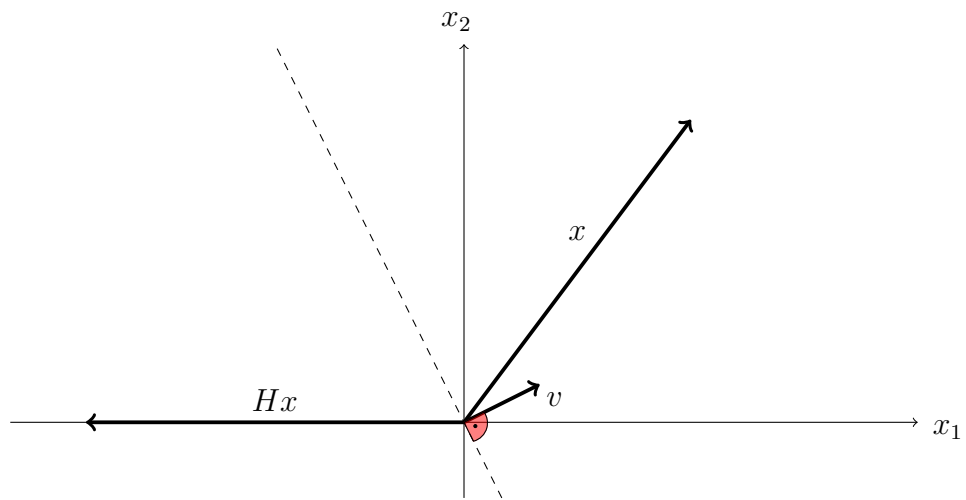


Abbildung 3.1: Beispiel Householder-Transformation mit $x = (3, 4)^T$

Beispiel (3,4) rechnen!

$$\begin{aligned}
 x &= \begin{pmatrix} 3 \\ 4 \end{pmatrix} \\
 \|x\| &= \sqrt{3^2 + 4^2} = 5 \\
 \alpha &= -1 \cdot \text{sign}(x_1) \cdot \|x\| = -5 \\
 \tau &= \frac{\alpha - x_1}{\alpha} = \frac{-5 - 3}{-5} = \frac{8}{5} \\
 v &= \frac{x - \alpha e_1}{\|x - \alpha e_1\|} = \frac{\begin{pmatrix} 3 \\ 4 \end{pmatrix} - \begin{pmatrix} -5 \\ 0 \end{pmatrix}}{\| \begin{pmatrix} 8 \\ 4 \end{pmatrix} \|} = \frac{1}{5} \begin{pmatrix} 8 \\ 4 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 \\ 0,5 \end{pmatrix}
 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned}
 Hx &= x - \tau v(v^T x) = \begin{pmatrix} 3 \\ 4 \end{pmatrix} - \frac{8}{5} \cdot \begin{pmatrix} 1 \\ 0,5 \end{pmatrix} \cdot \left((1, 0,5) \cdot \begin{pmatrix} 3 \\ 4 \end{pmatrix} \right) \\
 &= \begin{pmatrix} 3 \\ 4 \end{pmatrix} - \frac{8}{5} \cdot \begin{pmatrix} 1 \\ 0,5 \end{pmatrix} \cdot (5) = \begin{pmatrix} 3 \\ 4 \end{pmatrix} - \begin{pmatrix} 8 \\ 4 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -5 \\ 0 \end{pmatrix}
 \end{aligned}$$

3.2.1 Householder Vector

Damit (3.6) gilt, wird der Vektor berechnet, indem man (3.5) in (3.6) einsetzt

$$Hx = x - 2 \frac{vv^T}{v^Tv} x = x - 2 \underbrace{\frac{v^T x}{v^T v}}_{\lambda} v = x - \lambda v \stackrel{!}{=} \alpha e_1$$

$$\implies v \in \text{span}\{x - \alpha e_1\}$$

Dadurch erhält man, dass v in dem Span $x - \alpha e_1$ liegt.[4]

Setzt man $v = t(x - \alpha e_1)$ in $Hx = \alpha e_1$ (3.6) ein, dann erhält man

$$\begin{aligned} Hx &= x - \frac{2}{v^T v} v(v^T x) = x - 2 \frac{v^T x}{v^T v} v \\ &= x - 2 \frac{t(x - \alpha e_1)^T x}{t(x - \alpha e_1)^T t(x - \alpha e_1)} t(x - \alpha e_1) = x - 2 \frac{(x - \alpha e_1)^T x}{(x - \alpha e_1)^T (x - \alpha e_1)} (x - \alpha e_1) \\ &= x - \frac{(x - \alpha e_1)^T x}{\|x - \alpha e_1\|_2^2} (x - \alpha e_1) = \underbrace{\left(1 - \frac{2(x - \alpha e_1)^T x}{\|x - \alpha e_1\|_2^2}\right)}_{\stackrel{!}{=} 0} x + \alpha e_1 \underbrace{\frac{2(x - \alpha e_1)^T x}{\|x - \alpha e_1\|_2^2}}_{\stackrel{!}{=} 1} \stackrel{!}{=} \alpha e_1 \end{aligned}$$

Damit das Letzte = gilt muss gelten.

$$\begin{aligned} 1 &= \frac{2(x - \alpha e_1)^T x}{\|x - \alpha e_1\|_2^2} \\ \Leftrightarrow (x - \alpha e_1)^T (x - \alpha e_1) &= 2x^T x - 2\alpha x_1 \\ \Leftrightarrow x^T x - 2\alpha x_1 + \alpha^2 &= 2x^T x - 2\alpha x_1 \\ \Leftrightarrow \alpha &= \pm \sqrt{x^T x} \end{aligned}$$

Das Vorzeichen von $\alpha = \pm \sqrt{x^T x}$ kann man frei wählen, um $v = x - \alpha e_1$ zu berechnen.

Wählt man das Vorzeichen positiv, kann Auslöschung auftreten, falls x annähernd ein positives Vielfaches von e_1 ist.

LAPACK [7] vermeidet die Auslöschung, indem das Vorzeichen entgegengesetzt gewählt wird. Das bedeutet x wird immer auf die gegenüberliegende Seite gespiegelt.

Im Skript von Numerik 1 [4] wird das Vorzeichen immer positiv gewählt:

$\alpha = |\sqrt{x^T x}| = \|x\|_2$. Eine mögliche Auslöschung im Fall $x_1 > 0$ wird hier durch die folgende Umformung vermieden.

$$v_1 = x_1 - \|x\|_2 = \frac{x_1^2 - \|x\|_2^2}{x_1 + \|x\|_2} = \frac{-(x_2^2 + \dots + x_n^2)}{x_1 + \|x\|_2}$$

Um den Vektor v später auf der frei werdenden Diagonalen von A speichern zu können, wird er auf $v_1 = 1$ normiert. Dies geschieht mit

$$v = \frac{x - \alpha e_1}{x_1 - \alpha} \quad (3.7)$$

Mit der Normierung kann man den Faktor $\tau = \frac{2}{v^T v}$ berechnen. Setze dazu (3.7) in die Definition von τ ein.

$$\tau = \frac{2}{v^T v} = \frac{2(x_1 - \alpha)^2}{(x - \alpha e_1)^T (x - \alpha e_1)} = \frac{2(x_1 - \alpha)^2}{\underbrace{\|x\|_2^2}_{=\alpha^2} - 2\alpha x^T e_1 + \alpha^2} = \frac{2(x_1 - \alpha)^2}{2\alpha(\alpha - x_1)} = \frac{\alpha - x_1}{\alpha}$$

Mit dem Faktor $\tau = \frac{2}{v^T v}$ kann man die Householder-Transformation schreiben als

$$H = I - 2 \frac{vv^T}{v^T v} = I - \tau vv^T$$

Algorithmus 1 Householder-Vector(LAPACK DLARFG)

Input: $x \in \mathbb{R}^n$

$\alpha = -1 \cdot \text{sign}(x_1) \|x\|_2$

$\tau = \frac{\alpha - x_1}{\alpha}$

$v = \frac{x - \alpha e_1}{x_1 - \alpha}$

Output: Householder-Vektor v , τ

3.2.2 Householder-Transformation anwenden

Ein aufwändiges Matrix-Matrix-Produkt kann bei der Anwendung einer Householder-Transformation $H = I - \tau vv^T$ auf die Matrix A umgangen werden, indem man

geschickt klammert.

$$HA = (I - \tau vv^T)A = A - \tau(vv^T)A = A - \tau v(v^T A)$$

Statt eines Matrix-Matrix-Produkts muss man nur ein Matrix-Vektor-Produkt und ein dyadisches Produkt berechnen.

3.2.3 QR-Zerlegung mittels Housholder-Transformationen

Um A in eine obere Dreiecksmatrix R zu transformieren, wird eine Folge von Housholder-Transformationen auf A angewendet.

Zuerst wird aus der ersten Spalte der Matrix A ein Householder-Vektor berechnet, dann wird die Householder-Transformationen auf die Matrix angewandt. Diese Housholder-Transformation erzeugt Nullen in der ersten Spalte unterhalb des ersten Eintrags. Damit eine obere Dreiecksmatrix entsteht, wird als nächstes die Matrix A ohne die erste Zeile und Spalte betrachtet. Aus der ersten Spalte der neu betrachteten Matrix wird wieder ein Householder-Vektor berechnet und die Householder-Transformationen auf die Matrix angewandt. Führt man nach diesem Schema immer weiter fort, entsteht eine obere Dreiecksmatrix.

$$H_1 A = \begin{pmatrix} * & * & * & * \\ 0 & * & * & * \\ 0 & * & * & * \\ 0 & * & * & * \end{pmatrix}, \quad H_2 H_1 A = \begin{pmatrix} * & * & * & * \\ 0 & * & * & * \\ 0 & 0 & * & * \\ 0 & 0 & * & * \end{pmatrix}$$

$$H_i = \begin{pmatrix} I_{i-1} & 0 \\ 0 & \tilde{H}_i \end{pmatrix}$$

I_{i-1} bezeichnet die $i - 1$ dimensionale Einheitsmatrix, \tilde{H}_i ist eine Householder-Transformation.

H1 und H2 und dann Hi

So erhält man die Faktorisierung

$$R = H_{n-1} H_{n-2} \cdot \dots \cdot H_1 A \Leftrightarrow A = (H_1 \cdot \dots \cdot H_{n-1}) R \Rightarrow Q = H_1 \cdot \dots \cdot H_{n-1}$$

3 QR-Zerlegung

Q ist das Produkt aller Householder-Transformationen. Diese Vorgehensweise führt zum Algorithmus 2.

Algorithmus 2 Ungeblockte Householder-Transformation.

Zur übersichtlicheren Beschreibung des Algorithmus werden die Bezeichnungen A_i und \hat{a}_i eingeführt. A_i zeigt auf einen Matrixblock der am i -ten Diagonalelement beginnt. \hat{a}_i zeigt auf die i -te Spalte unterhalb der Diagonalen. Matrizen sind 0-indiziert notiert.

```
1: Input:  $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$ 
2: for  $i = 0, 1, 2, \dots, n-1$  do
3:    $(v_i, \tau_i) \leftarrow \text{householdervector}(\hat{a}_i)$ 
4:    $w \leftarrow v_i^T A_i$  (dgemv)
5:    $A_i \leftarrow \tau * v * w + A_i$  (dger)
6:   if  $i < m$  then
7:      $\hat{a}_i \leftarrow v$ 
8:   end if
9: end for
10: Output:  $A$  QR zerlegt, Vektor  $\tau \in \mathbb{R}^n$ 
```

Der Algorithmus 2 überschreibt die Matrix A mit R . Aufgrund der Dreiecksstruktur von R , können unter der Diagonale die Householder-Vektoren gespeichert werden. Die Householder-Vektoren haben die Form

$$v^{(j)} = (\underbrace{0, \dots, 0}_{j-1}, 1, v_{j+1}^{(j)}, \dots, v_m^{(j)})$$

Da die ersten $j - 1$ Einträge Null sind und der Vektor so normiert wurde, dass der j Eintrag gleich 1 ist, müssen die ersten j Einträge nicht gespeichert werden. Die Householder-Vektoren können somit unterhalb der Diagonalen gespeichert werden. Das geschieht im Algorithmus 2 in Zeile 7. Die Matrix A hat somit die Form

$$A = \begin{pmatrix} r_{1,1} & r_{1,2} & r_{1,3} \\ v_2^{(1)} & r_{2,2} & r_{2,3} \\ v_3^{(1)} & v_3^{(2)} & r_{3,3} \\ v_4^{(1)} & v_4^{(2)} & v_4^{(3)} \end{pmatrix}$$

Raus arbeiten dass man wenig Speicher braucht

Q nicht ganz braucht nur Vektor τ

3.3 Geblockte QR-Zerlegung

Ein geblockter Algorithmus ist sinnvoll, um bei großen Matrizen den Cache optimal zu nutzen.

Im Folgenden wird ein geblockter Algorithmus beschrieben wie er auch von LAPACK verwendet wird. Die entsprechende Funktion bei LAPACK heißt „DGEQRF“ [6].

Die Idee beim geblockten Algorithmus ist, die Matrix in Blöcke aufzuteilen, die geblockte QR-Zerlegung für die Blöcke zu berechnen und die dabei verwendeten Householder-Transformationen auf den Rest der Matrix anzuwenden.

Betrachte dazu die Matrix $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$ geblockt, mit einer geeigneten Blockgröße b_s .

$$A = \left(\begin{array}{c|c} A_{0,0} & A_{0,b_s} \\ \hline A_{b_s,0} & A_{b_s,b_s} \end{array} \right) \quad (3.8)$$

Die Abbildung 3.2 zeigt schematisch die Partitionierung von A .

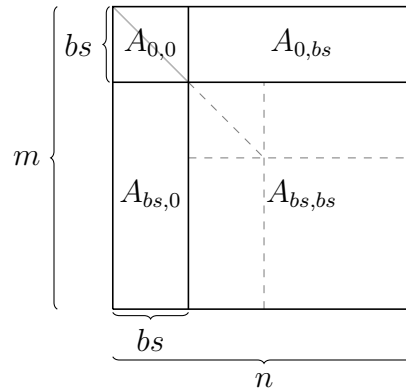


Abbildung 3.2: Aufteilung der Matrix A

Die Blockgröße b_s wird so gewählt, dass die Geschwindigkeit der ungeblockten QR-Zerlegung für den Block $\begin{pmatrix} A_{0,0} \\ A_{b_s,0} \end{pmatrix}$ optimal ist.

Für diesen Block wird die QR-Zerlegung mit dem ungeblockten Algorithmus (Algorithmus 2) berechnet.

$$\begin{pmatrix} A_{0,0} \\ A_{b_s,0} \end{pmatrix} \leftarrow \begin{pmatrix} Q_{0,0} \setminus R_{0,0} \\ Q_{b_s,0} \end{pmatrix} \quad (3.9)$$

Im Block $A_{0,0}$ steht auf und über der Diagonalen $R_{0,0}$. Unterhalb der Diagonalen und im Block $A_{bs,0}$ stehen die Householder-Vektoren.

Nun muss man die bei der ungeblocketen QR-Zerlegung verwendeten Householder-Transformationen auf die restliche Matrix $\begin{pmatrix} A_{0,bs} \\ A_{bs,bs} \end{pmatrix}$ anwenden.

Das Produkt mehrerer Householder-Transformationen kann geschrieben werden als:

$$H_1 H_2 \cdots H_k = I - V T V^T \quad \text{mit} \quad H_i = I - \tau_i v_i v_i^T$$

[2]

Die Anwendung der Householder-Transformationen $I - V * T * V^T$ auf $\begin{pmatrix} A_{bs,bs} \\ A_{bs,bs} \end{pmatrix}$ erfolgt in 2 Schritten. Zuerst wird die Matrix T berechnet. Dann wird $I - V * T * V^T$ auf $\begin{pmatrix} A_{bs,bs} \\ A_{bs,bs} \end{pmatrix}$ angewandt.

$$\begin{pmatrix} A_{0,bs} \\ A_{bs,bs} \end{pmatrix} \leftarrow H^T \begin{pmatrix} A_{0,bs} \\ A_{bs,bs} \end{pmatrix} \quad (3.10)$$

Der Block $A_{bs,bs}$ wird erneut aufgeteilt. Das ist in Abbildung 3.2 gestrichelt dargestellt. Dies wird solange fortgesetzt, bis $A_{bs,bs}$ gleich der Blockgröße ist.

3.3.1 Berechnung der Matrix T

Die Matrix T wird in LAPACK von der Funktion „DLARFT“ berechnet [5].

Sie bekommt eine Dreiecksmatrix $V \in \mathbb{R}^{m \times k}$, einen Vektor $\tau \in \mathbb{R}^k$ und eine Matrix $T \in \mathbb{R}^{k \times k}$ übergeben.

In der Dreiecksmatrix V stehen die Householder-Vektoren, im Vektor τ die zu den Householder-Vektoren gehörende τ_i .

Die Funktion berechnet eine obere Dreiecksmatrix T so, dass

$$H_1 H_2 \dots H_k = I - V T V^T \quad \text{mit} \quad H_i = I - \tau_i v_i v_i^T \quad (3.11)$$

Warum und wie das Verfahren funktioniert, wird hier beschreiben [2].

Algorithmus 3 Der Algorithmus berechnet die Matrix T so dass (3.11) gilt. Die untere Dreiecksmatrix V enthält die Householder-Vektoren. Der Vektor τ die dazugehörigen $\tau_i = \frac{2}{v_i^T v_i}$. Hinweise zur Notation: Kleine Buchstaben bezeichnen einen einzelnen Matrixeintrag (Beispiel $v_{i,j}$ ist der Eintrag der i -ten Zeile und j -ten Spalte der Matrix V). Die nach unten gestellten Indices geben einen Block an der betrachtet werden soll (Beispiel $V_{i:n,j:m}$ bezeichnet einen Block aus der Matrix V der von i -ten bis zur n -ten Zeile und von der j -ten bis zur m -ten Spalte geht).

```

1: Input  $V \in \mathbb{R}^{k \times n}, \tau \in \mathbb{R}^k, T \in \mathbb{R}^{k \times k}$ 
2: for  $i = 0, 1, 2, \dots, k$  do
3:   if  $\tau_i == 0$  then
4:      $T_{1:i,i} = 0$ 
5:   else
6:      $v_i = v_{i,i}$ 
7:      $v_{i,i} = 1$ 
8:      $T_{0:i,i} = -\tau_i \cdot V_{i:n-i,0:i}^T \cdot V_{i:n-i,i}$  (dgmV)
9:      $v_{i,i} = v_i$ 
10:     $T_{0:i,i} = T_{0:i,0:i} \cdot T_{0:i,i}$  (dtrmv)
11:     $t_{i,i} = \tau_i$ 
12:   end if
13: end for

```

Der Algorithmus 3 überschreibt die Matrix T nach folgendermaßen

$$T = \begin{pmatrix} \tau_1 & -\tau_1 \tau_2 (v_1^T v_2) & -\tau_1 \tau_2 \tau_3 (v_1^T v_2 v_2^T v_3) + \tau_1 \tau_3 (v_1^T v_3) \\ 0 & \tau_2 & -\tau_2 \tau_3 (v_2^T v_3) \\ 0 & 0 & \tau_3 \end{pmatrix}$$

Beispiel mit $k = 3$

3.3.2 Anwenden von $I - VTV^T$

Die Anwendung der Householder-Transformationen auf eine Matrix C wird in LAPACK von der Funktion „LARFB“ implementiert.

Die Funktion bekommt eine untere Dreiecksmatrix $V \in \mathbb{R}^{m \times k}$, eine obere Dreiecksmatrix $T \in \mathbb{R}^{k \times k}$ und eine Matrix $C \in \mathbb{R}^{m \times n}$ übergeben.

In der Dreiecksmatrix V stehen die Householder-Vektoren und T ist die zuvor berechnete Matrix. Die Matrix C wird upgedatet, indem die Matrix $I - VTV^T$ von rechts auf die Matrix C angewendet wird.

Ein weiterer Übergabeparameter gibt an, ob die Matrix $I - VTV^T$ transponiert werden soll. Die Funktion berechnet also

$$C \leftarrow HC = C - VTV^T C \quad \text{oder} \quad C \leftarrow H^T C = C - VT^T V^T C \quad (3.12)$$

Der Zweck der Funktion ist es, die Householder-Transformationen die bei der Bereicherung der QR-Zerlegung für einen Block entstanden sind, auf die restliche Matrix anzuwenden. Die Abbildung 3.3 zeigt, wie die Matrix A für die Funktion partitioniert wird.

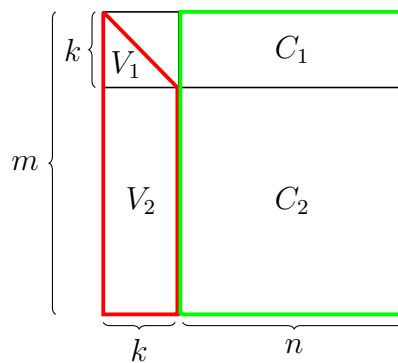


Abbildung 3.3: Partitionierung von A für larfb

falls $m > k$ werden die Matrizen V und C aufgeteilt in

$$V = \begin{pmatrix} V_1 \\ V_2 \end{pmatrix} \quad \text{und} \quad C = \begin{pmatrix} C_1 \\ C_2 \end{pmatrix} \quad (3.13)$$

Dabei wird V genau so geteilt, dass $V_1 \in \mathbb{R}^{k \times k}$ der quadratische Dreiecksteil der Matrix ist und $V_2 \in \mathbb{R}^{(m-k) \times k}$ der Rest der Matrix. Die Matrix C wird in $C_1 \in \mathbb{R}^{k \times n}$ und $C_2 \in \mathbb{R}^{(m-k) \times n}$ aufgeteilt. Die Aufteilung ist so gewählt, dass das Matrix-Matrix-Produkt $V_1 \cdot C_1$ und $V_2 \cdot C_2$ möglich ist.

Diese Aufteilung ist notwendig, da die BLAS-Funktion `trmm` (matrix-matrix product where one input matrix is triangular) nur für quadratische Dreiecksmatrizen implementiert ist.

Im Fall $m = k$ ist die Aufteilung nicht notwendig, da V quadratisch ist.

Mit folgender Umformung kommt man vom (3.12) auf Algorithmus 4/

$$\begin{aligned}
 C &\leftarrow C - VTV^T C \\
 C &\leftarrow C - (VTV^T C)^{TT} \\
 C &\leftarrow C - (C^T V T^T V^T)^T
 \end{aligned}$$

anwenden von (3.13). Aufteilen der Matrizen C und V .

$$\begin{aligned}
 \begin{pmatrix} C_1 \\ C_2 \end{pmatrix} &\leftarrow \begin{pmatrix} C_1 \\ C_2 \end{pmatrix} - \left(\begin{pmatrix} C_1 \\ C_2 \end{pmatrix}^T \cdot \begin{pmatrix} V_1 \\ V_2 \end{pmatrix} \cdot T \cdot \begin{pmatrix} V_1 \\ V_2 \end{pmatrix}^T \right)^T \\
 \begin{pmatrix} C_1 \\ C_2 \end{pmatrix} &\leftarrow \begin{pmatrix} C_1 \\ C_2 \end{pmatrix} - \left((C_1^T | C_2^T) \cdot \begin{pmatrix} V_1 \\ V_2 \end{pmatrix} \cdot T \cdot (V_1^T | V_2^T) \right)^T \\
 \begin{pmatrix} C_1 \\ C_2 \end{pmatrix} &\leftarrow \begin{pmatrix} C_1 \\ C_2 \end{pmatrix} - ((C_1^T \cdot V_1 + C_2^T \cdot V_2) \cdot T \cdot (V_1^T | V_2^T))^T
 \end{aligned}$$

$(C_1^T \cdot V_1 + C_2^T \cdot V_2)$ wird in Zeile 2 - 6 berechnet und das Ergebnis in W gespeichert. Die Matrix W ist eine Workspace-Matrix. In Zeile 7 wird $(C_1^T \cdot V_1 + C_2^T \cdot V_2) \cdot T$ berechnet in dem T auf W Multipliziert wird $W \leftarrow W \cdot T$.

$$\begin{aligned}
 \begin{pmatrix} C_1 \\ C_2 \end{pmatrix} &\leftarrow \begin{pmatrix} C_1 \\ C_2 \end{pmatrix} - (W \cdot (V_1^T | V_2^T))^T \\
 \begin{pmatrix} C_1 \\ C_2 \end{pmatrix} &\leftarrow \begin{pmatrix} C_1 \\ C_2 \end{pmatrix} - \begin{pmatrix} V_1 \\ V_2 \end{pmatrix} \cdot W^T \\
 \Rightarrow C_1 &\leftarrow C_1 - V_1 \cdot W^T \\
 C_2 &\leftarrow C_2 - V_2 \cdot W^T
 \end{aligned}$$

C_1 wird in Zeile 11 und 12 berechnet. C_2 in Zeile 8 - 10. mit BLAS-Routinen wie in Algorithmus 4 berechnet werden.

Algorithmus 4 $I - VTV^T$ auf C anwenden.

Die Matrix W ist ein Workspace. Die Matrizen V und C werden geteilt in V_1, V_2 und C_1, C_2 wie oben beschrieben.

```
1: Input:  $V \in \mathbb{R}^{m \times k}, T \in \mathbb{R}^{k \times k}, C \in \mathbb{R}^{m \times n}$ 
2:  $W \leftarrow C_1^T$  (copy)
3:  $W \leftarrow W * V_1$  (trmm)
4: if  $m > k$  then
5:    $W \leftarrow W + C_2^T * V_2$  (gemm)
6: end if
7:  $W \leftarrow W * T^T$  or  $W * T$  (trmm)
8: if  $m > k$  then
9:    $C_2 \leftarrow C_2 - V_2 * W^T$  (gemm)
10: end if
11:  $W \leftarrow W * V_1^T$  (trmm)
12:  $C_1 \leftarrow C_1 - W^T$ 
```

4 Implementierung und Benchmarks

Was wurde Implementiert und warum?

4.1 Bibliothek

Die verwendete Bibliothek wurde in der Vorlesung High Performance Computing 1 entwickelt [3].

Die Bibliothek ist in C++ geschrieben. Es sind Klassen für Matrizen und Vektoren implementiert, sowie einige BLAS-Routinen.

Die Matrix-Klassen erlauben den zugriff auf Matrixblöcke. Der folgender Code Soll beispiele den zugriff auf matrix blöcke veranschaulichen veranschaulichen

```
1 GenereMatrix<T> A(5,5);  
2 print(A);  
3 print(A.block(2,2));  
4 print(A.block(2,2).view(Trans::view));
```

erzeugt die Ausgabe

```
A =  
    0.4162    0.1087    0.6753   -0.3967   -0.5583  
   -0.6969    0.4358    0.6349   -0.6566    0.8933  
    0.9340    0.7451   -0.2149   -0.0740   -0.1027  
    0.5809    0.5491    0.0163    0.1676   -0.9108  
   -0.4325   -0.0732   -0.1847   -0.1897   -0.0717  
  
A =  
   -0.2149   -0.0740   -0.1027  
    0.0163    0.1676   -0.9108  
   -0.1847   -0.1897   -0.0717
```

```
A =  
-0.2149    0.0163   -0.1847  
-0.0740    0.1676   -0.1897  
-0.1027   -0.9108   -0.0717
```

4.1.1 Algorithmus

Beispiel Ungeblockte QR Implementierung vom Algorithmus 2

```
1 size_t mn = std::min(m,n);  
2 DenseVector<T> work(mn);  
3 for (std::size_t i = 0; i < mn; ++i){  
4     householderVector(A(i,i), A.col(i+1,i),tau(i));  
5     if (i < n && tau(i) != 0) {  
6         AII = A(i,i);  
7         A(i,i) = 1;  
8         mv(1, A.block(i,i+1).view(hpc::matvec::Trans::view),  
9             A.col(i,i), 0, work.block(i+1));  
10        rank1(-tau(i), A.col(i,i), work.block(i+1),  
11              A.block(i,i+1));  
12        A(i,i) = AII;  
13    }  
14 }
```

Die anderen Algorithmen wurden analog implementiert siehe Anhang.

4.2 Aufwand

Die QR-Zerlegung einer Matrix $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$ erfordert

$$n^2(m - \frac{1}{3}n) + \mathcal{O}(mn) \quad \text{oder 2 mal LRs}$$

Rechenoperationen. Quelle???

4.2.1 FLOPS

FLPOS (Floating Point Operations Per Second)

4.3 Fehlerschätzer

Um zu testen ob die QR-Zerlegung korrekt ist, ist ein Fehlerschätzer notwendig. Es wurde der Fehlerschätzer von ATLAS[1] verwendet.

$$err = \frac{\|A - QR\|_i}{\|A\|_i \cdot \min(m, n) \cdot \varepsilon} \quad (4.1)$$

$\|\cdot\|_i$ ist eine passende Norm. Die Matrizen Q und R sind die QR-Zerlegung der Matrix $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$. ε ist die kleinste darstellbare Zahl.

Die QR-Zerlegung ist gut genug falls der Fehler kleiner 1 ist $err < 1$.

Als Norm wurde die Zeilensummennorm $\|\cdot\|_\infty$ gewählt. Diese ist für eine Matrix $A \in \mathbb{R}^{m \times n}$ gegeben durch

$$\|A\|_\infty = \max_{i=1, \dots, m} \sum_{j=1}^n |a_{ij}|$$

Diese Norm wurde gewählt das sie sich leicht berechnen lässt.

ε ist auf dem Test-System $2.220446 \cdot 10^{-16}$

4.4 Benchmarks

4.4.1 Test System

Getestet wurde auf einem System mit einer Intel(R) Core(TM) i5-3470 CPU mit 3.20GHz.

Die Theoretische peak performance errechnet sich aus der Taktrate mal die Registerbreite mal 2. Quelle???

Die CPU des Test Systems hat eine Taktrate von 3.20GHz. Die AVX-Register sind 256-Bit groß. Darin haben 4 double Platz.

Taktrate · Registerbreite · 2 = 3,20 GHz · 4 · 2 = 25,6 GFLOPs

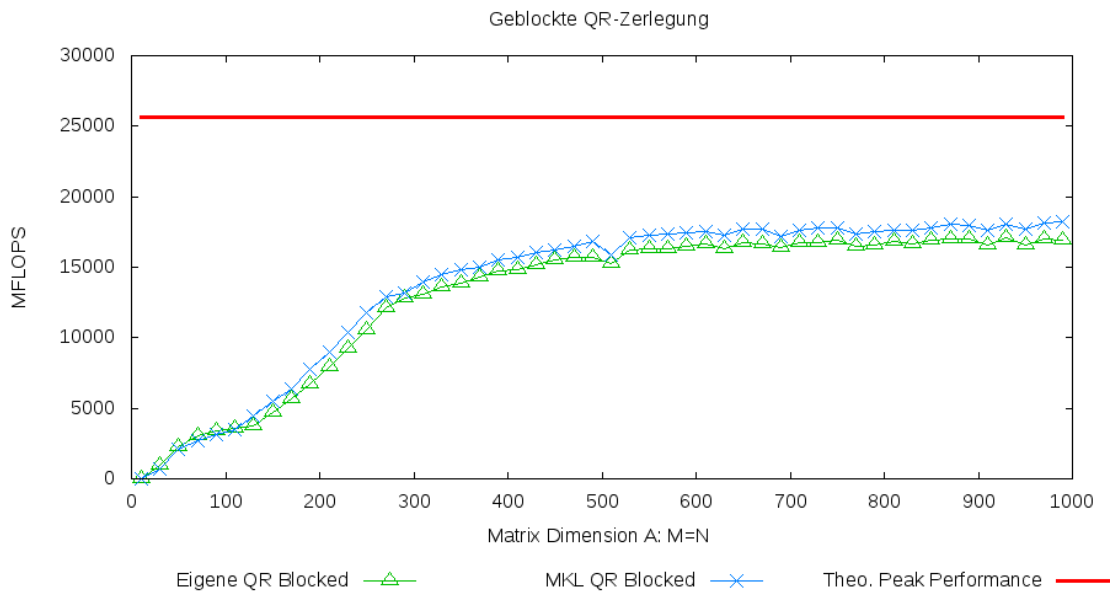


Abbildung 4.1: Benchmark geblockte QR-Zerlegung

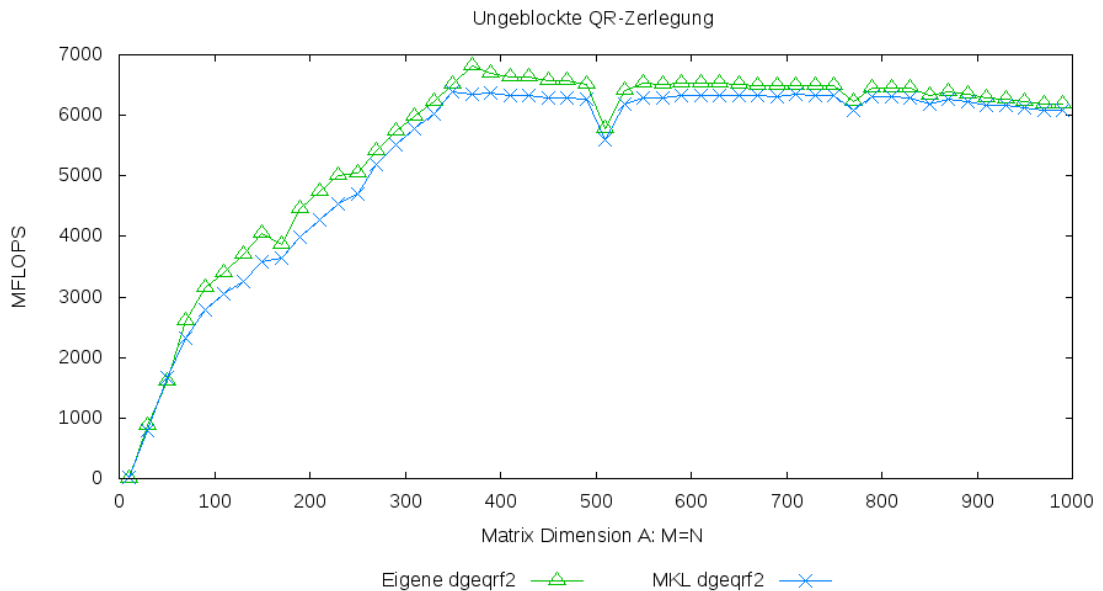


Abbildung 4.2: Benchmark ungeblockte QR-Zerlegung

A Block Reflector

Das Produkt aus Householder-Transformationen $H_1 \cdot \dots \cdot H_n$ lässt sich schreiben als

$$H_1 \cdot \dots \cdot H_n = I - VTV^T$$

mit einer unteren Dreiecksmatrix $V \in \mathbb{R}^{m \times n}$ die die Housholder-Vektoren enthält und eine oberen Dreiecksmatrix $T \in \mathbb{R}^{n \times n}$ [2]

Beweis:

n=2 Vorwärts

$$\begin{aligned} H_1 H_2 x &= (I - \tau_1 v_1 v_1^T)(I - \tau_2 v_2 v_2^T)x \\ &= (I - \tau_1 v_1 v_1^T - \tau_2 v_2 v_2^T + \tau_1 v_1 v_1^T \tau_2 v_2 v_2^T)x \\ &= x - \tau_1 v_1 v_1^T x - \tau_2 v_2 v_2^T x + \tau_1 \tau_2 v_1 (v_1^T v_2) v_2^T x \\ &= x - \tau_1 v_1 v_1^T x - \tau_2 v_2 v_2^T x + \tau_1 \tau_2 (v_1^T v_2) v_1 v_2^T x \end{aligned}$$

Rückwärts

$$\begin{aligned} H_{1,2} x &= (I - VTV^T)x = x - VTV^T x \\ &= x - (v_1, v_2) \begin{pmatrix} a & b \\ 0 & c \end{pmatrix} \begin{pmatrix} v_1^T \\ v_2^T \end{pmatrix} x \\ &= x - (v_1, v_2) \begin{pmatrix} a & b \\ 0 & c \end{pmatrix} \begin{pmatrix} v_1^T x \\ v_2^T x \end{pmatrix} \\ &= x - (v_1, v_2) \begin{pmatrix} av_1^T x + bv_2^T x \\ cv_2^T x \end{pmatrix} \\ &= x - v_1(av_1^T x + bv_2^T x) - v_2(cv_2^T x) \\ &= x - av_1 v_1^T x - bv_1 v_2^T x - cv_2 v_2^T x \end{aligned}$$

Koeffizienten Vergleich

$$a = \tau_1$$

$$b = -\tau_1 \tau_2 (v_1^T v_2)$$

$$c = \tau_2$$

$$T = \begin{pmatrix} \tau_1 & -\tau_1 \tau_2 (v_1^T v_2) \\ 0 & \tau_2 \end{pmatrix}$$

n=3

Vorwärts

$$\begin{aligned}
 H_1 H_2 H_3 x &= (I - \tau_1 v_1 v_1^T)(I - \tau_2 v_2 v_2^T)(I - \tau_3 v_3 v_3^T)x \\
 &= (I - \tau_1 v_1 v_1^T - \tau_2 v_2 v_2^T + \tau_1 v_1 v_1^T \tau_2 v_2 v_2^T)(I - \tau_3 v_3 v_3^T)x \\
 &= (I - \tau_1 v_1 v_1^T - \tau_2 v_2 v_2^T - \tau_3 v_3 v_3^T \\
 &\quad + \tau_1 v_1 v_1^T \tau_2 v_2 v_2^T + \tau_1 v_1 v_1^T \tau_3 v_3 v_3^T + \tau_2 v_2 v_2^T \tau_3 v_3 v_3^T \\
 &\quad - \tau_1 v_1 v_1^T \tau_2 v_2 v_2^T \tau_3 v_3 v_3^T)x \\
 &= x - \tau_1 v_1 v_1^T x - \tau_2 v_2 v_2^T x - \tau_3 v_3 v_3^T x \\
 &\quad + \tau_1 \tau_2 (v_1^T v_2) v_1 v_2^T x + \tau_1 \tau_3 (v_1^T v_3) v_1 v_3^T x + \tau_2 \tau_3 (v_2^T v_3) v_2 v_3^T x \\
 &\quad - \tau_1 \tau_2 \tau_3 (v_1^T v_2 v_2^T v_3) v_1 v_3^T x
 \end{aligned}$$

Rückwärts

$$\begin{aligned}
 H_{1,2,3} x &= (I - V T V^T) x = x - V T V^T x \\
 &= x - (v_1, v_2, v_3) \begin{pmatrix} a & b & c \\ 0 & d & e \\ 0 & 0 & f \end{pmatrix} \begin{pmatrix} v_1^T \\ v_2^T \\ v_3^T \end{pmatrix} x \\
 &= x - (v_1, v_2, v_3) \begin{pmatrix} a & b & c \\ 0 & d & e \\ 0 & 0 & f \end{pmatrix} \begin{pmatrix} v_1^T x \\ v_2^T x \\ v_3^T x \end{pmatrix} \\
 &= x - (v_1, v_2, v_3) \begin{pmatrix} a v_1^T x + b v_2^T x + c v_3^T x \\ d v_2^T x + e v_3^T x \\ f v_3^T x \end{pmatrix} \\
 &= x - v_1 (a v_1^T x + b v_2^T x + c v_3^T x) \\
 &\quad - v_2 (d v_2^T x + e v_3^T x) \\
 &\quad - v_3 (f v_3^T x) \\
 &= x - a v_1 v_1^T x - b v_1 v_2^T x - c v_1 v_3^T x \\
 &\quad - d v_2 v_2^T x - e v_2 v_3^T x \\
 &\quad - f v_3 v_3^T x
 \end{aligned}$$

Koeffizienten Vergleich

$$a = \tau_1$$

$$b = -\tau_1 \tau_2 (v_1^T v_2)$$

$$c = -\tau_1 \tau_2 \tau_3 (v_1^T v_2 v_2^T v_3) + \tau_1 \tau_3 (v_1^T v_3)$$

$$d = \tau_2$$

$$e = -\tau_2 \tau_3 (v_2^T v_3)$$

$$f = \tau_3$$

$$T = \begin{pmatrix} a & b & c \\ 0 & d & e \\ 0 & 0 & f \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \tau_1 & -\tau_1 \tau_2 (v_1^T v_2) & -\tau_1 \tau_2 \tau_3 (v_1^T v_2 v_2^T v_3) + \tau_1 \tau_3 (v_1^T v_3) \\ 0 & \tau_2 & -\tau_2 \tau_3 (v_2^T v_3) \\ 0 & 0 & \tau_3 \end{pmatrix}$$

Mit Induktion kann man zeigen... siehe paper Im Paper wird gezeigt wie man das verallgemeinern kann.

A.0.1 Orthogonal

Eine quadratische Matrix $Q \in \mathbb{R}^{n \times n}$ ist orthogonal, dann gilt

$$QQ^T = Q^T Q = I$$

Produkt orthogonaler Matrizen ist orthogonal. Sei $A^{-1} = A^T, B^{-1} = B^T$

$$(AB)^{-1} = B^{-1}A^{-1} = B^T A^T = (AB)^T$$

Die Householder-Transformation $H = I - 2\frac{vv^T}{v^T v}$ ist symmetrisch und orthogonal das heißt $H^{-1} = H^T$

Da vv^T symmetrisch ist $((vv^T)^T = vv^T)$, folgt

$$H^T = \left(I - 2\frac{vv^T}{v^T v} \right)^T = I - 2\frac{vv^T}{v^T v} = H$$

Orthogonalität

$$HH^T = \left(I - 2\frac{vv^T}{v^T v} \right) \left(I - 2\frac{vv^T}{v^T v} \right) = I - 2\frac{vv^T}{v^T v} - 2\frac{vv^T}{v^T v} + \underbrace{4\frac{vv^T vv^T}{(v^T v)^2}}_{=4\frac{(v^T v)vv^T}{(v^T v)^2} = 4\frac{vv^T}{v^T v}} = I$$

$\Rightarrow H = I - VTV^T$ und Q sind orthogonal

Literaturverzeichnis

- [1] *Automatically Tuned Linear Algebra Software (ATLAS)*. <http://math-atlas.sourceforge.net/>, . – [Online; zugegriffen 12-06-2018]
- [2] JOFFRAIN, Thierry ; LOW, Tze M. ; QUINTANA-ORTÍ, Enrique S. ; GEIJN, Robert van d. ; ZEE, Field G. V.: Accumulating Householder Transformations, Revisited. In: *ACM Trans. Math. Softw.* 32 (2006), Juni, Nr. 2, 169–179. <http://dx.doi.org/10.1145/1141885.1141886>. – DOI 10.1145/1141885.1141886. – ISSN 0098–3500
- [3] LEHN MICHAEL, Borchert A.: *Vorlesung High Performance Computing 1*. <http://www.mathematik.uni-ulm.de/numerik/hpc/ws17/>, 2017. – [Online; zugegriffen 31-05-2018]
- [4] STEFAN A. FUNKEN, Karsten U.: *Einführung in die Numerische Lineare Algebra*. Ulm, Germany, 2016
- [5] TENNESSEE, Univ. of California B. o. ; LTD., NAG: *DLARFT forms the triangular factor T of a real block reflector H of order n , which is defined as a product of k elementary reflectors*. <http://www.netlib.org/lapack/explore-3.1.1-html/dgeqrf.f.html#DGEQRF.1>, 2006. – [Online; zugegriffen 12-06-2018]
- [6] TENNESSEE, Univ. of California B. o. ; LTD., NAG: *LAPACK blocked QR*. <http://www.netlib.org/lapack/explore-3.1.1-html/dgeqrf.f.html>, 2006. – [Online; zugegriffen 31-01-2018]
- [7] TENNESSEE, Univ. of California B. o. ; LTD., NAG: *LAPACK unblocked QR*. <http://www.netlib.org/lapack/explore-3.1.1-html/dgeqr2.f.html>, 2006. – [Online; zugegriffen 31-01-2018]
- [8] TENNESSEE, University of: *BLAS Technical Forum*. <http://www.netlib.org/blas/blast-forum/>, 2001. – [Online; zugegriffen 03-06-2018]

Name: Florian Krötz

Matrikelnummer: 884948

Erklärung

Ich erkläre, dass ich die Arbeit selbständig verfasst und keine anderen als die angegebenen Quellen und Hilfsmittel verwendet habe.

Ulm, den

Florian Krötz