激光 SLAM 第 6 次作业

1. 补充代码,实现高斯牛顿方法对 Pose-Graph 进行优化

首先从 main.cpp 中的 main 函数开始,程序从 VertexPath 和 EdgePath 文件中分别读取顶点和边的信息,并将其存储在两个容器中:

```
std::vector<Eigen::Vector3d> Vertexs;
std::vector<Edge> Edges;

ReadVertexInformation(VertexPath, Vertexs);
ReadEdgesInformation(EdgePath, Edges);
```

这里的边使用了自定义的数据结构 edge, 可存储该条边连接的顶点的 id,该条边的测量值(即顶点 xj 相对于顶点 xi 的位姿关系),以及测量值的信息矩阵(可看作是测量协方差矩阵的倒数):

```
7 // 自定义边的数据结构
8 typedef struct edge
9 {
10 int xi,xj; // 边连接的两个顶点的序号
11 Eigen::Vector3d measurement;
12 Eigen::Matrix3d infoMatrix;
13 }Edge;
```

dat 文件的数据存储形式如下,比如存储顶点的文件 inter-v.dat 内每一行存储一个顶点的 id, x, y, theta 存储边的文件 inter-e.dat 内每一行存储该条边连接的两个顶点的 id, dx, dy, dy, dx, dx, dy, dx, dy, dx, dy, dx, dy, dx, dx,

```
Æ
VERTEX2 0 0.651000 -0.027000 -0.365602
VERTEX2 1 0.659919 -0.033567 -0.942612
VERTEX2 2 0.653211 -0.064950 -1.459089
VERTEX2 3 0.712883 0.017133 -1.940922
VERTEX2 4 0.703227 0.077209 -2.473351
VERTEX2 5 0.754614 0.134824 -3.019333
                                                                      intel-e.dat
          ,<del>П</del>,
 Open ▼
EDGE2 1 0 -0.010554 -0.003357 0.577010 20.000000 0.000000 20.000000 100.000000 0.000000 0.000000
EDGE2 2 1 -0.030440 0.010165 0.516477 20.000000 0.000000 20.000000 100.000000 0.000000 0.000000
EDGE2 3 2 0.098110 -0.025939 0.481833 20.000000 0.000000 20.000000 100.000000 0.000000 0.000000
EDGE2 4 3 0.029644 0.053137 0.532429 20.000000 0.000000 20.000000 100.000000 0.000000 0.000000
EDGE2 5 4 0.058030 0.050918 0.545982 20.000000 0.000000 20.000000 100.000000 0.000000 0.000000
EDGE2 6 5 -0.035640 0.054028 0.530305 20.000000 0.000000 20.000000 100.000000 0.000000 0.000000
EDGE2 6 4 -0.002002 0.115300 1.069530 100.000000 0.000000 100.000000 1000.000000 0.000000 0.000000
EDGE2 7 6 -0.112894 -0.029274 0.500426 20.000000 0.000000 20.000000 100.000000 0.000000 0.000000
```

读取完数据后,使用高斯牛顿法对节点的位姿进行优化。即设置一个 for 循环,通过调用函数 LinearizeAndSolve(Vertexs, Edges)来计算每一步的节点位姿更新量 dx,将 dx 累加到原来的节点位姿 上。一旦满足收敛条件,就结束循环,优化结束。

然后,进入到源文件 gaussian_newton.cpp 中的函数 LinearizeAndSolve(Vertexs, Edges)内。首先我们需要根据位姿节点数量来初始化矩阵 H 和向量 b。然后为了使得每次优化的位姿更新量都相对于同一个坐标系而言,我们需要加入一个约束让某一个位姿固定。这里我们给 Hessian 矩阵的前三维加上一个单位阵,这样第一个位姿节点的更新量就始终为 0,使得第一个位姿节点得以固定:

然后我们使用容器 Edges 中的回环边信息和 Vertexs 中计算出的帧间边信息来构建矩阵 H 和向量 b。然后通过解方程 H dx = -b 来计算获得节点位姿更新量 dx。

```
for(int i = 0; i < Edges.size();i++)</pre>
     //提取信息
     Edge tmpEdge = Edges[i];
     Eigen::Vector3d xi = Vertexs[tmpEdge.xi];
     Eigen::Vector3d xj = Vertexs[tmpEdge.xj];
     Eigen::Vector3d z = tmpEdge.measurement;
     Eigen::Matrix3d infoMatrix = tmpEdge.infoMatrix;
     //计算误差和对应的Jacobian
     Eigen::Vector3d ei:
     Eigen::Matrix3d Ai;
     Eigen::Matrix3d Bi;
     CalcJacobianAndError(xi,xj,z,ei,Ai,Bi);
     //TODO--Start
     int index i, index j;
     index i = tmpEdge.xi;
     index_j = tmpEdge.xj;
     // 这里节点和边是从0开始计数的
     H.block(index_i*3, index_i*3, 3, 3) += Ai.transpose() * infoMatrix * Ai;
     H.block(index_i*3, index_j*3, 3, 3) += Ai.transpose() * infoMatrix * Bi;
H.block(index_j*3, index_i*3, 3, 3) += Bi.transpose() * infoMatrix * Ai;
H.block(index_j*3, index_j*3, 3, 3) += Bi.transpose() * infoMatrix * Bi;
     b.segment(index_i*3, 3) += Ai.transpose() * infoMatrix * ei;
     b.segment(index j*3, 3) += Bi.transpose() * infoMatrix * ei;
Eigen::VectorXd dx;
dx = H.ldlt().solve(-b);
                                     // 由于对称矩阵H可以保证为半正定矩阵,所以可以用ldlt求解
//TODO-End
```

这里为了计算雅可比矩阵 Ai 和 Bi,以及预测和观测的误差项 ei,我们调用函数

CalcJacobianAndError(xi,xj,z,ei,Ai,Bi)_o

```
void CalcJacobianAndError(Eigen::Vector3d xi,Eigen::Vector3d xj,Eigen::Vector3d z,
                                    Eigen::Vector3d& ei, Eigen::Matrix3d& Ai, Eigen::Matrix3d& Bi)
           // Estimated Pose
          Eigen::Matrix2d Ri;
          Ri << cos(xi(2)), -sin(xi(2)),
| sin(xi(2)), cos(xi(2));
| Eigen::Vector2d tj = Eigen::Vector2d(xj(0), xj(1));
| Eigen::Vector2d ti = Eigen::Vector2d(xi(0), xi(1));
92
94
95
           double theta_j = xj(2);
97
98
          double theta i = xi(2);
           // Measured Pose
           Eigen::Matrix2d Rij;
          Rij \ll \cos(z(2)), -\sin(z(2)), \sin(z(2)), \cos(z(2));
           Eigen::Vector2d tij = Eigen::Vector2d(z(0), z(1));
104
           double theta ij = z(2);
           // 计算error
           ei << Rij.transpose() * (Ri.transpose()*(tj - ti) - tij),</pre>
                   theta_j - theta_i - theta_ij;
           // 注意: 必须进行角度正则化,保证角度在-pi~pi之间,否则优化容易出问题!!!
// 因为有时候当我们朝着梯度下降的方向去优化角度时,由于没有正则化,角度反而会增大,导致优化产生错乱
           ei(2) = GN NormalizationAngle(ei(2));
           // 当然也可以使用变换矩阵求解,由于TransToPose函数中使用了atan2,所以角度也会被自动限定在-pi~pi之间,而无需进行角度正则化
115
116
          // Jacobian dei / dxi
Eigen::Matrix2d dRi_dtheta;
          120
121
122
123
124
                                                            Rij.transpose() * dRi_dtheta.transpose() * (tj - ti),
                  Eigen::Vector2d(0,0).transpose(),
          Bi << Rij.transpose() * Ri.transpose(), Eigen::Vector2d(0,0),
                   Eigen::Vector2d(0,0).transpose(), 1;
128
```

这里使用了课上给出的公式来计算 ei, Ai, Bi:

• 误差函数的矩阵形式:

ei -----
$$e_{ij}(x) = \begin{cases} R_{ij}^T (R_i^T (t_j - t_i) - t_{ij}) \\ \theta_j - \theta_i - \theta_{ij} \end{cases}$$

• 对应的Jacobian矩阵:

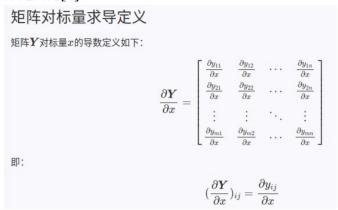
Ai -----
$$\frac{\partial e_{ij}(x)}{\partial x_i} = \begin{bmatrix} -R_{ij}^T R_i^T & R_{ij}^T \frac{\partial R_i^T}{\partial \theta} (t_j - t_i) \\ 0 & -1 \end{bmatrix}$$

Bi -----
$$\frac{\partial e_{ij}(x)}{\partial x_i} = \begin{bmatrix} R_{ij}^T R_i^T & 0\\ 0 & 1 \end{bmatrix}$$

其中值得注意的有两点:

1. 这里需要计算 $\frac{\partial R_i^T}{\partial \theta}$

其中矩阵对标量的导数定义为[1]:

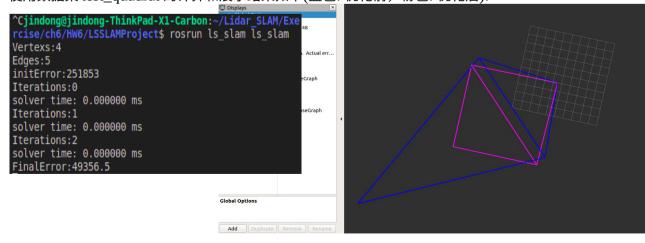


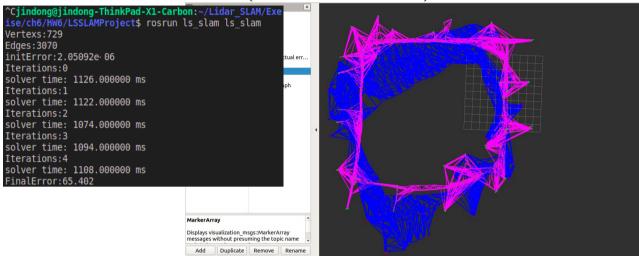
2. 计算预测和观测的误差项 ei 时,我们一定要将其中的角度误差项进行正则化,即保证其取值范围为 $-pi \sim pi$ 之间,否则会使得优化结果产生错乱,无法快速收敛。因为有时候由于角度没有正则化,当我们 朝着梯度下降的方向去优化角度时,角度反而会增大。比如角度误差为-182 度时,当它向梯度下降的方向,即-180 度进行优化时,此时-180 度反而离 0 度更远了,优化产生了错乱。角度误差正则化如下:

为了展示节点优化结果,我们使用了消息类型 visualization_msgs::MarkerArray, 将图优化前后节点的位姿进行发布:

```
// beforeGraph
// beforeGraph
// beforeGraphPub,afterGraphPub;
beforeGraphPub = nodeHandle.advertise<visualization_msgs::MarkerArray>("beforePoseGraph",1,true);
afterGraphPub = nodeHandle.advertise<visualization_msgs::MarkerArray>("afterPoseGraph",1,true);
```

使用数据集 test_quadrat 的计算和展示结果如下(蓝色: 优化前,粉色: 优化后):





使用数据集 intel 的计算和展示结果如下(蓝色: 优化前,粉色: 优化后):

2. 简答题,开放性答案:你认为第一题的优化过程中哪个环节耗时最多?是否有什么改进的方法可以进行加速?

应该是解方程 H dx = -b 来计算获得节点位姿更新量 dx 这个地方耗时最多。这里使用了 eigen 的 ldlt 方法来进行稠密矩阵求解。由于 H 矩阵的稀疏性质,我们可以使用 Eigen 提供的稀疏矩阵求解器[2][3]来进行加速(比如 ldlt 对应的稀疏求解法 SimplicialLDLT)。同时头文件需要包含 Cholesky 稀疏矩阵求解库 #include<Eigen/SparseCholesky> 或者整个稀疏矩阵求解库 #include<Eigen/Sparse>。代码如下:

我们使用数据集 intel, 计算用时如下:

```
^Cjindong@jindong-ThinkPad-X1-Carbon:~/Lidar_SLAM/Exe
ise/ch6/HW6/LSSLAMProject$ rosrun ls_slam ls_slam
Vertexs:729
Edges:3070
initError:2.05092e-06
Iterations:0
solver time: 32.000000 ms
Iterations:1
solver time: 34.000000 ms
Iterations:2
solver time: 36.000000 ms
Iterations:3
solver time: 31.000000 ms
Iterations:4
solver time: 31.000000 ms
Iterations:4
solver time: 31.000000 ms
```

我们发现,相比于稠密矩阵 ldlt 求解每次迭代约 1000ms,稀疏矩阵求解 SimplicialLDLT 每次迭代只需要大概 30ms,快了约 30 倍。

3. 学习相关材料。除了高斯牛顿方法,你还知道哪些非线性优化方法?请简述它们的原理

除了高斯牛顿法以外,SLAM 中用的比较多的还有 Levenberg Margquart (LM)法,Dogleg 法等。 a) LM 法。VIO 课程中对 LM 法进行了介绍:

The Levenberg-Marquardt Method

Levenberg (1944) 和 Marquardt (1963) 先后对高斯牛顿法进行了改进, 求解过程中引入了阻尼因子:

$$\left(\mathbf{J}^{\top}\mathbf{J} + \mu\mathbf{I}\right)\Delta\mathbf{x}_{lm} = -\mathbf{J}^{\top}\mathbf{f} \quad \text{ with } \ \mu \geq 0$$

阳尼因子的作用

- $\mu > 0$ 保证 $\left(\mathbf{J}^{\top} \mathbf{J} + \mu \mathbf{I} \right)$ 正定,迭代朝着下降方向进行。
- μ 非常大,则 $\Delta \mathbf{x}_{lm} = -\frac{1}{\mu} \mathbf{J}^{\top} \mathbf{f} = -\frac{1}{\mu} F'(\mathbf{x})^{\top}$,接近最速下降法.
- μ 比较小,则 $\Delta \mathbf{x}_{lm} pprox \Delta \mathbf{x}_{gn}$,接近高斯牛顿法。

阳尼因子 4 的更新策略

定性分析,直观感受阻尼因子的更新:

- ① 如果 $\Delta x \to F(x) \uparrow$,则 $\mu \uparrow \to \Delta x \downarrow$,增大阻尼减小步长,拒绝本次迭代。
- ② 如果 $\Delta x \to F(x) \downarrow$,则 $\mu \downarrow \to \Delta x \uparrow$ 减小阻尼增大步长。加快收敛,减少迭代次数。

定量分析,阻尼因子更新策略通过比例因子来确定的:

$$\rho = \frac{F(\mathbf{x}) - F(\mathbf{x} + \Delta \mathbf{x}_{lm})}{L(\mathbf{0}) - L(\Delta \mathbf{x}_{lm})}$$
(10)

其中:

$$L(\mathbf{0}) - L\left(\Delta \mathbf{x}_{\text{lm}}\right) = -\Delta \mathbf{x}_{\text{lm}}^{\top} \mathbf{J}^{\top} \mathbf{f} - \frac{1}{2} \Delta \mathbf{x}_{\text{lm}}^{\top} \mathbf{J}^{\top} \mathbf{J} \Delta \mathbf{x}_{\text{lm}}$$

$$\mathbf{b} = -\mathbf{J}^{\top} \mathbf{f} - \frac{1}{2} \Delta \mathbf{x}_{\text{lm}}^{\top} \left(-2\mathbf{b} + \left(\mathbf{J}^{\top} \mathbf{J} + \mu \mathbf{I} - \mu \mathbf{I}\right) \Delta \mathbf{x}_{\text{lm}}\right)$$

$$= \frac{1}{2} \Delta \mathbf{x}_{\text{lm}}^{\top} \left(\mu \Delta \mathbf{x}_{\text{lm}} + \mathbf{b}\right)$$
(11)

Marquardt 策略

首先比例因子分母始终大于 0, 如果:

- $\rho < 0$, 则 $F(\mathbf{x}) \uparrow$, 应该 $\mu \uparrow \rightarrow \Delta \mathbf{x} \downarrow$, 增大阻尼减小步长。
- 如果 $\rho > 0$ 且比较大,减小 μ , 让 LM 接近 Gauss-Newton 使得系统更快收敛。
- 反之,如果是比较小的正数,则增大阻尼 µ,缩小迭代步长。

1963 年 Marquardt 提出了一个如下的阻尼策略:

$$\begin{aligned} &\text{if } \rho < 0.25 \\ &\mu := \mu * 2 \\ &\text{elseif } \rho > 0.75 \\ &\mu := \mu/3 \end{aligned} \tag{12}$$

b) 信赖域(Dogleg)法

该方法使用二次型模型来近似任意非线性函数:

Typically a quadratic model function is chosen

$$J\left(\underline{\theta}^{(k)} + \underline{p}\right) = J\left(\underline{\theta}^{(k)}\right) + \left[\frac{dJ(\underline{\theta})}{d\underline{\theta}}\Big|_{\underline{\theta}^{(k)}}\right]^{T} \underline{p} + \frac{1}{2} \underline{p} \underbrace{B^{(k)}}_{\underline{p}^{(k)}}$$

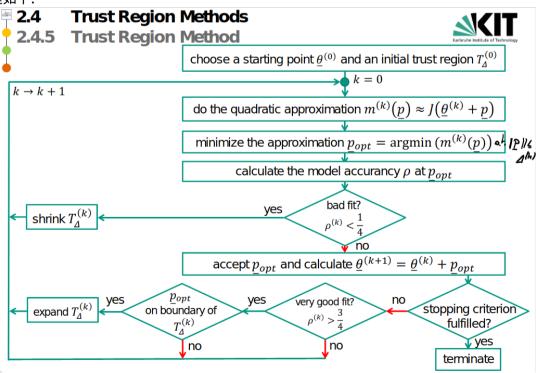
当最优解位于信赖域内时,二次型模型近似该函数较为准确。根据最优解位于信赖域的位置,可以确定 不同的梯度下降方向,来进行迭代求解。





- Trust region (TR) methods calculate furthermore a region of trust T_A around the current iterate. If the next iterate $\underline{\theta}^{(k+1)} = \underline{\theta}^{(k)} + p$ stays inside this trust region \mathcal{T}_{Δ} the model is a good approximation of the original objective function. J. Nocedal: Numerical Optimization, 2. Edition, p. 68
- Probably, the approximation does not hold outside the trust region
- The quality of the approximated model is calculated using $\rho^{(k)} = \frac{J(\theta^{(k)}) J(\theta^{(k)} + p)}{m^{(k)}(0) m^{(k)}(p)}$
 - $ho^{(k)} < 1$ means that the model function falls faster than the original function
 - $\rho^{(k)} = 1$ denotes a perfect fit
 - $\rho^{(k)} > 1$ means that the original function falls faster than the model function

算法流程如下:



Dogleg 法更复杂,但基本思想与 LM 法类似,都是考虑了模型近似程度(比例因子 ρ)对收敛效果的影响。

4. 将第一题改为使用任意一种非线性优化库进行优化(比如 Ceres, Gtsam 或 g2o 等)

可以输入1,2或3,来使用Eigen稀疏求解器,Ceres求解,g2o求解

```
int solver_select = 0;
std::cout << "Which solver would you like to use? enter [1: Eigen, 2: Ceres, 3: g2o]" << std::endl;
std::cin >> solver_select;
```

可以比较三种方法的用时情况,这里统一使用 intel 数据集:

使用 Eigen 的稀疏求解器(使用 SimplicialLDLT 方法):

```
^Cjindong@jindong-ThinkPad-X1-Carbon:~/Lidar_SLAM/Exercise/ch6/HW6/LSSLAMProject
$ rosrun ls_slam ls_slam
Vertexs:729
Edges:3070
initError:2.05092e+06
Which solver would you like to use? enter [1: Eigen, 2: Ceres, 3: q2o]
solver time for one step: 46.000000 ms
Iterations:1
solver time for one step: 51.000000 ms
Iterations:2
solver time for one step: 77.000000 ms
Iterations:3 solver time for one step: 60.000000 ms
Iterations:4
solver time for one step: 56.000000 ms
solver used all time: 292 ms
FinalError:65.402
```

```
Vertexs:729
                            Edges:3070
initError:2.05092e+06
                            Which solver would you like to use? enter [1: Eigen, 2: Ceres, 3: g2o]
                            Solver Summary (v 2.0.0-eigen-(3.3.4)-lapack-suitesparse-(5.1.2)-cxsparse-(3.1.9)-eigensparse-no_openmp)
                                                                     Original
                                                                                                 Reduced
                            Parameter blocks
                                                                                                    2184
2184
                                                                         2187
2187
                            Parameters
Residual blocks
Residuals
                                                                          3070
                                                                                                     3070
                            Minimizer
                                                                TRUST REGION
                            Sparse linear algebra library SUITE_SPARSE
Trust region strategy DOGLEG
                                                                       DOGLEG (TRADITIONAL)
                                                                                                    Used
                            Linear solver
                                               SPARSE_NORMAL_CHOLESKY
                                                                                 SPARSE NORMAL CHOLESKY
                            Threads
Linear solver ordering
                                                                 AUTOMATIC
                                                                                                     2184
                                                                1.025461e+06
                            Initial
                                                                3.270102e+01
1.025429e+06
                            Change
                            Successful steps
Unsuccessful steps
                            Time (in seconds):
                            Preprocessor
                                                                     0.009076
                              Residual only evaluation
Jacobian & residual evaluation
Linear solver
                                                                    0.014557 (5)
0.026165 (4)
                            Minimizer
                            Postprocessor
                                                                    0.000205
                            Total
                                                                    0.062026
                                                                 CONVERGENCE (Gradient tolerance reached. Gradi
                            ent max norm: 2.573441e-04 <= 1.000000e-03)
                            solver used all time: 75 ms
FinalError:65.402
```

使用 g2o (使用稀疏求解方法 LinearSolverCSparse 以及 GaussNewton):

```
^Cjindong@jindong-ThinkPad-X1-Carbon:~/Lidar_SLAM/Exercise/ch6/HW6/LSSLAMProject
rosrun ls_slam ls_slam
Vertexs:729
Edges:3070
initError:2.05092e+06
Which solver would you like to use? enter [1: Eigen, 2: Ceres, 3: g2o]
                  chi2= 365235.618940
                                           time= 0.00998346
                                                                     cumTime= 0.0099
        edges= 3070 schur= 0
on= 1 chi2= 134.648697
iteration= 1
                                           time= 0.00715837
                                                                     cumTime= 0.0171
                  3070 schur= 0
chi2= 65.402453
418
         edges= 3070
iteration= 2
                                                                     cumTime= 0.0255
                                           time= 0.00845398
                                           time= 0.00709108
                                                                     cumTime= 0.0326
```

三种求解器看来,Ceres 和 g2o 较快,两者用时差不多,可能选择不同的求解方法,比如 Dogleg, LM, GaussNewton 等方法两者会表现出细微的差别。

参考文献:

[1] 矩阵求导

https://fei-wang.github.io/matrix.html

[2] Eigen Tutorial- Solving Sparse Linear Systems

http://eigen.tuxfamily.org/dox/group_TopicSparseSystems.html

[3] Eigen 学习与使用笔记 3 - 稀疏矩阵求解

http://zhaoxuhui.top/blog/2019/08/28/eigen-note-3.html