

Projekt 1 – Jacobi- und Gauß-Seidel-Verfahren

Sarah Lutteropp und Johannes Sailer

Lehrstuhl für Rechnerarchitektur und Parallelverarbeitung



Aufgabenstellung

Mathematischer Hintergrund

Parallelisierung

Experimentelle Auswertung

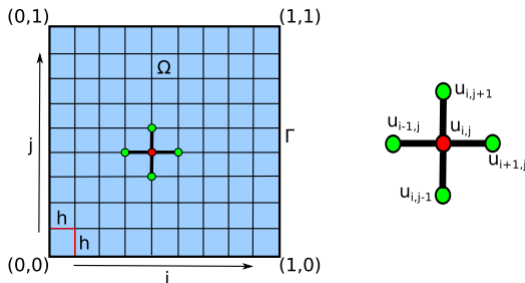
Fazit

Approximation von Stoffkonzentrationen

$$-\Delta u(x, y) = f(x, y) \quad \forall (x, y) \in (0, 1)^2 \quad (1)$$

$$u(x, y) = 0 \quad \forall (x, y) \in [0, 1]^2 \setminus (0, 1)^2 \quad (2)$$

$$\Delta u = \frac{\partial^2 u}{\partial x^2} + \frac{\partial^2 u}{\partial y^2}$$



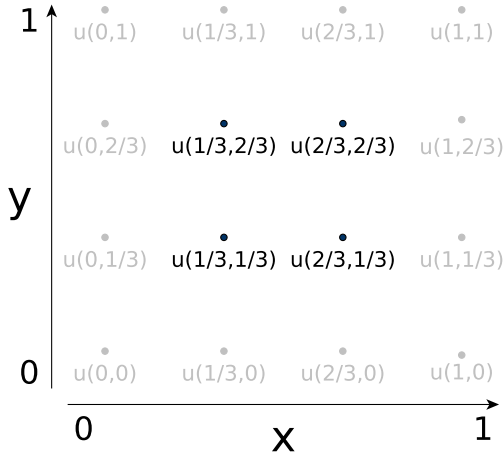
Approximation mit Methode der Finiten Differenzen

$$u_{i,j} = \frac{1}{4} * \left(u_{i,j-1} + u_{i-1,j} + u_{i,j+1} + u_{i+1,j} + h^2 f(x_i, y_j) \right)$$

$$-u_{i,j-1} - u_{i-1,j} + 4u_{i,j} - u_{i,j+1} - u_{i+1,j} = h^2 f(x_i, y_j)$$

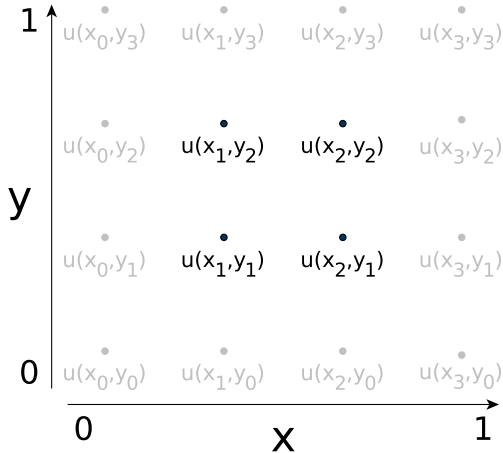
Konkretes Beispiel

Für $h = \frac{1}{3}$



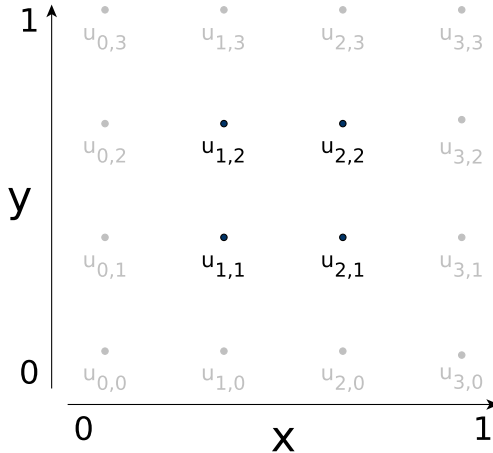
Konkretes Beispiel

Für $h = \frac{1}{3}$

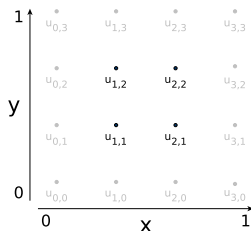


Konkretes Beispiel

Für $h = \frac{1}{3}$



Für $h = \frac{1}{3}$



$$-u_{i,j-1} - u_{i-1,j} + 4u_{i,j} - u_{i,j+1} - u_{i+1,j} = h^2 f(x_i, y_j)$$

$$\begin{pmatrix} 4 & -1 & -1 & 0 \\ -1 & 4 & 0 & -1 \\ -1 & 0 & 4 & -1 \\ 0 & -1 & -1 & 4 \end{pmatrix} * \begin{pmatrix} u_{1,1} \\ u_{1,2} \\ u_{2,1} \\ u_{2,2} \end{pmatrix} = \left(\frac{1}{3}\right)^2 * \begin{pmatrix} f(1/3, 1/3) \\ f(1/3, 2/3) \\ f(2/3, 1/3) \\ f(2/3, 2/3) \end{pmatrix}$$

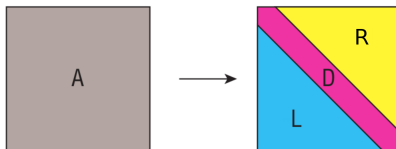
\Rightarrow Löse $Au = b$

Warum nicht einfach gaußen?

Das Gaußsche Eliminationsverfahren ist ...

- anfällig für Rechenfehler
- schlecht parallelisierbar
- langsam für viele Unbekannte
- schlechte Wahl bei dünn besetzter Matrix

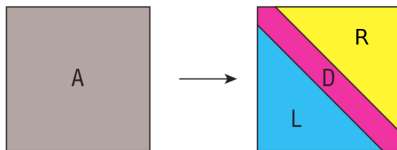
Im Folgenden: **Iterative Verfahren!**



$$Au = b$$

$$\Leftrightarrow (D + L + R)u = b \Leftrightarrow \dots$$

- Jacobi-Verfahren: $u^{(k)} = D^{-1} \left(b - (L + R)u^{(k-1)} \right)$
- Gauß-Seidel-Verfahren: $u^{(k)} = D^{-1} \left(b - Lu^{(k)} - Ru^{(k-1)} \right)$



■ Jacobi-Verfahren:

$$u_i^{(k)} = \frac{1}{a_{ii}} * \left(b_i - \sum_{j \neq i} a_{ij} u_j^{(k-1)} \right) \quad \forall i = 1, \dots, n^2$$

■ Gauß-Seidel-Verfahren:

$$u_i^{(k)} = \frac{1}{a_{ii}} * \left(b_i - \sum_{j=1}^{i-1} a_{ij} u_j^{(k)} - \sum_{j=i+1}^{n^2} a_{ij} * u_j^{(k-1)} \right) \quad \forall i = 1, \dots, n^2$$

Unsere Lösungsmatrix U

Für $h = \frac{1}{3}$

Betrachte statt

$$u = \begin{pmatrix} u_{1,1} \\ u_{1,2} \\ u_{2,1} \\ u_{2,2} \end{pmatrix} \quad U = \begin{array}{|c|c|c|c|} \hline u_{0,0} & u_{1,0} & u_{2,0} & u_{3,0} \\ \hline u_{0,1} & u_{1,1} & u_{2,1} & u_{3,1} \\ \hline u_{0,2} & u_{1,2} & u_{2,2} & u_{3,2} \\ \hline u_{0,3} & u_{1,3} & u_{2,3} & u_{3,3} \\ \hline \end{array}$$

(Die Randeinträge sind hierbei 0)

Vorteil

- Jeder Eintrag in U entspricht einem Punkt im Gitter
- Parallelisierung intuitiver

$$\frac{\sum_{i,j} |u_{i,j}^{(k)} - u_{i,j}^{(k-1)}|}{size * size} \leq TOL$$

Vorteile

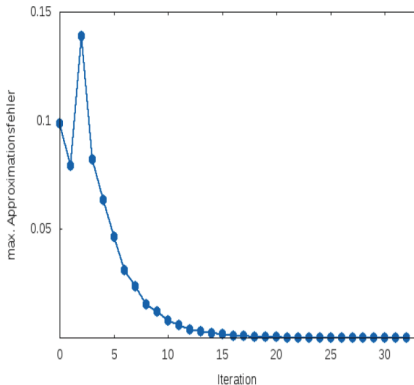
- Sprunglos
- Implementierung mit
`#pragma omp reduce`

Nachteile

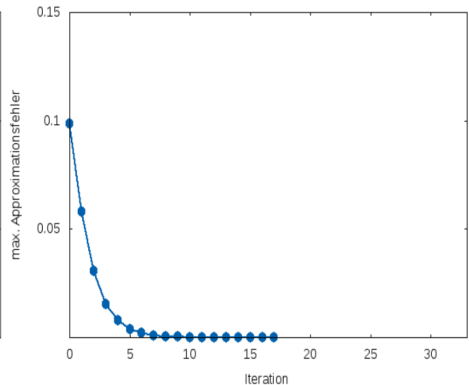
- Maximum der Differenzen
wäre exakter

Beide Verfahren konvergieren.

Jacobi-Verfahren für $h=1/4$



Gauß-Seidel-Verfahren für $h=1/4$



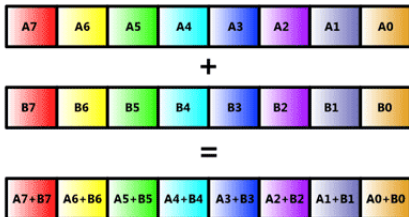
Keine Abhängigkeiten innerhalb einer Iteration

```
#pragma omp parallel for private(j, i) reduction(+:diff) collapse(2)
for (j = 1; j < size - 1; j++)
{
    for (i = 1; i < size - 1; i++)
    {
        a1[CO(i,j)] = a0[CO(i, j - 1)]
                      + a0[CO(i - 1, j)]
                      + a0[CO(i, j + 1)]
                      + a0[CO(i + 1, j)]
                      + functionTable[CO(i, j)];
        a1[CO(i,j)] *= 0.25;

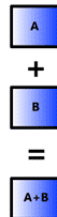
        diff += fabsf(a1[CO(i,j)] - a0[CO(i,j)]);
    }
}
```

Zusätzliche Optimierung: SSE-Vektorinstruktionen

SIMD Mode



Scalar Mode



- Abhängigkeiten innerhalb einer Iteration:

$$u_{i,j}^{(k+1)} = \frac{1}{4} u_{i,j-1}^{(k+1)} + u_{i-1,j}^{(k+1)} + u_{i,j+1}^{(k)} + u_{i+1,j}^{(k)} + h^2 f(x_i, y_j)$$

- 1. Möglichkeit: Wavefront

1	2	3	4
2	3	4	5
3	4	5	6
4	5	6	7

Nachteile Wavefront

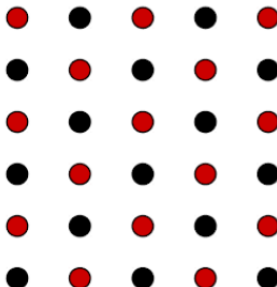
- Schlecht für Cache

0	1	2	3	0			
4	5	6	7	4	1		
8	9	10	11	8	5	2	
12	13	14	15	12	9	6	3
				13	10	7	
				14	11		
				15			

- Aufwändige Berechnung der Indizes
- Geringe Parallelität bei kleinen Diagonalen
- Allgemein großer Overhead

Zweite Möglichkeit: Rot-Schwarz-Iteration

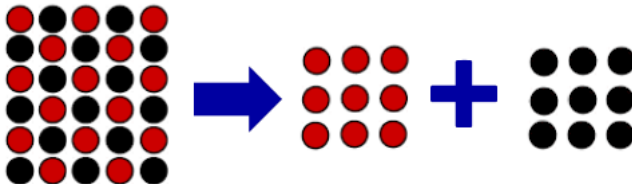
Färben der Matrixeinträge nach folgendem Schema:



1. Berechnen aller roten Einträge
2. Berechnen aller schwarzen Einträge

Optimierung: Rot-Matrix und Schwarz-Matrix separat

- Cache-Effizienz
- Sehr einfache Berechnung der Indizes
- Beschleunigung mit SSE-Vektorinstruktionen



Berechnung der Indizes, *size* ungerade für *size* = 7

$$U =$$

0	3	7	10	14	17	21
0	4	7	11	14	18	21
1	4	8	11	15	18	22
1	5	8	12	15	19	22
2	5	9	12	16	19	23
2	6	9	13	16	20	23
3	6	10	13	17	20	24

$$\begin{array}{lll}
 \leftarrow: idx - \lceil \frac{size}{2} \rceil & \rightarrow: idx + \lfloor \frac{size}{2} \rfloor & \uparrow: idx - 1 \quad \downarrow: idx \\
 \leftarrow: idx - \lfloor \frac{size}{2} \rfloor & \rightarrow: idx + \lceil \frac{size}{2} \rceil & \uparrow: idx \quad \downarrow: idx + 1
 \end{array}$$

Berechnung der Indizes, *size* gerade für *size* = 6

$$U =$$

0	3	6	9	12	15
0	3	6	9	12	15
1	4	7	10	13	16
1	4	7	10	13	16
2	5	8	11	14	17
2	5	8	11	14	17

$$\begin{array}{llll} \leftarrow: idx - \frac{size}{2} & \rightarrow: idx + \frac{size}{2} & \uparrow: idx - (1 - (j \bmod 2)) & \downarrow: idx + (j \bmod 2) \\ \leftarrow: idx - \frac{size}{2} & \rightarrow: idx + \frac{size}{2} & \uparrow: idx - (j \bmod 2) & \downarrow: idx + (1 - (j \bmod 2)) \end{array}$$

Loop-Unrolling vermeidet Modulo-Operation!

Für *size* = 1024 mit 4 Threads

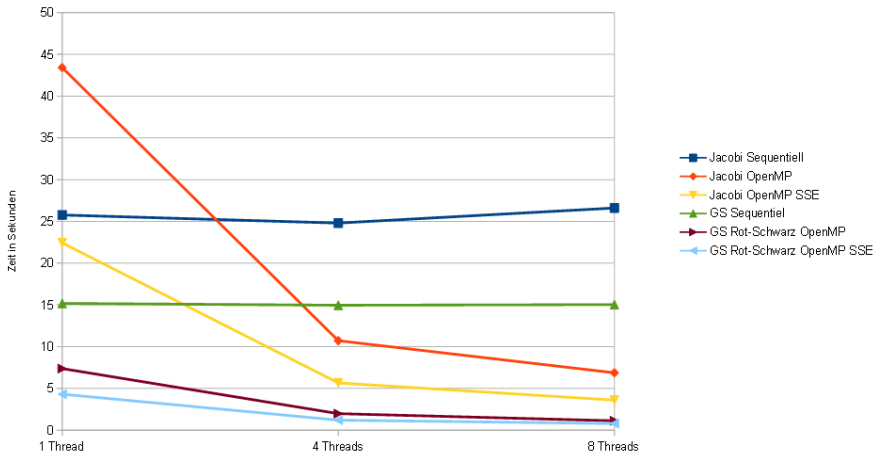
	GCC		ICC	
	Laufzeit	Speedup	Laufzeit	Speedup
Jacobi sequentiell	70,5 s	-	72 s	-
Jacobi	19 s	3,71	125 s	0,58
Jacobi SSE	10,6 s	6,65	9,4 s	7,66
Gauß-Seidel sequentiell	135 s	-	135 s	-
Gauß-Seidel naiv	32,1 s	4,21	125 s	1,08
Gauß-Seidel Rot-Schwarz	16,3 s	8,28	13 s	10,38
Gauß-Seidel Rot-Schwarz SSE	13,4 s	10,07	12 s	11,25
Gauß-Seidel Wave-front	98 s	1,38	116 s	1,16
Gauß-Seidel Wave-front Cache	77 s	1,75	94 s	1,44

Für *size* = 128

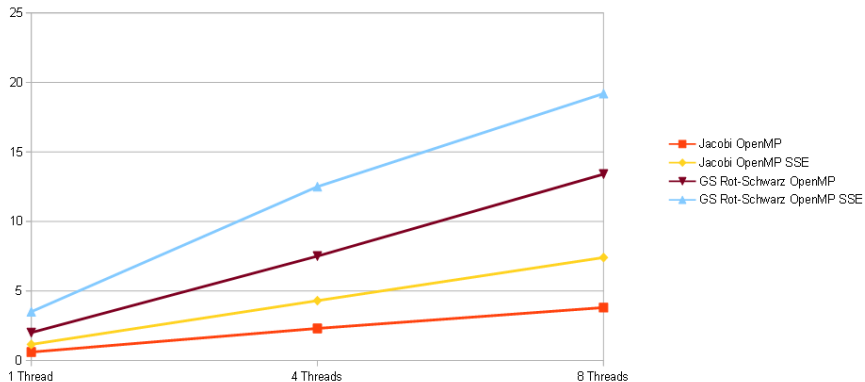
	1 Thread		4 Threads		8 Threads	
	Laufzeit	Speedup	Laufzeit	Speedup	Laufzeit	Speedup
Jacobi sequentiell	2,15 s	-	2,15 s	-	2,15 s	-
Jacobi	4 s	0,538	1,1 s	1,955	0,73 s	2,945
Jacobi SSE	2,15 s	1	0,67 s	3,209	0,550 s	3,909
Gauß-Seidel sequentiell	3,2 s	-	3,2 s	-	3,2 s	-
Gauß-Seidel naiv	3,2 s	1	0,9 s	3,556	3,55 s	5,818
Gauß-Seidel Rot-Schwarz	1,64 s	1,951	0,5 s	6,4	0,41 s	7,805
Gauß-Seidel Rot-Schwarz SSE	1,354 s	2,363	0,44 s	7,273	0,4 s	8
Gauß-Seidel Wave-front	2,6 s	1,231	11,5 s	0,278	22 s	0,145
Gauß-Seidel Wave-front Cache	2,47 s	1,296	12,5 s	0,256	27 s	0,119

Auswertung mit Abbruchkriterium

Laufzeiten für size = 257



Speedup für size = 257



Jacobi-Verfahren für *size* = 257

	1 Thread		4 Threads		8 Threads	
	Laufzeit	Speedup	Laufzeit	Speedup	Laufzeit	Speedup
Sequentiell	25,765 s	-	24,8 s	-	26,605 s	-
OpenMP	43,427 s	0,593	10,714 s	2,315	6,867 s	3,874
OpenMP + SSE	22,424 s	1,149	5,655 s	4,385	3,593 s	7,405

Gauß-Seidel-Verfahren für *size* = 257

	1 Thread		4 Threads		8 Threads	
	Laufzeit	Speedup	Laufzeit	Speedup	Laufzeit	Speedup
Sequentiell	15,179 s	-	14,963 s	-	15,036 s	-
Rot-Schwarz OpenMP	7,371 s	2,059	1,973 s	7,584	1,118 s	13,449
Rot-Schwarz OpenMP + SSE	4,303 s	3,528	1,196 s	12,511	0,782 s	19,228

- Jacobi leichter zu parallelisieren
- Gauß-Seidel konvergiert doppelt so schnell
- Rot-Schwarz-Iteration liefert den besten Speedup
- Vektorisierung lohnt sich