IDF2013
英特尔信息技术峰会

动手实验室：利用英特尔® Parallel Studio XE 2013 将并行性从英特尔® 至强® 处理器扩展至英特尔® 至强融核™ 协处理器

Shuo Li, Staff Application Engineer, Intel
Chao Yu, Technical Consulting Engineer, Intel
Jun Jin, Senior Application Engineer, Intel

SFTL002

英特尔®与你共创明天™ intel®

议程

- 试验简介
- 什么是阶梯优化框架
- 第一步：以优化的工具和程序库作跳板
- 第二步：标量，单线程优化
- 第三步：向量化
- 第四步：并行化
- 第五步：从多核扩展到众核
- 总结

本课程演示文稿（PDF）发布在技术课程目录网站：
intel.com / go / idfsessionsBJ

该网址同时打印于会议指南中专题讲座日程页的上方

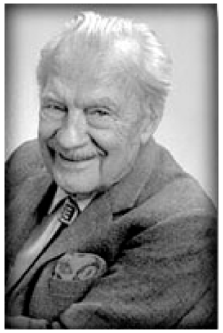
IDF2013
英特尔信息技术峰会

试验简介

欧式期权之蒙地卡罗方法

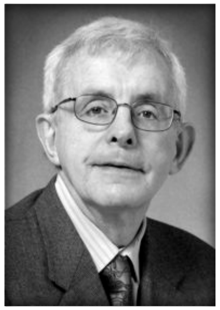
蒙地卡罗方法
从何而来

尼古拉斯 麦托坡里斯发明的
统计计算方法



蒙地卡罗在金融
的应用

费伦博尤 第一个把蒙地卡罗
带入定量金融界



- 简单的算法多次重复
- 利用中心极限定律

1. Sample a random path for S in a risk neutral world
2. Calculate the payoff from the derivative
3. Repeat steps 1 and 2 to get many sample values of the payoff from the derivative in a risk-neutral world
4. Calculate the mean of the sample payoff
5. Discount expected payoff at risk-free rate to get an estimate of the value of the option

IDF2013
英特尔信息技术峰会

最初的实现

- Use GCC 4.4.6
- C/C++ TR1 随机数产生程序
- 程序源文件清单

Driver.cpp

主程序文件

MonteCarlo.h

参数的定义

MonteCarloStep*n*.cpp

蒙地卡罗计算方法

Makefile

程序产生脚本

```
typedef std::tr1::mt19937    ENG;  // Mersenne Twister
typedef std::tr1::normal_distribution<float> DIST;
typedef std::tr1::variate_generator<ENG,DIST> GEN;

ENG  eng;
DIST dist(0,1);
GEN  gen(eng,dist);

for(int opt = 0; opt < OPT_N; opt++)
{
    float VBySqrtT = VOLATILITY * sqrt(T[opt]);
    float MuByT = (RISKFREE - 0.5 * VOLATILITY * VOLATILITY)
* T[opt];
    float Sval = S[opt];
    float Xval = X[opt];
    float val = 0.0, val2 = 0.0;

    for(int pos = 0; pos < RAND_N; pos++)
    {
        float callValue =  max(0.0, Sval *exp(MuByT +
VBySqrtT *  gen()) - Xval);
        val  += callValue;
        val2 += callValue * callValue;
    }

    float exprt = exp(-RISKFREE *T[opt]);
    CallResult[opt] = exprt * val / (float)RAND_N;
    float stdDev = sqrt(((float)RAND_N * val2 - val * val)/
((float)RAND_N * (float)(RAND_N - 1)));
    CallConfidence[opt] = (float)(exprt * 1.96 * stdDev /
sqrtf((float)RAND_N));
}
```

你们的任务：让程序跑得更快更好

- 让程序在Intel® Xeon® processor 跑快， 在Intel® Xeon Phi™ coprocessor上跑得更快

- 充分利用硬件资源
- 软件工具：Intel® Parallel Studio XE 2013 SP1
  – Intel® C/C++ Compiler
  – Intel® VTune™ Amplifier
  – Intel® Advisor XE
  – GDB Debugger
- 软件方法：逐步优化模式

让我们立即开始

IDF2013
英特尔信息技术峰会

什么是阶梯优化框架

阶梯优化框架

- 是一套能让程序员在多核和众核结构上表达程序并行性的方法和工具
- 终极目的：把没有优化的程序变成可扩展的，能在多核和众核上执行的高度并行程序

- 第一步：以优化的工具和程序库作跳板
- 第二步：标量，单线程优化
- 第三步：向量化
- 第四步：并行化
- 第五步：从多核扩展到众核

第一步：以优化的工具和程序库作跳板

用Intel® C/C++ Compiler产生蒙地卡罗欧式期权定价程序

- Intel® Compiler 完全与GCC兼容
- 你们桌上的手提电脑已经装上了Intel® Parallel Studio XE 2013
- 你可以用 icpc –V 来验证
- 运行环境变量脚本

```
. /opt/intel/composerxe/pkg_bin/compilervars.sh intel64
```

- 再发一次make 命令这一次用CXX=icpc 作参数

```
make CXX=icpc
```

- 重新运行一次用Intel® C/C++ Composer XE产生的蒙地卡罗程序

```
./MonteCarlo
```

- 在发出的表格中记录下程序运行的性能

IDF2013
英特尔信息技术峰会

用 Intel® MKL 随机数产生器

- 加入Intel® MKL 头文件 `#include <mkl_vsl.h>`
- 定义一个缓冲区用来接受随机数
  `float random[RANd_N];`
- 定义一个描述随机数系列的数据结构
  `VSLSTREAMSTATEPTR Randomstream`
- 产生一个随机数系列并将其初始化。
  `vslNewStream(&Randomstream, VSL_BRNG_MT19937, RANDSEE)`
- 用缓冲区来接受随机数系列

```
 vsRngGaussian (VSL_METHOD_SGAUSSIAN_ICDF,
Randomstream, RAND_N, random, 0.0, 1.0);
```

- 在链接时加入 －mkl 重新产生和链接和启动
- 在发出的表格中记录下程序运行的性能

第二步：标量，单线程优化

优化程序的核心计算逻辑，减少不必要的重复

- 选定一个算法所要求准确度
  - Intel® Math Kernel Library (Intel® MKL) 准确模式 HA, LA, EP: `vmlSetMode(VML_EP);`
  - 编译器的准确模式: `-fimf_precision=low,`**`medium`**`,high`
- 选定一个浮点数所要求的精度
  - 所有的常数都要给一个C/C++的 Type: `const float NUM = 1.0f`
  - 选用浮点精度一致的函数调用API `exp` for DP, `expf()`for SP
- 减小非正常浮点操作对性能的影响
  - 众核的非正常浮点运算成本更高 `-fp-modal fast=2 -fimf_domain_exclusion=15，31`
- 为编译器产生优化的目标代码提供协助
  - 与常量有关的计算尽量提出循环语句
  - 编译时能确定的变量的计算尽量提前
  - 避免不必要的除法。除以一个常数能用乘这个数的倒数

IDF2013
英特尔信息技术峰会

第二步：标量，单线程优化

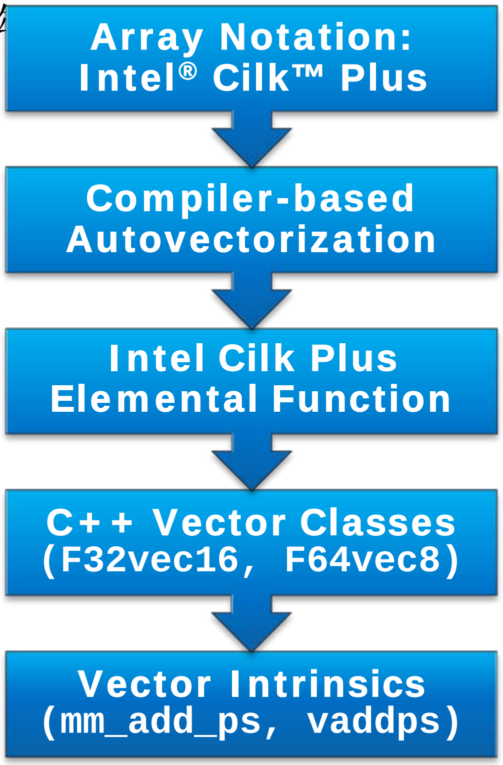
- 察看给出的原程序代码，找出与C/C++语言有关的性能问题
  - 所有的常数要有一个C/C++ 的 Type
  - 明确地给出所有C/C++运行函数的数据类型
  - 把除以一个常数变成乘以这个数的倒数
- 找出你的算法所需要的准确度和浮点运算的精度
  - -fimf-precision=low
  - -no-prec-div
  - -no-prec-sqrt
- 排除与你的算法无关的浮点运算定义域
  - -fimf-domain-exclusion=31
- 其他的设置
  - -fp-model fast=2

第三步：　向量化

IDF2013
英特尔信息技术峰会

充分利用单指令多数据(SIMD)计算单元与向量处理单元（VPU）

- 单指令多数据并行计算需要数据对齐
  - 将数据从结构式数组的存放格式（ AOS）转化为数组式的结构的存放格式（SOA）
  - 声明对齐的内存数据`__attribute__((aligned(64)) float a;`
  - 动态分配对齐的内存数据： `_mm_malloc(size, align)`
  - 使用TBB: `scalable_aligned_malloc(size, align)`
- 程序的分支会阻碍 SIMD指令执行
  - 一些条件分支语句可以用处理器的mask 指令改写
  - 函数调用可能会妨碍SIMD执行
- 首先尝试让编译器进行自动向量化
  - 提供编译器有关数据对齐，数据依赖，以及指针关联等信息
- 计算VPU 的使用率
  - VPU_ELEMENTS_ACTIVE/VPU_INSTRUCTION_EXECUTED
  - 双精度数据使用率<8 或 单精度数据使用率<16 时，调查原因


Array Notation: Intel® Cilk™ Plus
Compiler-based Autovectorization
Intel Cilk Plus Elemental Function
C++ Vector Classes (F32vec16, F64vec8)
Vector Intrinsics (mm_add_ps, vaddps)

IDF2013
英特尔信息技术峰会

提供编译器向量化的帮助信息

编译指示（pragma)	语法(Semantics)
#pragma ivdep	编译器忽略不能确定的数据依赖。
#pragma vector always [assert]	循环能够向量化时，编译器忽略量化开销分析，总进行向量化。循环不能向量化时， 编译器通过"assert" 语句提供错误信息。
#pragma novector	提示编译器，即使在符合向量化条件下，也不进行循环向量化. 有时，向量化可能会带来性能开销， 我们无需编译器进行向量化。
#pragma vector aligned / unaligned	向量化时， 提示编译器使用对齐内存的操作指令（或不对齐内存的操作指令）。
#pragma vector temporal / nontemporal	在IA32与Intel 64的架构上， 指示编译器使用 temporal/non-temporal 内存存取指令。 多个变量时，使用逗号进行分隔。

IDF2013
英特尔信息技术峰会

使用simd 指示字强制循环向量化 – #pragma simd

- 语法：#pragma simd [<clause-list>]
  - 强制一个循环向量化的语法
  - 程序员：需判断一个循环是否应该被向量化
  - 编译器：强制将循环向量化或者给出错误信息

字句（Clause）	语义（Semantics）
none	强制将最内层循环进行向量化， 忽略数据间的依赖性。
vectorlength *(n_1[, n_2]…)*	指示向量化时， 向量长度(2， 4， 8， 16)。 编译器编译时，从中选择。
private *(var_1, var_2, …, var_N)*	每次循环的私有标量。 多个循环同时执行时，各循环获得相同初始值。 变量的最终结果为最后执行循环的该变量值。
linear *(var_1:$step_1$, …, var_N:$step_N$)*	声明变量的步长。 步长值为正数，且为向量长度的整数倍。
reduction *(operator:var_1, var_2,…, var_N)*	声明reduction 变量。 变量在循环结束时， 通过相应的reduction 操作累计最后的结果。
*[no]*assert	向量化失败时，编译器通过assert 语句给出(或不给出)提示。缺省为编译器给出向量化失败的提示。

英特尔信息技术峰会

向量化蒙地卡罗欧式期权代码

- 找出需向量化的循环 - 其为最内层循环
- 改写动态内存分配， 使用对齐的内存分配语句
  - Driver.cpp `malloc(int size) -> _mm_malloc(size, align)`
  - Driver.cpp `free() -> _mm_free()`
- 将max 宏改为inline 代码
  - `float callValue=max(0.0,Sval*expf(MuByT+VBySqrtT*random[pos])-Xval);`

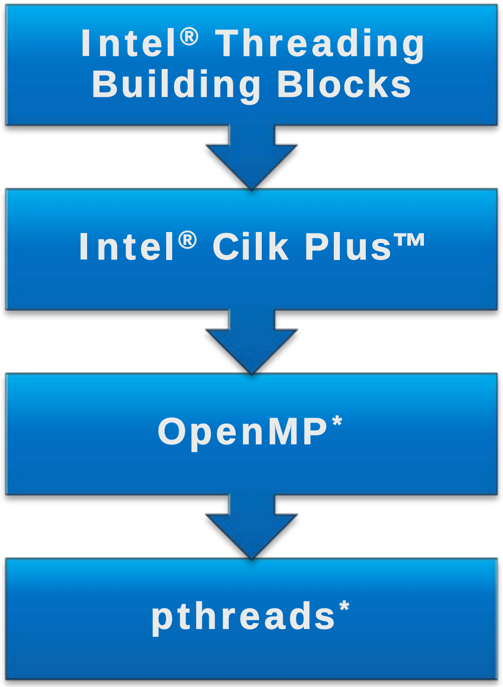
    改为：
  - `float callValue=Sval*expf(MuByT+VBySqrtT*random[pos])-Xval;`
  - `callValue = (callValue > 0) ? callValue : 0`
- 增加向量化指示语句
  - `#pragma vector aligned`
  - `#pragma simd reduction(+:val) reduction(+:val2)`
  - `#pragma unroll(4)`
- 改写Makefile
  - 在编译器编译选项行，增加 –xAVX –vec-report6 编译选项

第四步：并行化

IDF2013
英特尔信息技术峰会

充分利用处理器的核与线程

- 在上层代码分配计算工作
  - 使用粗粒度的并行
- 控制好线程创建的开销
- 减少多线程同步的开销
- 注意多线程的负载均衡
  - 考虑任务分配方法：静态还是动态



IDF2013 英特尔信息技术峰会

并行化的方法 – OpenMP*

- C/C++的OpenMP* 语法:

```
#pragma omp construct [clause [clause]…]
```

- 多种并行语法的支持:
  - 并行任务与代码段
  - 并行循环
  - 同步语法
    - 临界区（critical sections）
    - 同步分界（barriers）
  - 原子操作与顺序操作
  - 并行代码中的顺序执行区域

```
#pragma omp parallel sections
{
     #pragma omp section
     {
          BinomialTemplate<F32vec8, float>(callResult, S,
                                        X, T, R, V, N, NUM_STEPS);
     }
     #pragma omp section
#pragma offload  target(mic:0) in(S, X, T:length(N))
                 out(MICExpected, MICConfidence:length(N))
     {
          montecarlo(S, X, T, MICExpected, MICConfidence);
     }
}
```

- 支持offloading 程序的扩展语法 – OpenMP 4.0 RC2
  - 使用英特尔 Offload 的扩展语法 (Language Extensions for Offload)

```
#pragma omp target or #pragma offload
```

两种语法都可以，没有性能区别。

并行化的方法 – 共有任务的 OpenMP*例子

串行代码

```
for (i = 0; i < N; i++) a[i] = a[i] + b[i];
```

使用OpenMP* parallel region 的例子

```
#pragma omp parallel
{
   int id, i, Nthrds, istart, iend;

   id = omp_get_thread_num();
   Nthrds = omp_get_num_threads();
   istart = id * N / Nthrds;
   iend = (id + 1) * N / Nthrds;

   for (i = istart; i < iend; i++)
      a[i] = a[i] + b[i];
}
```

使用 OpenMP* Worksharing construct 的例子

```
#pragma omp parallel
#pragma omp for
   for (i = 0; i < N; i++) a[i] = a[i] + b[i];
```

IDF2013 英特尔信息技术峰会

第四步：并行化

- 在外层循环，加入

```
#pragma omp parallel for
```

- 在C/C++编译器选项中，添加 –openmp
- 重新运行程序

```
./MonteCarlo
```

- 设置环境变量，重新运行程序

```
export KMP_AFFINITY=“compact,granularity=fine”
```

IDF2013
英特尔信息技术峰会

第五步：　从多核扩展到众核

把向量化的、并行的代码扩展到更多线程

- 目标平台上特定的优化手段
  - 利用EMU中的性能卓越的超然函数
- 线程绑定
  - 生成数目是党的工作线程
  - 选择想要的线程邦定类型
- 数据切块（Data Blocking）
  - 提升内存访问效率
  - 缓解内存带宽的压力
  - 强化数据的多次使用
- 其他优化手段
  - 改善数据局部性
  - 尽可能减少内存访问

安装Intel® Xeon Phi™协处理器的平台

- 采用Intel® Xeon Phi™ 的Intel® Xeon® E5 2670 平台
- 确认能够调用Intel® C/C++ 编译器
  - icpc -V
- 编译 Intel Xeon Phi协处理器上的Native代码
  - 只需要功过修改Makefile （把-xAVX替换成 –mmic)

```
source /opt/intel/composerxe/pkg_bin/compilervars.sh intel64
export KMP_AFFINITY=“compact,granularity=fine”
```

IDF2013 英特尔信息技术峰会

第五步：超越函数

- 用EMU中性能卓越的超越函数
- 内层循环调用 expf(MuByT + VBySqrtT * random[pos]);
- 改成调用exp2f 同时通过系数M_LOG2E调整参数
- 结合对MuByT 和VBySqrtT的乘法

```
float VBySqrtT = VLOG2E * sqrtf(T[opt]);
float MuByT = RVVLOG2E * T[opt];
```

第五步：线程绑定

- 包含头文件 #include <omp.h>
- 在代码开始的时候插入下列代码#pragam omp

```
#ifdef _OPENMP
kmp_set_defaults("KMP_AFFINITY=compact,granularity=fine
");
#endif
```

- Makefile中增加选项 –opt-threads-per-core=4

第五步：数据切块

- 一维数据的数据切块.
  - L2: 每核521K, 每线程128K
  - 应用程序可以使用的部分是64KB 16K 单精浮点
  - BLOCKSIZE = 16*1024

```
const int nblocks = RAND_N/BLOCKSIZE;
for(block=0; block<nblocks; ++block){
   vsRngGaussian(VSL_METHOD_SGAUSSIAN_ICDF,
   Randomstream, BLOCKSIZE, random, 0.0f,
   1.0f);

   <<<Existing Code>>

    // Save intermediate result here
    h_CallResult[opt] +=  val;
    h_CallConfidence[opt] +=  val2;
}
```

- 改变内层循环（RAND_N -> BLOCKSIZE）

- 把期权定价数据的计算循环移动到最外层循环

```
#pragma omp parallel for
for(int opt = 0; opt < OPT_N; opt++)
{
   const float val=h_CallResult[opt];
   const float val2=h_CallConfidence[opt];
   const float exprt=exp2f(-RLOG2E*T[opt]);
   h_CallResult[opt]= exprt*val*INV_RAND_N;
   const float  stdDev= sqrtf((F_RAND_N * val2 -
val * val) * STDDEV_DENOM);
   h_CallConfidence[opt]= (float)(exprt * stdDev *
         CONFIDENCE_DENOM);
```

- 在三重循环外面增加初始化循环

```
#pragma omp parallel for
for(int opt = 0; opt < OPT_N; opt++)
{
     h_CallResult[opt]     = 0.0f;
     h_CallConfidence[opt] = 0.0f;
}
```

在Intel® Xeon Phi™上运行程序

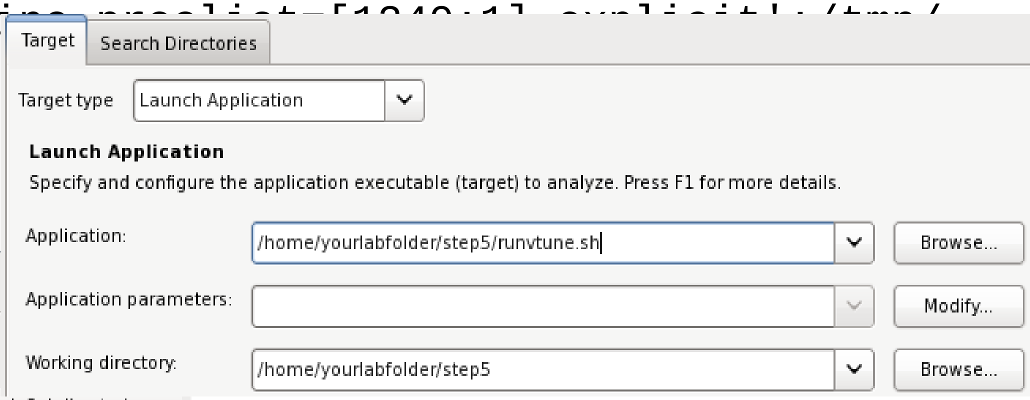
- 在Intel® Xeon Phi™编译Native程序
  - 只需要调整Makefile，把原来的- xAVX改成-mmic
- 把执行程序从Host拷贝到协处理器上
  - 通过命令行拷贝： `scp MonteCarlo mic0:`
  - 登录到协处理器的执行环境 `ssh mic0`
  - 设置环境变量 `%export LD_LIBRARY_PATH=.`
  - 运行程序 `./MonteCarlo`
  - 在表格中记录性能数据

采用Intel® VTune™ Amplifier 性能分析工具的性能调优方法

IDF2013
英特尔信息技术峰会

采用Intel® VTune™ Amplifier XE工具分析Intel® Xeon Phi™协处理器上的Native代码

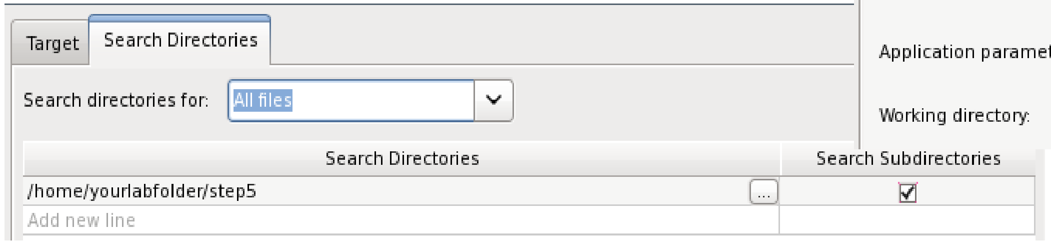
- 命令行启动Intel® Vtune™ Amplifier： amplxe-gui
  - 必须先source /opt/intel/composerxe/vtune_amplifier_XE_2013
- 创建新的项目 File>New>Project
- 指定分析Xeon Phi协处理器上的代码
  - 通过脚本runvtune.sh 启动程序
  - ssh mic0 "export LD_LIBRARY_PATH=/tmp;export OMP_NUM_THREADS=240;export KMP_AFFINITY='granularity=fi
    MonteCarlo“
- 指定搜索目录



Target type: Launch Application

Launch Application
Specify and configure the application executable (target) to analyze. Press F1 for more details.

Application: /home/yourlabfolder/step5/runvtune.sh
Application parameters:
Working directory: /home/yourlabfolder/step5



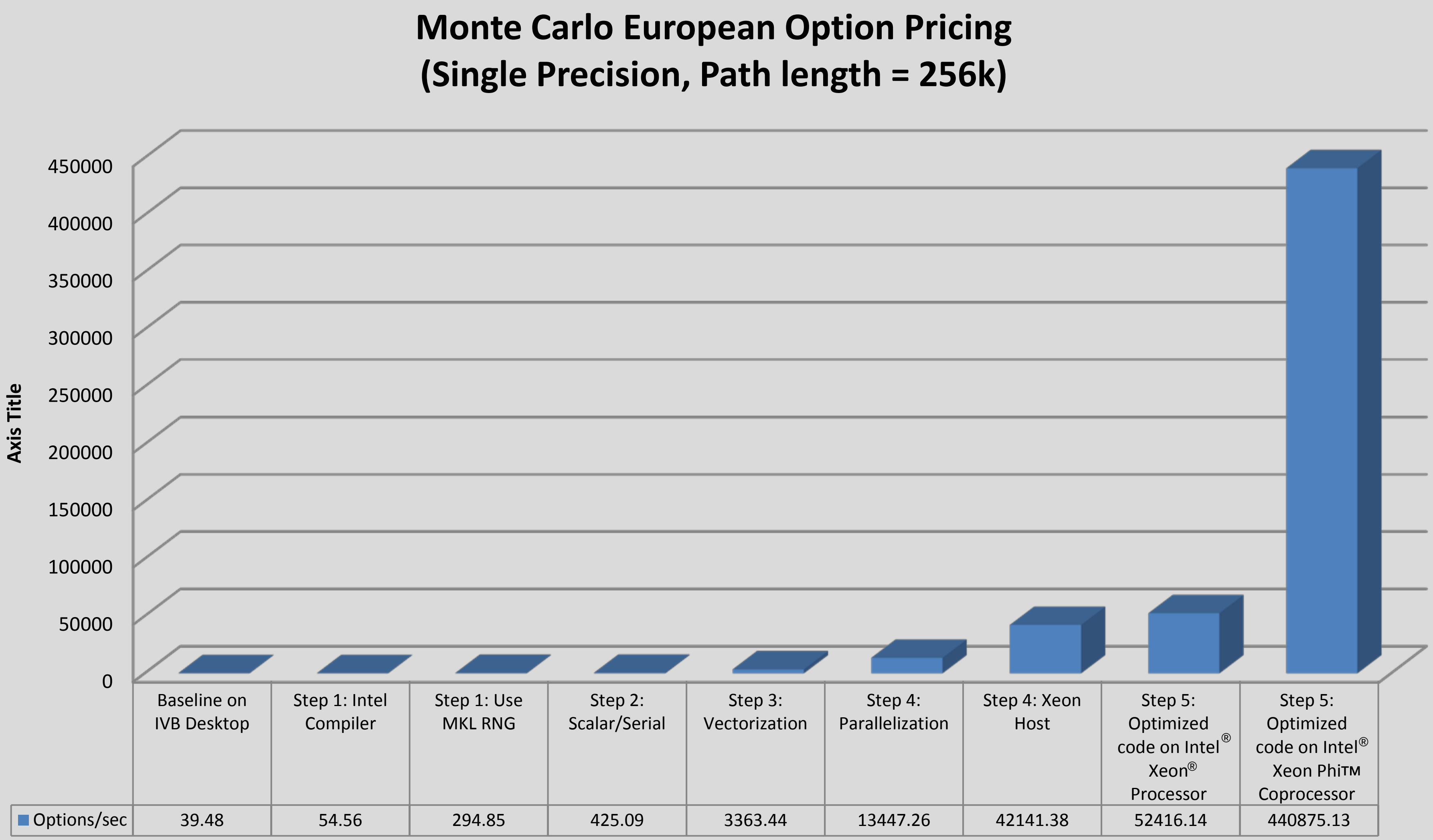
Search directories for: All files

Search Directories	Search Subdirectories
/home/yourlabfolder/step5	✓
Add new line	

IDF2013 英特尔信息技术峰会

总 结

总结



	Baseline on IVB Desktop	Step 1: Intel Compiler	Step 1: Use MKL RNG	Step 2: Scalar/Serial	Step 3: Vectorization	Step 4: Parallelization	Step 4: Xeon Host	Step 5: Optimized code on Intel® Xeon® Processor	Step 5: Optimized code on Intel® Xeon Phi™ Coprocessor
🟦 Options/sec	39.48	54.56	294.85	425.09	3363.44	13447.26	42141.38	52416.14	440875.13

IDF2013
英特尔信息技术峰会

行动与号召

- 采用Intel® Xeon Phi™协处理器运行高度并行的应用程序
- 通过Intel® Parallel Studio XE 2013更好的实现并行性
- 通过阶梯式的优化框架，把并行程序从Intel® Xeon® Processor有效的扩展到Intel® Xeon Phi™协处理器上

Legal Disclaimer

Do not translate

Do not translate

Legal Disclaimer

Pick the ones needed – remove others

Do not translate

Risk Factors

Do not translate

IDF2013
英特尔信息技术峰会