

NUOPT/SIMPLE 外部接続マニュアル
Windows 版, UNIX/Linux 版

株式会社 数理システム

Phone: 03-3358-1701

Fax: 03-3358-1727

Email: nuopt-support@msi.co.jp

2011/11/1

目次

| | |
|---|-----------|
| 1. はじめに | 4 |
| 1.1 サポートプラットフォーム | 7 |
| 1.2 実行環境に含まれるもの | 7 |
| 1.3 サンプルディレクトリの内容 | 9 |
| 2. 実行形式を作成して別プロセスで起動する例 | 10 |
| 2.1 実行形式の作成 | 10 |
| 2.2 外部プログラムの例 | 13 |
| 3. ライブラリ solveLP, solveQP | 18 |
| 3.1 呼び出し形式 | 20 |
| 3.2 ルーチン仕様 | 22 |
| 3.2.1 問題全体にかかわるもの (solveLP, solveQP 共通) | 22 |
| 3.2.2 線形部分にかかわるもの (solveLP, solveQP 共通) | 23 |
| 3.2.3 混合整数計画問題にかかわるもの (solveLP, solveQP 共通：一括省略可) | 24 |
| 3.2.4 目的関数の二次の部分にかかわるもの (solveQP のみ) | 25 |
| 3.2.5 制約式の二次の部分にかかわるもの (solveQP のみ，一括省略可) | 26 |
| 3.2.6 出力とエラーメッセージ | 27 |
| 3.3 実行サンプル | 29 |
| 3.4 実行例 | 34 |
| 4. SIMPLE モデルとドライバを分離しない例 | 42 |
| 4.1 VC++版ライブラリ (SIMPLE モデルとドライバを分離しない例) | 44 |
| 4.1.1 モデル兼ドライバの記述 VC++ | 44 |
| 4.1.2 モデル兼ドライバのコール VC++ | 47 |
| 4.2 UNIX 版ライブラリ (SIMPLE モデルとドライバを分離しない例) | 50 |
| 4.2.1 モデル兼ドライバの記述 UNIX | 50 |
| 4.2.2 モデル兼ドライバのコール UNIX | 52 |
| 4.2.3 実行形式の作成と最適化の実行 UNIX | 55 |
| 5. SIMPLE モデル記述からクラスを生成して利用する例 | 57 |
| 5.1 VC++版ライブラリ (SIMPLE モデル記述からクラスを生成して利用する例) | 59 |
| 5.1.1 モデル VC++ | 59 |
| 5.1.2 genClass のコール VC++ | 59 |
| 5.1.3 ドライバ VC++ | 62 |
| 5.1.4 C++関数からの呼び出し VC++ | 65 |

| | |
|---|------------|
| 5.1.5 VisualBasic からの呼び出し VC++ | 67 |
| 5.1.6 GUI でドライバ (コントロールルーチン) や WINAPI を利用する VC++ | 71 |
| 5.2 UNIX 版ライブラリ (SIMPLE モデル記述からクラスを生成して利用する例) | 73 |
| 5.2.1 手順の概要 UNIX | 73 |
| 5.2.2 二次計画問題の例 UNIX | 75 |
| 5.2.3 ナップサック問題のモデル (C++の配列からのデータ設定) UNIX | 82 |
| 5.2.4 初期設定と main 関数 UNIX | 84 |
| 5.2.5 実行形式の作成と最適化の実行 UNIX | 87 |
| 5.2.6 その他の操作 UNIX | 89 |
| 6. 外部接続時に利用される SIMPLE のツール | 93 |
| 6.1 モデルから作成されたオブジェクト (システムオブジェクト) の操作 | 93 |
| 6.2 C/C++の配列の内容の設定 | 96 |
| 6.3 求解 | 98 |
| 6.4 C の配列への書き出し | 99 |
| 6.5 計算結果に関する情報の取得 | 100 |
| 6.6 求解操作と代入 | 100 |
| 6.7 NUOPT オプション | 101 |
| 7. VC++プロジェクトの設定 | 102 |
| 7.1 Microsoft Visual Studio 2010 プロジェクトの設定 | 102 |
| 7.2 Microsoft Visual C++ 6 プロジェクトの設定 | 108 |
| 7.3 Microsoft Visual C++.net プロジェクトの設定 | 110 |
| 7.4 外部 CLAPACK (CBLAS) の使用方法 | 117 |
| 7.5 分枝限定法の並列化の利用 | 120 |
| 索引 | 122 |

1. はじめに

このドキュメントでは、簡単なデモンストレーションを通じて、NUOPT と外部プログラムの連結方法を解説します。Windows 版では VisualC++ の IDE¹ を利用した例を用います (Microsoft Visual C++.net をお使いのユーザは「7.3 節 Microsoft Visual C++.net プロジェクトの設定」と合わせてお読みください)。外部プログラムとの連結方法には大きく分けて、

- (ア) 実行形式を作成して別プロセスで起動する (第2章)
- (イ) ライブラリ `solveLP`, `solveQP` をコールする (第3章)
- (ウ) SIMPLE のモデル記述を手続きの中に記述して利用する (第4章)
- (エ) SIMPLE のモデル記述からクラスを生成して利用する (第5章)

という四つの方法があります。このドキュメントではこれらについて順に解説します。各方法の簡単な説明は、次の通りです。

(ア) の方法は NUOPT を外部プログラムとして別プロセスで起動する方法です。プロセス起動やデータのやり取りにオーバーヘッドがありますが、実装・デバッグは最も容易です。

(ア) 以外の (イ) (ウ) (エ) は、いずれも NUOPT をライブラリとしてリンクし、その機能を利用する方法です。

(イ) は LP, MILP, QP に属する問題を SIMPLE を介さずに専用の関数を使って解く方法です。高速ではありますが、ユーザ側でデータを標準形に変形する必要があります。

(ウ) (エ) はいずれも SIMPLE を介する方法です。(ウ) は (エ) よりは簡便ですが、NUOPT のライブラリがリンクされているプログラム全体で同時に一つの問題しか扱うことができません。(エ) は手順がやや複雑になりますが、複数の問題を一つの外部プログラムで操作することが可能です。ただし、一部の UNIX/Linux 環境では (エ) の方法をサポートしておりません。

NUOPT の Borland C++ 5.5 への対応に関するご案内 **BC++** :

NUOPT V12 より、Borland C++ 5.5 に関しては正式対応いたしておりません。
 なお、NUOPT の対応コンパイラに関する情報につきましては、
http://www.msi.co.jp/nuopt/products/spec_table.html
 をご覧下さい。

¹ Microsoft Visual Studio 2010 に基づいて説明します。

➤ VC++

フォルダ：

(NUOPT のインストール場所) ¥samples¥app
の下に VC++ のソリューションである

nuoptvcapp.sln

があります。なお、デフォルトの NUOPT のインストール場所は 32bit 版 Windows であれば

C:¥Program Files¥Mathematical Systems Inc¥NUOPT
64bit 版 Windows であれば

C:¥Program Files (x86)¥Mathematical Systems Inc¥NUOPT
となっています。

このソリューション内には以下の 4 つのプロジェクトがあります。



これらのプロジェクトが 3 章以降で説明する実行例に対応しています。本マニュアルで例として用いるのは簡単な整数計画問題である次のナップサック問題です。

| | |
|------------|-----------------------------------|
| 変数 | $x_i \in \{0,1\} \quad (i \in S)$ |
| 目的関数 (最大化) | $\sum_{i \in S} c_i x_i,$ |
| 制約条件 | $\sum_{i \in S} a_i x_i \leq b$ |

S の要素数だけ 0-1 変数があり、線形制約が一本、線形の目的関数を最大化するという問題です。この問題を設定するのに必要なデータは、

目的関数の係数 c_i 、制約式の係数 a_i 、制約式の右辺値 b

となります．この問題を解くというアプリケーションを上記の様々な方法で行います．

1.1 サポートプラットフォーム

このマニュアルに記述されている内容は Windows 版, UNIX/Linux 版共通です.

Windows 版で NUOPT のインストール時に 64bit コンパイラを選択した場合は、Win32 プロジェクト設定を 64 ビット プロジェクト構成に変更する必要があります. 変更の方法については、「7.1Microsoft Visual Studio 2010 プロジェクトの設定」を参照してください. また、NUOPT のインストール時に選択したコンパイラと外部接続で利用するコンパイラが異なっていると、正常に動作しません. 必ず同じコンパイラを用いてください.

UNIX/Linux 版について「SIMPLE のモデル記述からクラスを生成して利用する方法」は基本的に以下のプラットフォームにのみ対応しております.

```
Red Hat Linux 8
CentOS 3, 4, 5
Solaris(Sparc) 8, 10
SUSE Linux Enterprise Server 9
```

上記以外でもお使いの UNIX/Linux 版のプラットフォームによっては「SIMPLE のモデル記述からクラスを生成して利用する方法」が利用できる場合もございます. 詳細につきましては NUOPT サポート (nuopt-support@msi.co.jp) までご連絡下さい.

1.2 実行環境に含まれるもの

外部プログラムの連結を行うための実行環境には次が含まれます. 一部環境によって必要なファイルが異なります.

- ◆ インクルードファイル (共通して必要) :

```
userapp/include/*.h          NUOPT のインクルードファイル
```

- ◆ VC++版ライブラリとサンプル (VC++でのリンクにのみ必要) :

```
userapp/lib/libnuopt_M*.lib   NUOPT ライブラリ (VC++版)
SAMPLES/app/                  VC++版用サンプルディレクトリ
```

- ◆ UNIX/Linux 版ライブラリとサンプル (UNIX/Linux 環境でのリンクにのみ必要) :

```
libnuopt/libnuopt.a          NUOPT ライブラリ (UNIX/Linux 版)
userapp/                      UNIX/Linux 版用サンプルディレクトリ
```

このライブラリから生成したロードモジュールは NUOPT がインストールされている環境でのみ動作し、動作条件は NUOPT に準じます.

1.3 サンプルディレクトリの内容

外部ライブラリの利用サンプルディレクトリです。以下がその一覧です。

➤ **VC++**

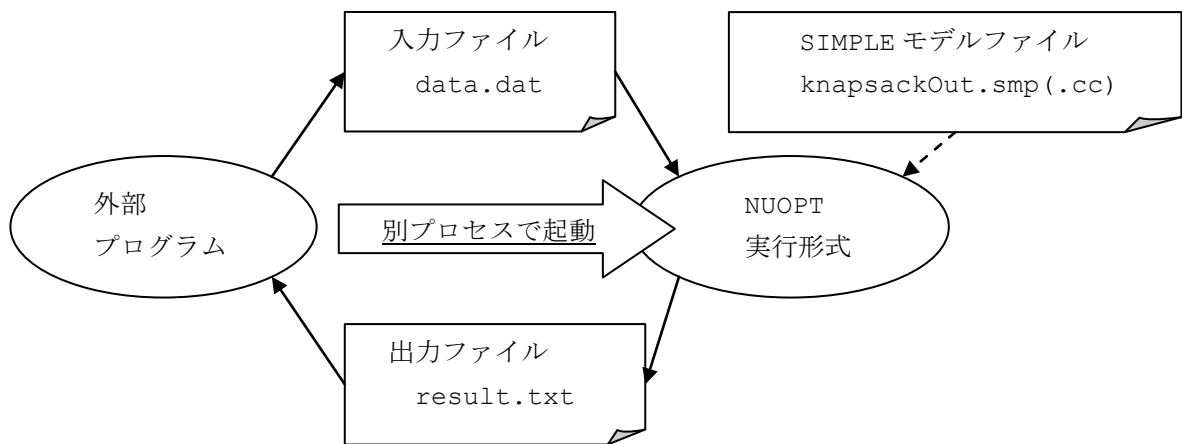
| | |
|-------------------------|------------------------------|
| nuoptvcapp.sln | VC++ のソリューション |
| useSolveQP.cpp | solveLP, solveQP を用いるサンプルメイン |
| useSolveQP/qp312.txt | useSolveQP.cpp 用データ 1 |
| useSolveQP/qp312I.txt | useSolveQP.cpp 用データ 2 |
| useSolveQP/knapsack.txt | useSolveQP.cpp 用データ 3 |
| knapsack.smp | クラスインターフェーステストモデル |
| main.cpp | knapsackSolve のメイン |
| driver.cpp | knapsackSolve のドライバ |
| dllmain.cpp | dll のメイン |
| exeLoopC.c | NUOPT 別プロセス起動用 C 言語ソース |
| exeLoopJ.java | NUOPT 別プロセス起動用 Java ソース |

➤ **UNIX**

| | |
|----------------|--|
| makefile | サンプルの makefile |
| useSolveQP.cc | solveLP, solveQP を用いるサンプルメイン |
| qp312.txt | useSolveQP.cc 用データ 1 |
| knapsack.txt | useSolveQP.cc 用データ 2 |
| useClass.cc | クラスを用いるサンプルメイン |
| QP.smp | クラスインターフェーステストモデル 1 |
| qp312.dat | QP.smp 用データ |
| knapsack.smp | クラスインターフェーステストモデル 2 |
| useSimple.cc | SIMPLE のモデル記述を手続きの中に 直接記述する場合のサンプルメイン |
| MIP.cc | SIMPLE のモデル記述を手続きの中に 直接記述する場合の問題記述の例 |
| knapsackOut.cc | 結果ファイル出力付き knapsack モデル |
| exeLoopC.c | NUOPT 別プロセス起動用 C 言語ソース |
| exeLoopJ.java | NUOPT 別プロセス起動用 Java ソース |

2. 実行形式を作成して別プロセスで起動する例

NUOPT を外部プログラムと連結する方法として、まずは NUOPT 部分を実行形式として作成し、外部プログラムから別プロセスで起動する例を紹介します。データの入出力はファイルを介して行います。この方法は入出力ファイル処理やプロセス起動のオーバーヘッドがありますが、NUOPT と外部プログラムが独立しているので、問題が起こったときに原因の切り分けが容易で、開発しやすいというメリットがあります。特に上記のオーバーヘッドが問題になる場合を除いては、本方法を使用することをお勧めします。



2.1 実行形式の作成

まずは SIMPLE のモデルファイル `knapsackOut.smp (.cc)` から実行形式を作成します。ここでは、

| |
|---|
| 目的関数の係数 : $c = (6 \ 8 \ 4 \ 3 \ 4)$ 制約式の係数 : $a = (4 \ 2 \ 3 \ 6 \ 7)$ |
|---|

という 5 変数のナップサック問題を解きます。以下にコマンドプロンプト上で実行形式を作成する例を示しますが、詳細については NUOPT/SIMPLE マニュアルをご参照下さい。

➤ **VC++**

```
prompt> mknuopt.bat knapsackOut.smp
```

```
knapsackOut.smp
```

```

-----
//
// ナップサック問題
//
Set S;
Element i(set=S);
IntegerVariable x(index=i,type=binary); // 整数変数
Parameter c(index=i);
Parameter a(index=i);
Parameter b;
Objective obj(type=maximize);

obj = sum(c[i]*x[i],i); // 目的関数
sum(a[i]*x[i],i) <= b; // 制約条件

solve(); // 求解

// 結果のファイル出力
FILE* fout = fopen("result.txt","w");
if(fout){
    simple_fprintf(fout, "%f\n", obj);
    simple_fprintf(fout, "%d\n", x[i]);
    fclose(fout);
}else{
    fprintf(stderr, "file open error!\n");
}
-----

```



```
prompt% mknuopt knapsackOut.cc
```

```
knapsackOut.cc
```

```

-----
//
// ナップサック問題

```

```

//
#include "simple.h"

void ufun()
{
    Set S;
    Element i(set=S);
    IntegerVariable x(index=i,type=binary); // 整数変数
    Parameter c(name="c", index=i);
    Parameter a(name="a", index=i);
    Parameter b(name="b");
    Objective obj(type=maximize);

    obj = sum(c[i]*x[i],i); // 目的関数
    sum(a[i]*x[i],i) <= b; // 制約条件

    solve(); // 求解

    // 結果のファイル出力
    FILE* fout = fopen("result.txt","w");
    if(fout){
        simple_fprintf(fout, "%f¥n", obj);
        simple_fprintf(fout, "%d¥n", x[i]);
        fclose(fout);
    }else{
        fprintf(stderr, "file open error!¥n");
    }
}
-----

```

2.2 外部プログラムの例

NUOPT 部分は別プロセスとして起動するので、外部プログラムを実装するプログラミング言語としては別プロセスを起動することができるものであれば何でも構いません。ここでは C 言語と Java を用いた外部プログラムの例 (Windows 版) を示します。

ここでは、モデルの b (制約式の上限) に相当するデータを 1 から 30 まで動かして繰り返し解くという手続きを作成します。

```
exeLoopC.c : 外部プログラム例 (C 言語, Windows 版)
-----
//
// NUOPT 実行形式を別プロセスとして実行する例 (C 言語)
//
#include <stdio.h>
#include <stdlib.h>

void write(int n, double* a, double b, double* c, const char* input);
void read(int n, int* x, double* obj, const char* output);

int main(void)
{
    int i, n = 5;
    double a[] = {4,2,3,6,7};
    double b;
    double c[] = {6,8,4,3,4};
    int x[5];
    double obj[1];
    int ret;
    for(b = 1; b <= 30; b++){
        write(n, a, b, c, "data.dat"); // 入力データの作成
        ret = system("knapsackOut.exe data.dat"); // 別プロセスとして起動
        read(n, x, obj, "result.txt"); // 出力データの読み込み
        printf("ret = %d, b = %f, obj = %f, x =", ret, b, *obj);
        for(i = 0; i < n; i++){
            printf(" %d", x[i]);
        }
        printf("\n");
    }
}
```

```

    }
    return 0;
}

// 入力データの作成関数
void write(int n, double* a, double b, double* c, const char* input)
{
    int i;
    FILE* fp = fopen(input, "w");
    fprintf(fp, "a=%f\n", a[0]);
    for(i = 0; i < n; i++)
        fprintf(fp, "[%d] %f\n", i+1, a[i]);
    fprintf(fp, ";%f = %f;%f=%f\n", b);
    for(i = 0; i < n; i++)
        fprintf(fp, "[%d] %f\n", i+1, c[i]);
    fprintf(fp, ";%f\n");
    fclose(fp);
}

// 出力データの読込関数
void read(int n, int* x, double* obj, const char* output)
{
    int i;
    char buf[256];
    FILE* fp = fopen(output, "r");
    fgets(buf, 256, fp);
    sscanf(buf, "%lf", obj);
    i = 0;
    while(fgets(buf, 256, fp) != NULL){
        sscanf(buf, "%d", x+i);
        i++;
    }
    fclose(fp);
}

-----

```

exeLoopJ.java : 外部プログラム例 (Java, Windows 版)

```

-----
//
// NUOPT 実行形式を別プロセスとして実行する例 (Java)
//
import java.io.*;

class exeLoopJ{
    public static void main(String[] args){
        int n = 5;
        double[] a = {4,2,3,6,7};
        double[] c = {6,8,4,3,4};
        int[] x = new int[n];
        double[] obj = new double[1];
        for(double b = 1; b <= 30; b++){
            int ret = 1;
            try{
                write(n, a, b, c, "data.dat"); // 入力作成
                ret = execute("knapsackOut.exe","data.dat"); // 別プロセス起動
                read(n, x, obj, "result.txt"); // 出力読み込み
            }catch(IOException e){
                e.printStackTrace();
            }
            System.out.print("ret = "+ret+", b = "+b+", obj = "+obj[0]+", x =");
            for(int i = 0; i < n; i++)
                System.out.print(" "+x[i]);
            System.out.print("\n");
        }
    }
    // 入力作成メソッド
    static void write(int n, double[] a, double b, double[] c, String input)
throws IOException{
        FileWriter fw = new FileWriter(input);
        fw.write("a =\n");
        for(int i = 0; i < n; i++)
            fw.write("["+(i+1)+"] "+a[i)+"\n");
    }
}

```

```

        fw.write(";¥nb = "+b+";¥nc =¥n");
        for(int i = 0; i < n; i++)
            fw.write("[ "+(i+1)+" ] "+c[i]+"¥n");
        fw.write(";¥n");
        fw.close();
    }
    // 別プロセス起動メソッド
    static int execute(String exe, String input) throws IOException{
        ProcessBuilder pb = new ProcessBuilder(exe, input);
        Process p = pb.start();
        InputStream is = p.getInputStream();
        while(is.read() > 0);
        try{
            p.waitFor();
        }catch(java.lang.InterruptedException e){
            e.printStackTrace();
        }
        return(p.exitValue());
    }
    // 出力読込メソッド
    static void read(int n, int[] x, double[] obj, String output) throws
IOException{
        FileReader fr = new FileReader(output);
        BufferedReader br = new BufferedReader(fr);
        obj[0] = Float.valueOf(br.readLine());
        for(int i = 0; i < n; i++)
            x[i] = Integer.valueOf(br.readLine());
        br.close();
        fr.close();
    }
}
-----

```

C 言語, Java どちらの例においても write 関数 (メソッド) を定義して, NUOPT への入力データをファイルとして出力しています. NUOPT への入力ファイルのフォーマットについては, NUOPT/SIMPLE マニュアルをご参照下さい.

C 言語の例では `system` 関数を使って, Java の例では `ProcessBuilder` を使った `execute` メソッドを定義して NUOPT 実行形式を別プロセスとして起動しています. この際, `write` 関数 (メソッド) で作った入力データファイル `data.dat` を引数として与えています.

NUOPT 実行形式は求解結果 (`x` と `obj`) を `result.txt` に出力します. C 言語, Java どちらの例においても `read` 関数 (メソッド) を定義して, NUOPT の求解結果を読み込んでいます.

3. ライブラリ `solveLP`, `solveQP`

`solveLP`, `solveQP` はそれぞれ (混合整数) 線形計画問題, (混合整数) 二次計画問題・二次制約付き二次計画問題を対象とする C++ のライブラリです². 問題は次の形式に定式化されているものとして, 変数や制約式の上下限や係数行列を C++ の配列として直接引数として取ります. 入力の際にモデリング言語は使いません.

- ◆ (混合整数) 線形計画問題 (`solveLP` が対応)

$$\text{最小化・最大化} \quad \sum_j c_j \cdot x_j \quad j = 1, \dots, m$$

$$\text{条件} \quad cu_i \geq \sum_j A_{i,j} \cdot x_j \geq cl_i \quad \begin{array}{l} i = 1, \dots, n \\ j = 1, \dots, m \end{array}$$

$$bu_j \geq x_j \geq bl_j \quad j = 1, \dots, m$$

$$(x_j \in \mathbb{Z}) \quad (j \in I)$$

² `solveQP` は混合整数の二次制約付きの問題は扱うことができません.

- ◆ (混合整数) 二次計画問題・二次制約付き問題 (solveQP が対応)

$$\begin{array}{ll} \text{最小化・最大化} & \sum_j c_j \cdot x_j + \frac{1}{2} \sum_{j,k} Q_{j,k} \cdot x_j \cdot x_k \quad \begin{array}{l} j = 1, \dots, m \\ k = 1, \dots, m \end{array} \end{array}$$

$$\begin{array}{ll} \text{条件} & cu_i \geq \sum_j A_{i,j} \cdot x_j + \frac{1}{2} \sum_{j,k} Q_{j,k}^i \cdot x_j \cdot x_k \geq ci \quad \begin{array}{l} i = 1, \dots, n \\ j = 1, \dots, m \end{array} \end{array}$$

$$bu_j \geq x_j \geq bl_j \quad j = 1, \dots, m$$

$$(x_j \in \mathbb{Z}) \quad (j \in I)$$

3.1 呼び出し形式

以下がライブラリ関数 `solveLP`, `solveQP` の呼び出し形式です. “=0”は C++の記法のデフォルト引数 (省略が可能な引数) を示しています. `solveLP` は整数変数が存在しないとき, `ivtype` 以降を, `solveQP` は制約式の二次の部分が存在しないとき, `nQCelem` 以降をそれぞれ一括して省略することができます. 呼び出し形式はヘッダファイル

`nuoIf.h`

に含まれています. このヘッダファイルは NUOPT ライブラリの `include` ファイルの保管場所

(Windows 版) :

(NUOPT のインストール場所) `%userapp%\include`

(UNIX 版) :

(NUOPT のインストール場所) `/userapp/include`

にあります.

◆ `solveLP`

```

nuoptResult*
solveLP
(
    nuoptParam* options
    ,int n,int m
    ,int minimize
    ,double* x0
    ,double* bL,double* bU,int* ibL,int* ibU
    ,double* cL,double* cU,int* icL,int* icU
    ,double* objL
    ,int nAelem,int* irowA,int* jcolA,double* a
    // 以下は整数変数が存在しない場合一括して省略可能
    ,int* ivtype = 0
    ,int* pri = 0
    ,int* dir = 0
    ,int* until = 0
    ,double* upc = 0
    ,double* dpc = 0
);

```

◆ solveQP

```

nuoptResult*
solveQP
(
    nuoptParam* options
    ,int n,int m
    ,int minimize
    ,double* x0
    ,double* bL,double* bU,int* ibL,int* ibU
    ,double* cL,double* cU,int* icL,int* icU
    ,double* objL
    ,int nAelem,int* irowA,int* jcolA,double* a
    ,int nQelem,int* irowQ,int* jcolQ,double* q
    // 以下は制約式の二次の部分が存在しない場合一括して省略可能
    ,int nQCelem = 0,int* ifunQC = 0,int* irowQC = 0,int* jcolQC = 0
    // 以下は整数変数が存在しない場合一括して省略可能
    ,double* qc = 0
    ,int* ivtype = 0
    ,int* pri = 0
    ,int* dir = 0
    ,int* until = 0
    ,double* upc = 0
    ,double* dpc = 0
);

```

solveQP は solveLP の機能を含んでおり, solveQP で二次の項の指定をすべて消去すると, solveLP と同一の機能となります.

3.2 ルーチン仕様

`solveLP`, `solveQP` の引数の意味は共通しています。以降で各引数の解説を行います。

3.2.1 問題全体にかかわるもの (`solveLP`, `solveQP` 共通)

| | |
|----------------------------------|-------------------------------------|
| <code>nuoptParam* options</code> | NUOPT の求解制御パラメータ (0 : デフォルト) |
| <code>int n</code> | 変数の総数 |
| <code>int m</code> | 制約式の総数 (等式, 不等式含む) |
| <code>int minimize</code> | 最小化かどうかのフラグ (零以外 : 最小化, 0 : 最大化) |
| <code>double* x0</code> | 変数の初期値 (長さ : n) |
| <code>double* bL</code> | 変数の下限ベクトル (長さ : n) |
| <code>double* bU</code> | 変数の上限ベクトル (長さ : n) |
| <code>int* ibL</code> | 変数の下限の有無 (長さ : n, 非零 : あり, 0 : なし) |
| <code>int* ibU</code> | 変数の上限の有無 (長さ : n, 非零 : あり, 0 : なし) |
| <code>double* cL</code> | 制約式の下限ベクトル (長さ : m) |
| <code>double* cU</code> | 制約式の上限ベクトル (長さ : m) |
| <code>int* icL</code> | 制約式の下限の有無 (長さ : m, 非零 : あり, 0 : なし) |
| <code>int* icU</code> | 制約式の上限の有無 (長さ : m, 非零 : あり, 0 : なし) |

ここで紹介する引数は `solveLP`, `solveQP` に共通で、同じ意味を持ちます。最初の引数は NUIPT の求解制御パラメータを与えるものですが、0 を渡すことができます。その場合にはパラメータとしてデフォルトの設定を用いるという意味になります。通常はデフォルトで問題ありませんが、パラメータの指定を行う場合には、

```
nuoptParam myparam;
myparam.method = "asqp"; // 求解メソッドの指定
solveQP(&myparam, ...);
```

のようにして、`myparam` のメンバ (個別のパラメータに相当する) に値を設定して、`solveQP` にアドレスを渡します。詳細は「6.7 NUIPT オプション」を参照ください。

変数の上下限が存在しない場合には、対応する `ibL` または `ibU` のコンポーネントを 0 にします。例えば $n = 3$ の場合で

$$0 \leq x_1$$

$$\begin{aligned}x_2 &\leq 1 \\ 2 &\leq x_3 \leq 3\end{aligned}$$

という上下限を表現する場合には次のように設定します。

| 配列の添字 | bL | bU | ibL | ibU |
|-------|----|----|------|------|
| 0 | 0 | 任意 | 0 以外 | 0 |
| 1 | 任意 | 1 | 0 | 0 以外 |
| 2 | 2 | 3 | 0 以外 | 0 以外 |

C++では配列の添字は0はじまりですので、1番目の変数は添字0の場所に対応します。配列の「任意」と書かれた場所は無視されます。「0以外」という場所は0以外の任意の値です。制約式についても全く同様です。

変数の固定、および等式制約は上限と下限を一致させることによって表現します。ibL, ibU, icL, icUの場所にNULLポインタを渡すことが許されています。その場合、すべて0が格納された配列を渡すのと同じ意味になります。

初期値に対応するx0にNULLポインタを渡すことができます。その場合には初期値はデフォルトのものをを用いるという意味になります。

3.2.2 線形部分にかかわるもの (solveLP, solveQP 共通)

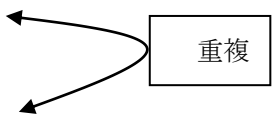
```
double* objL    目的関数の線形部分 (長さ: n)
int      nAelem  制約式の係数行列の非零要素数
int*     irowA   非零要素の行番号 (長さ: nAelem)
int*     jcolA   非零要素の列番号 (長さ: nAelem)
double* a       非零要素の値 (長さ: nAelem)
```

ここで扱う引数も solveLP, solveQP で同じ意味を持ちます。objL は目的関数の線形部分

$$\sum_j c_j \cdot x_j$$

の c_j に対応します。

制約式の係数行列は非零要素のみ与えます。同じ非零要素を二つ以上与えた場合には、それらの和が取られます。非零要素の場所は1始まりの番号で与えます。例えば nAelem=4 のとき、

| 配列の添字 | irowA | jcolA | a | |
|-------|-------|-------|-----|--|
| 0 | 1 | 2 | 2.3 | |
| 1 | 1 | 3 | 1.8 |  |
| 2 | 2 | 1 | 0.5 | |
| 3 | 1 | 3 | 0.2 | |

のように与えると

$$A = \begin{bmatrix} 0 & 2.3 & 2.0 \\ 0.5 & 0 & 0 \end{bmatrix}$$

を与えたことになります (A_{13} については二つ与えられているので和 ($1.8+0.2=2.0$) が取られます). 非零要素の格納順番は任意です.

3.2.3 混合整数計画問題にかかわるもの (solveLP, solveQP 共通: 一括省略可)

```
int*      ivtype 変数の種別
(長さ: n, 0:連続, 1:整数, 2:バイナリ, 3:準連続, 4:部分連続)

int*      pri     変数の分枝優先度
(長さ: n, 0より小さければ無視, 小さい値のものほど優先)

int*      dir     変数の優先される分枝方向
(長さ: n, 正の値:押し上げ, 負の値:押し下げ, 0:指定なし)

int*      until   部分連続変数の境界値 (長さ: n)

double*   upc     変数の押し上げ擬コスト (長さ: n, 負なら無視, 正の値)

double*   dpc     変数の押し下げ擬コスト (長さ: n, 負なら無視, 正の値)
```

ここに挙げた引数で整数変数の指定を行います. ivtype が変数の種別を与えるベクトルで, 次の意味を持ちます.

- 0: 連続変数
- 1: 一般の整数変数
- 2: バイナリ変数 (0 または 1)
- 3: 準連続変数 (0 または 1 以上の実数)
- 4: until で与えられた値を超えるまで整数値をとり, それ以上は実数

ivtype 自体を NULL ポインタにするとすべての変数が連続変数であるという指定と同じ意味となります. until を NULL ポインタにするとすべて 0 を与えたのと同じ意味になります.

pri, upc, dpc, dir はモデリング言語 SIMPLE を用いた場合に IntegerVariable のメンバとして与えられるものと同じで以下の意味を持ちます.

- ◆ `pri` (分枝優先順位) の値は小さいものが先に分枝されることになります。分枝優先順位の与えられている変数と与えられていない変数が混在している場合には、分枝優先順位の与えられていない変数は最低の優先順位が与えられたと見なされます。優先順位として 0 以下の値は与えられても無視し、優先順が与えられないのと同じ扱いとします。
- ◆ `upc, dpc` (擬コスト) の与えられているものと与えられていないものが混在する場合、擬コストが与えられていない変数については擬コストがすべて零であるものとします。どの変数にも擬コストが全く与えられていない場合にのみ、`NUOPT` は擬コストを緩和問題から推定した値に設定します。負の擬コストは無視し、与えられていないのと同じ扱いとします。
- ◆ `dir` (分枝優先方向) は最初に分枝する方向に関してのパラメータで、符号のみが問題になります。正なら押し上げを優先、負なら押し下げを優先、0 なら擬コストからの推定を用いて `NUOPT` がどちらを優先するかを決定します。

`pri, dir, upc, dpc` はすべて `NULL` ポインタとすることができます。その場合にはこれらについて指定をしないのと同じ意味となります。整数変数が存在しない場合には、`ivtype` から以降の引数をすべて省略することができます (一括省略)。

3.2.4 目的関数の二次の部分にかかわるもの (`solveQP` のみ)

```
int      nQelem  目的関数のヘッセ行列の非零要素数
int*     irowQ   目的関数のヘッセ行列の行番号 (長さ: nQelem)
int*     jcolQ   目的関数のヘッセ行列の列番号 (長さ: nQelem)
double*  q       目的関数のヘッセ行列の非零要素の値 (長さ: nQelem)
```

ここに挙げた引数で目的関数の二次の部分の係数行列 (ヘッセ行列)

$$\frac{1}{2} \sum_{j,k} Q_{j,k} \cdot x_j \cdot x_k$$

の $Q_{i,j}$ を与えます。制約式の係数行列と同様に非零要素のみを与えます。指定の仕方は制約式

の係数行列と同様です。非零要素の場所は 1 始まりの番号で与えます。しかし、目的関数のヘッセ行列は対称行列であることを前提としていますので、下三角部分の非零要素を与えると同時に上三角部分も与えたことになる (その逆も同じ) という点に注意してください。

例えば

$$Q = \begin{bmatrix} 1 & 5 \\ 5 & 7 \end{bmatrix}$$

というヘッセ行列を定義するためには `nQelem = 3` として

| 配列の添字 | irowQ | jcolQ | q |
|-------|-------|-------|---|
| 0 | 1 | 1 | 1 |
| 1 | 2 | 1 | 5 |
| 2 | 2 | 2 | 7 |

同時に上三角側も与えたことになる。

のように与えます。

あるいは以下のようにしても同じ意味です。

| 配列の添字 | irowQ | jcolQ | q |
|-------|-------|-------|---|
| 0 | 1 | 1 | 1 |
| 1 | 1 | 2 | 5 |
| 2 | 2 | 2 | 7 |

同時に下三角側も与えたことになる。

同じ非零要素を二つ与えるとその和が取られます。従って nQelem=4 として

| 配列の添字 | irowQ | jcolQ | q |
|-------|-------|-------|---|
| 0 | 1 | 1 | 1 |
| 1 | 1 | 2 | 5 |
| 2 | 2 | 1 | 5 |
| 3 | 2 | 2 | 7 |

二倍にカウントされてしまう。

とすると、上・下三角部分の非零要素を与えると同時に上三角部分も与えたことになるという原則（その逆も同じ）によって

$$Q = \begin{bmatrix} 1 & 10 \\ 10 & 7 \end{bmatrix}$$

を定義したことになりますのでご注意ください。また、非零要素の格納順番は任意です。

nQelem=0 とすると、目的関数に二次の部分が存在しないものと解釈されます。その場合には irowQ, jcolQ, q はすべて NULL ポインタとすることができます。

3.2.5 制約式の二次の部分にかかわるもの (solveQP のみ、一括省略可)

```

int      nQCelem      制約式のヘッセ行列の非零要素数
int*     ifunQC       制約式のヘッセ行列の非零要素が属する制約式番号
                    (長さ: nQCelem)

int*     irowQC       制約式のヘッセ行列の行番号 (長さ: nQCelem)
int*     jcolQC       制約式のヘッセ行列の列番号 (長さ: nQCelem)
double*  qc           制約式のヘッセ行列の非零要素の値 (長さ: nQCelem)
  
```

これらの引数で制約の二次部分

$$\frac{1}{2} \sum_{j,k} Q_{j,k}^i \cdot x_j \cdot x_k \quad (i \text{ は制約式の番号})$$

の係数行列（ヘッセ行列）の群

$$Q_{j,k}^i$$

を与えます。非零要素と、その非零要素が属する制約式の番号のみを与えます。

例えば、制約式 1, 2 の二次の部分がそれぞれ

$$Q^1 = \begin{bmatrix} 4 & 3 \\ 3 & 6 \end{bmatrix}, Q^2 = \begin{bmatrix} 8 & 2 \\ 2 & 3 \end{bmatrix}$$

である場合には $nQCelem = 6$ として

| 配列の添字 | ifunQC | irowQC | jcolQC | qc |
|-------|--------|--------|--------|----|
| 0 | 1 | 1 | 1 | 4 |
| 1 | 1 | 1 | 2 | 3 |
| 2 | 1 | 2 | 2 | 6 |
| 3 | 2 | 1 | 1 | 8 |
| 4 | 2 | 1 | 2 | 2 |
| 5 | 2 | 2 | 2 | 3 |

と設定します。制約式は 1 始まりの番号で指定します。また、行列の非零要素の場所も 1 始まりの番号で指定します。

制約式のヘッセ行列も対称であることを前提としているので、目的関数のヘッセ行列と同じく下三角部分の非零要素を与えると同時に上三角部分も与えたことになる（その逆も同じ）という原則が適用されます。また、目的関数の二次部分のヘッセ行列と同じく、同一の非零要素が二つ以上与えられると和が取られます。

非零要素の格納順番は任意です。

$nQCelem=0$ とすると、制約式に二次の部分が存在しないものと解釈されます。その場合には $ifunQC, irowQC, jcolQC, qc$ はすべて NULL ポインタとすることができます。

制約式の二次の部分が存在しない場合には、 $nQCelem$ から以降の引数をすべて省略することができます。

3.2.6 出力とエラーメッセージ

`solveLP, solveQP` の戻り値として、`nuoptResult` というオブジェクトのポインタが返ります。このオブジェクトのメンバに実行結果についての情報が格納されています。利用可能なメンバは以下の通りです。このメンバの利用の詳細は次項で解説するサンプルコード `useSolveQP.cpp(.cc)` をご覧ください。このオブジェクトは利用するコード内で開放 (`delete`) する必要があります。

| | |
|------------------------------------|-----------|
| <code>int errorCode();</code> | エラーコード |
| <code>char* errorMessage();</code> | エラーメッセージ |
| <code>double optValue();</code> | 最適値 |
| <code>double VarVal(int i);</code> | i 番目の変数の値 |

```
double VarDual(int i);      i 番目の変数の dual 値
double FuncVal(int i);     i 番目の制約の値
double FuncDual(int i);    i 番目の制約の dual 値
```

上記で i は変数, 制約式のインデクスですが, 0 始まりであることにご注意ください (最初の変数/制約式が 0 番目).

エラーコードとエラーメッセージは NUOPT 本体のものと同じです. 「NUOPT/SIMPLE マニュアル」の付録 A をご参照ください. また, `solveLP`, `solveQP` 特有のエラーとして, 引数の矛盾や範囲オーバーがありますが, それは 101 以上のコード番号に対応します. 意味は以下のとおりです.

| コード | 意味 |
|-----|-----------------------------|
| 101 | n が負 |
| 102 | m が負 |
| 103 | 変数の下限 (bL) が上限 (bU) よりも大きい |
| 104 | 制約式の下限 (cL) が上限 (cU) よりも大きい |
| 105 | $nAelem$ が負 |
| 106 | $irowA$ のコンポーネントの範囲が違反 |
| 107 | $jcolA$ のコンポーネントの範囲が違反 |
| 108 | $nQelem$ が負 |
| 109 | $irowQ$ のコンポーネントの範囲が違反 |
| 110 | $jcolQ$ のコンポーネントの範囲が違反 |
| 111 | $nQCelem$ が負 |
| 112 | $ifunQC$ のコンポーネントの範囲が違反 |
| 113 | $irowQC$ のコンポーネントの範囲が違反 |
| 114 | $jcolQC$ のコンポーネントの範囲が違反 |
| 115 | $ivtype$ の範囲が違反 |

エラーメッセージは

```
<<NUOPT 106>> irowA[0] = 9 should be in [1,3]
```

のように, 実際のデータに即したより詳しい情報を含んでいます.

3.3 実行サンプル

開発環境と同梱されているサンプル `useSolveQP.cpp(.cc)` は `solveLP`, `solveQP` を利用するサンプルです。線形計画問題なら, `solveLP` を, 二次計画問題なら, `solveQP` を呼びます。



注意：

以降では, サンプルを用いた実行について書かれています。読み進む前に, まず, お使いのコンパイラを確認してください。もしお使いのコンパイラが VS2008 ならば, そのまま

```
%NUOPT%\samples¥app
```

(%NUOPT% は NUOPT のインストール場所, たとえば C:\Program Files\Mathematical Systems Inc\nuopt)

がサンプルの場所となります。コンパイラが VS2008 でなければ, このディレクトリの中にある

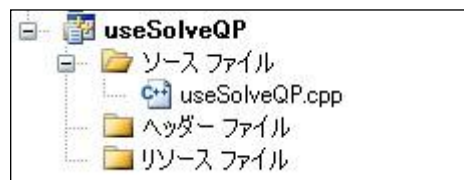
- app_VC6.zip (VC6 用)
- app_NET2003.zip (.NET2003 用)
- app_VS2005.zip (VS2005 用)

のいずれかを, お使いのコンパイラに整合するものを展開してください。コンパイラとプロジェクトが整合していない場合, リンクエラーやコンパイルエラーが生じてしま

ソリューション `nuoptvcapp` のプロジェクト

`useSolveQP`

がこのインタフェースを用いて LP, QP を解くプログラム例です。



`useSolveQP.cpp(.cc)` は `solveLP`, `solveQP` を利用するサンプルで, 1つの `main` 関数のみから成ります。ロードモジュールの引数名で与えられたファイルから問題のデータを読み込み, それを `solveLP`, `solveQP` に渡します。二次の項がなく, 線形計画問題ならば `solveLP` を, あれば `solveQP` を呼びます。以下はそのプログラムの抜粋です。

```

-----
//
// solveQP の利用例
//
#include "nuoIf.h" // 必須.
int main(int argc, char** argv)
{
    int n;
    int m;

    ifstream inputFile(argv[1]); // ロードモジュールの引数をファイル名とする
    inputFile >> n >> m ;

    (中略)

    nuoptResult* qpres = 0;
    nuoptParam myParam;

    if ( nQelem || nQCelem ) { // 2次の係数があるなら solveQP をコール
        qpres = solveQP(&myParam
            ,n,m
            ,minimize
            ,x0
            ,bL,bU,ibL,ibU
            ,cL,cU,icL,icU
            ,objL
            ,nAelem,irowA,jcolA,a
            ,nQelem,irowQ,jcolQ,q
            ,nQCelem,ifunQC,irowQC,jcolQC,qc
            ,ivtype,pri,dir,until,upc,dpc
        );
    } else { // 2次の係数がないのなら solveLP をコール
        qpres = solveLP(&myParam
            ,n,m
            ,minimize
            ,x0
            ,bL,bU,ibL,ibU

```

```

        ,cL,cU,icL,icU
        ,objL
        ,nAelem,irowA,jcolA,a
        ,ivtype,pri,dir,until,upc,dpc
    );
}

if ( qpres->errorCode() ) {
    printf("error in solveQP code = %d, message = %s\n"
        ,qpres->errorCode(),qpres->errorMessage());
    fflush(stdout);
    exit(1);
} else {
    printf("optimalValue = %17.10e\n",qpres->optValue());
    printf("X:\n");
    for ( i = 0 ; i < n ; ++i ) {
        printf("[%3d] %10.3e ",i+1,qpres->VarVal(i));
        if ( (i+1) % 4 == 0 ) {
            printf("\n");
        }
    }
    printf("\n");
    printf("F:\n");
    for ( i = 0 ; i < m ; ++i ) {
        printf("[%3d] %10.3e ",i+1,qpres->FuncVal(i));
        if ( (i+1) % 4 == 0 ) {
            printf("\n");
        }
    }
    printf("\n");
}

delete qpres;
delete [] bL;
delete [] bU;
delete [] ibL;

```

```
delete [] ibU;
```

```
(後略)
```

```
}
```

次のようなナップサック問題を考えます.

変数 $x_i \in \{0,1\} \quad (i \in S)$

目的関数 (最大化) $\sum_{i \in S} c_i x_i,$

制約条件 $\sum_{i \in S} a_i x_i \leq b$

目的関数の係数: $c = (42 \ 12 \ 45 \ 5 \ 2 \ 61 \ 89 \ 32 \ 47 \ 18)$

制約式の係数: $a = (39 \ 13 \ 68 \ 15 \ 10 \ 20 \ 31 \ 15 \ 41 \ 16)$

制約式の右辺: $b = 121$

これを solveLP で解くには, 一般の線形計画問題:

最小化・最大化 $\sum_j c_j \cdot x_j \quad j = 1, \dots, m$

条件 $cu_i \geq \sum_j A_{i,j} \cdot x_j \geq cl_i \quad \begin{matrix} i = 1, \dots, n \\ j = 1, \dots, m \end{matrix}$

$bu_j \geq x_j \geq bl_j \quad j = 1, \dots, m$

$(x_j \in Z \quad j \in I)$

の形にこの問題を表現する, すなわち

$$\begin{aligned}
 c &= (42 \ 12 \ 45 \ 5 \ 2 \ 61 \ 89 \ 32 \ 47 \ 18) \\
 Q &= 0 \\
 cu &= (121) \\
 cl &= (-\infty) \\
 A &= (39 \ 13 \ 68 \ 15 \ 10 \ 20 \ 31 \ 15 \ 41 \ 16) \\
 x_j &\in \{0,1\} \quad (\text{バイナリ変数})
 \end{aligned}$$

とすればよいことがわかります. `useSolveQP.cpp(.cc)` の入力ファイルとしてこのデータを表現したのがファイル

(VC++版) :

(NUOPT のインストール場所) `¥samples¥app¥useSolveQP¥knapsack.txt`

(UNIX 版) :

(NUOPT のインストール場所) `/userapp/knapsack.txt`

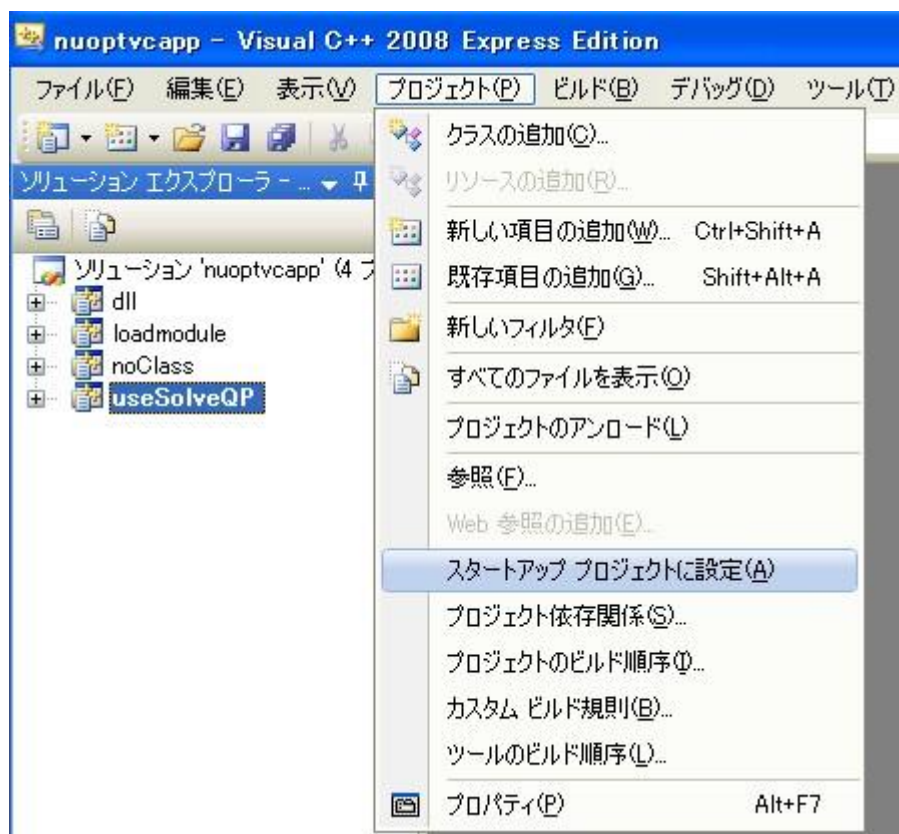
です.

3.4 実行例

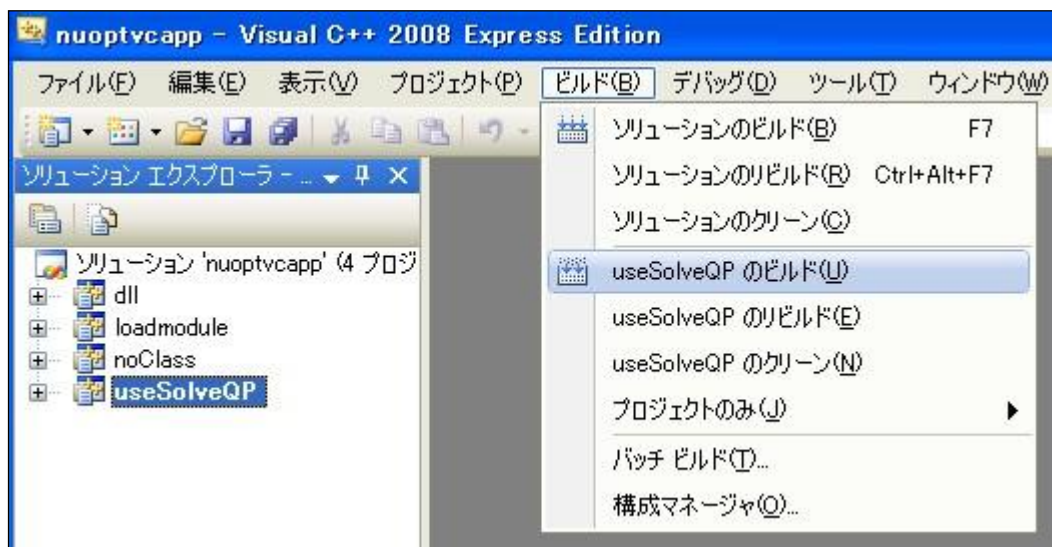
さて、サンプルコード useSolveQP の実行モジュールを作成して実行してみましょう。

➤ VC++

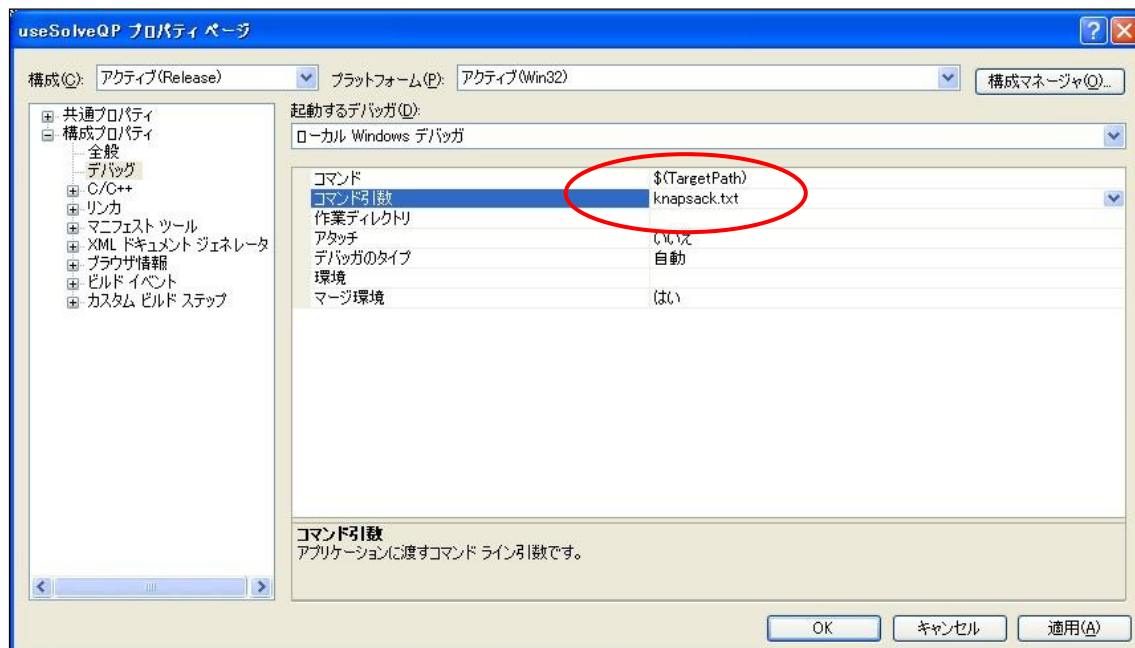
プロジェクト「 useSolveQP 」を選択後、VC++のメニューの「プロジェクト」から「スタートアップ プロジェクトに設定」を選び、プロジェクトを選択します。なお useSolveQP の構成は「Release 」に設定してあります。



続いて実行メニューのビルド：



を実行すると useSolveQP.cpp がコンパイル，NUOPT のライブラリとリンクされて，実行モジュールの useSolveQP.exe が作成されます．引数として knapsack.txt を与えるように「プロジェクト」→「プロパティ」→「構成プロパティ」→「デバッグ」の項目で，「コマンド引数」に「knapsack.txt」と入力します．



つづいて「デバッグ」メニューから



と実行すると、実行経過表示ウィンドウが現れ、その中に以下のような出力が得られます。
solveLP がコールされて出力が成されます。

```

NUOPT x.x.x, Copyright (C) 1991-200x Mathematical Systems Inc.
PROBLEM_NAME                                anon.LP
NUMBER_OF_VARIABLES                         10
NUMBER_OF_FUNCTIONS                         2
PROBLEM_TYPE                                MAXIMIZATION
METHOD                                       SIMPLEX
<preprocess begin>.....<preprocess end>
<iteration begin>
    1.2B
    up:           244.71  lo:           -1e+050          time:
0.0s:mem(Mb)=3/2:avail(Mb)=2029/647
                                llen:2 #prob:4 #piv:9
    #1  up:           244.71  lo:           242          time:
0.0s:mem(Mb)=3/2:avail(Mb)=2029/647
                                llen:2 #prob:5 #piv:10

<iteration end>
STATUS                                     OPTIMAL
VALUE_OF_OBJECTIVE                         242
SIMPLEX_PIVOT_COUNT                         7

```

```

PARTIAL_PROBLEM_COUNT          10
DUAL_SIMPLEX_PIVOT_COUNT       4
ELAPSED_TIME(sec.)             0.00
SOLUTION_FILE                   solver.sol
optimalValue = 2.4200000000e+002
optimalValue = 2.4200000000e+002
X:
[ 1] 1.000e+000 [ 2] 0.000e+000 [ 3] 0.000e+000 [ 4] 0.000e+000
[ 5] 0.000e+000 [ 6] 1.000e+000 [ 7] 1.000e+000 [ 8] 1.000e+000
[ 9] 0.000e+000 [10] 1.000e+000
F:
[ 1] 1.210e+002
Press any key to continue

```

上に挙げた内容は NUOPT からの求解に関する出力です。問題の変数の数 (NUMBER_OF_VARIABLES) や目的関数の値 (VALUE_OF_OBJECTIVE) を知ることができます。NUOPT の標準出力の内容については「NUOPT/SIMPLE マニュアル」(別冊)をご覧ください。

NUOPT の出力を抑制するには、

```
nuoptParam myParam; // 宣言
```

として、パラメータを宣言したのち、

```
myParam.outputMode = "silent";
```

とします。また、デフォルトで出力される NUOPT の求解レポートである解ファイル solver.sol の出力を抑制するには

```
myParam.outfilename = "_NULL_";
```

と設定し、solveQP() の最初の引数として渡します。useSolveQP.cpp(.cc) の以下のコメントを取ると、その設定になり、NUOPT からの出力が抑制されて、useSolveQP が出力する表示のみになります。

```

..
nuoptParam myParam;

```

```
// NUOPT の出力と解ファイルの出力を抑制する.
myParam.outputMode = "silent";
myParam.outfilename = "_NULL_";
if ( nQelem || nQCelem ) { // 2次の係数があるのなら solveQP
    qpres = solveQP(&myParam
                    ,n,m
                    ..

```

再びビルドメニューから



とすると、コンパイルが自動的に実行されます。



```
Prompt% make useSolveQP
```

とすると、useSolveQP.cc がコンパイル、NUOPT のライブラリとリンクされて useSolveQP が作成されます。引数として knapsack.txt を与えてロードモジュールを実行します。

次は、ナップサック問題に対応する knapsack.txt をこの設定で実行したときの出力です。

```
Prompt% ./useSolveQP knapsack.txt
...
optimalValue = 2.4200000000e+002
X:
[ 1] 1.000e+000 [ 2] 0.000e+000 [ 3] 0.000e+000 [ 4] 0.000e+000
[ 5] 0.000e+000 [ 6] 1.000e+000 [ 7] 1.000e+000 [ 8] 1.000e+000
[ 9] 0.000e+000 [10] 1.000e+000
F:
[ 1] 1.210e+002
prompt%
```

➤ Win・UNIX共通

knapsack.txt と同じ場所に別の useSolveQP.cpp(.cc) の入力ファイル

(VC++版) :

(NUOPT のインストール場所) ¥samples¥app¥useSolveQP¥qp312.txt

(UNIX 版) :

(NUOPT のインストール場所) /userapp/qp312.txt

があります。このデータは二次計画問題で

| | | |
|---------|---|--|
| 最小化・最大化 | $\sum_j c_j \cdot x_j + \frac{1}{2} \sum_{(j,k)} Q_{j,k} \cdot x_j \cdot x_k$ | $j = 1, \dots, m$ $k = 1, \dots, m$ |
| 条件 | $cu_i \geq \sum_j A_{i,j} \cdot x_j + \frac{1}{2} \sum_{j,k} Q_{j,k}^i \cdot x_j \cdot x_k \geq ci$ | $i = 1, \dots, n$ $j = 1, \dots, m$ |
| | $bu_j \geq x_j \geq bl_j$ | $j = 1, \dots, m$ |
| | $(x_j \in Z$ | $j \in I)$ |

という定式で、次のように設定したものに对应します。2変数、3制約の問題で、制約式には二次の項はありません。

$$\begin{aligned}
 c &= (-3 \quad 1) \\
 Q &= \begin{pmatrix} 11 & 0 \\ 0 & 22 \end{pmatrix}, Q^i = 0 \\
 cu &= (1000 \quad 1000 \quad 1000) \\
 cl &= (-1 \quad -2 \quad 2) \\
 A &= \begin{pmatrix} -1 & 0.1 \\ -0.2 & -1 \\ 2 & 1 \end{pmatrix} \\
 bu &= (1 \quad 2) \\
 bl &= (0 \quad 0)
 \end{aligned}$$

(VC++版) :

VC++の GUI で「プロジェクト」→「設定」→「デバッグ」タブで, 「プログラムの引数」を
qp312.txt

として再び実行してみてください.

(UNIX 版) :

prompt% ./useSolveQP qp312.txt

とします.

今度は useSolveQP が solveQP をコールして, 次のような解が出力されます.

optimalValue = 2.3181851911e+000

X:

[1] 9.394e-001 [2] 1.212e-001

F:

[1] -9.273e-001 [2] -3.091e-001 [3] 2.000e+000

次のデータ (Windows 版のみ) :

(NUOPT のインストール場所) %samples¥app¥useSolveQP¥qp312I.txt

はこの二次計画問題の変数を連続変数ではなく, 整数変数という指定をつけたもので, 二次の
整数計画問題となります. これを入力として実行すると


```
optimalValue = 2.5000000000e+000
```

```
X:
```

```
[ 1] 1.000e+000 [ 2] 0.000e+000
```

```
F:
```

```
[ 1] -1.000e+000 [ 2] -2.000e-001 [ 3] 2.000e+000
```

のような解が出力されます.

4. SIMPLE モデルとドライバを分離しない例

本章で紹介するのは SIMPLE によって記述したモデルをプログラムの一部として呼び出す方法です。この方法は次章のクラスを生成する方法と比べて簡便ですが NUOPT のライブラリが、リンクされているプログラム全体で同時に一つの問題のみしか定義できないという制限があります。

➤ VC++

注意：

以降では、サンプルを用いた実行について書かれています。読み進む前に、まず、お使いのコンパイラを確認してください。もしお使いのコンパイラが VS2008 ならば、そのまま

```
%NUOPT%¥samples¥app
```

(%NUOPT% は NUOPT のインストール場所，たとえば C:¥Program Files¥ Mathematical Systems Inc¥nuopt)

がサンプルの場所となります。コンパイラが VS2008 でなければ、このディレクトリの中にある

- app_VC6.zip (vc6 用)
- app_NET2003.zip (.NET2003 用)
- app_VS2005.zip (vs2005 用)

のいずれかを、お使いのコンパイラに整合するものを展開してください。コンパイラとプ

ソリューション nuoptvcapp のプロジェクト

noClass

が本方法に対応するプログラム例です。



➤ UNIX版

この例に対応するのが、ファイル

```
(NUOPT のインストール場所) /userapp/useSimple.cc
/MIP.cc
```

です。

VC++版ライブラリをお使いの方は

4.1VC++版ライブラリ (SIMPLE モデルとドライバを分離しない例) へ

UNIX 版ライブラリをお使いの方は

4.2UNIX 版ライブラリ (SIMPLE モデルとドライバを分離しない例) へお進みくださ

4.1 VC++版ライブラリ (SIMPLE モデルとドライバを分離しない例)

4.1.1 モデル兼ドライバの記述 ~~VC++~~

このプロジェクトでは noClass.cpp というソースファイルにモデルとモデルを利用する手続きが両方書き込まれています. noClass.cpp では knapsackSolve という名前の手続きを定義しています. この手続きは入力として, knapsack 問題のモデルの

```
Parameter a(index=i);
```

```
Parameter b;
```

```
Parameter c(index=i);
```

に相当するデータ (aarg,barg,carg) を与えると

```
Variable x(index=i);
```

に相当する変数値 (xarg) と目的関数 (farg) を返します.

```
#include "simple.h"
```

```
//
```

```
// ナップサック問題 (モデルの記述と実行を分離しない)
```

```
//
```

```
int knapsackSolve(int narg,double* aarg,double barg,double* carg
    ,double* xarg,double* farg)
```

```
{
```

```
    //
```

```
    // システムの初期化.
```

```
    //
```

```
    SimpleInitialize();
```

```
    {
```

```
        Set S;
```

```
        Element i(set=S);
```

```
        IntegerVariable x(name="決定ベクトル",index=i,type=binary); // 整数変
```

数

```
        Parameter c(name="価値",index=i);
```

```
        Parameter a(name="重量",index=i);
```

```
        Parameter b(name="許容重量");
```

```
        Objective obj(name="総価値",type=maximize);
```

```

// 引数からデータを設定
a.readD(narg,aarg);
b = barg;
c.readD(narg,carg);

sum(a[i]*x[i],i) <= b;    // 制約条件
obj = sum(c[i]*x[i],i);  // 目的関数

// NUOPT からの最適化結果ファイル.sol の名前の設定
// options.outfilename = "nuoptout";
// .sol のファイル出力を抑制する場合には次のように書く
options.outfilename = "_NULL_";
// 出力を抑制する
options.outputMode = "silent";

// 最適化の実行
solve();

// x の内容を C++ の配列にダンプ

int lenx;
int* indx;
double* valx;
x[i].val.dump(lenx,indx,valx);

if ( lenx != narg) {
    return 99; // x[i] の実際の長さが narg と異なる (データに矛盾あり)
}

// 引数に設定
int it;
for ( it = 0 ; it < lenx ; ++it ) {
    xarg[indx[it]-1] = valx[it];
    // indx[it] は 1,2, ... narg なので, 1 を引く
}

```

```

// 目的関数値の設定
*farg = result.optValue;

// indx, valx は dump 内部で独自に allocate されるので free しておく.
delete [] indx;
delete [] valx;
}
// NUOPT のエラーコードを返す.
return result.errorCode;
}
-----

```

このインタフェースを用いる場合、モデルはプログラム全体で 1 つだけ定義することが可能です。変数、制約式は定義した場所によらずにそのモデルに追加されてゆくことになります。SimpleInitialize() のコールより後と、SimpleClearBuffer() のコールより前は中括弧 { } でくくる必要があります。SIMPLE のオブジェクト (Set や Element) の宣言は、この中括弧 { } の中で行います。SimpleInitialize() をコールせずに SIMPLE のオブジェクトを宣言して利用する、或いはこの中括弧 { } の外で SIMPLE のオブジェクトを宣言すると実行時エラーとなります。

4.1.2 モデル兼ドライバのコール VC++

次は knapsackSolve を C++ で呼び出しているメインルーチンを記述します。ここでは、第 2 章と同様にナップサック問題

目的関数の係数 : $c = (6 \ 8 \ 4 \ 3 \ 4)$
 制約式の係数 : $a = (4 \ 2 \ 3 \ 6 \ 7)$

の容量制約の上限値を 1 から 30 の間で動かすような問題を考えます。このルーチンもプロジェクト noClass に追加されています。

```
#include <stdio.h>
```

```
// main() の中でコールする最適化手続き (最適化ライブラリ)
```

```
int knapsackSolve(int narg, double* aarg, double barg, double* carg,
                  , double* xarg, double* farg);
```

```
void main()
```

```
{
```

```
// 問題のデータ
```

```
int narg = 5;
```

```
double aarg[5] = {4, 2, 3, 6, 7};
```

```
double carg[5] = {6, 8, 4, 3, 4};
```

```
double xarg[5];
```

```
double barg = 20;
```

```
double farg;
```

```
int errCode;
```

```
// barg を変化させながら knapsackSolve を繰り返しコールする
```

```
int ib;
```

```
for ( ib = 1 ; ib <= 30; ++ib ) {
```

```
    barg = (double) ib;
```

```
    errCode = knapsackSolve(narg, aarg, barg, carg, xarg, &farg);
```

```
    printf("errCode=%d b=%g obj=%g ", errCode, barg, farg);
```

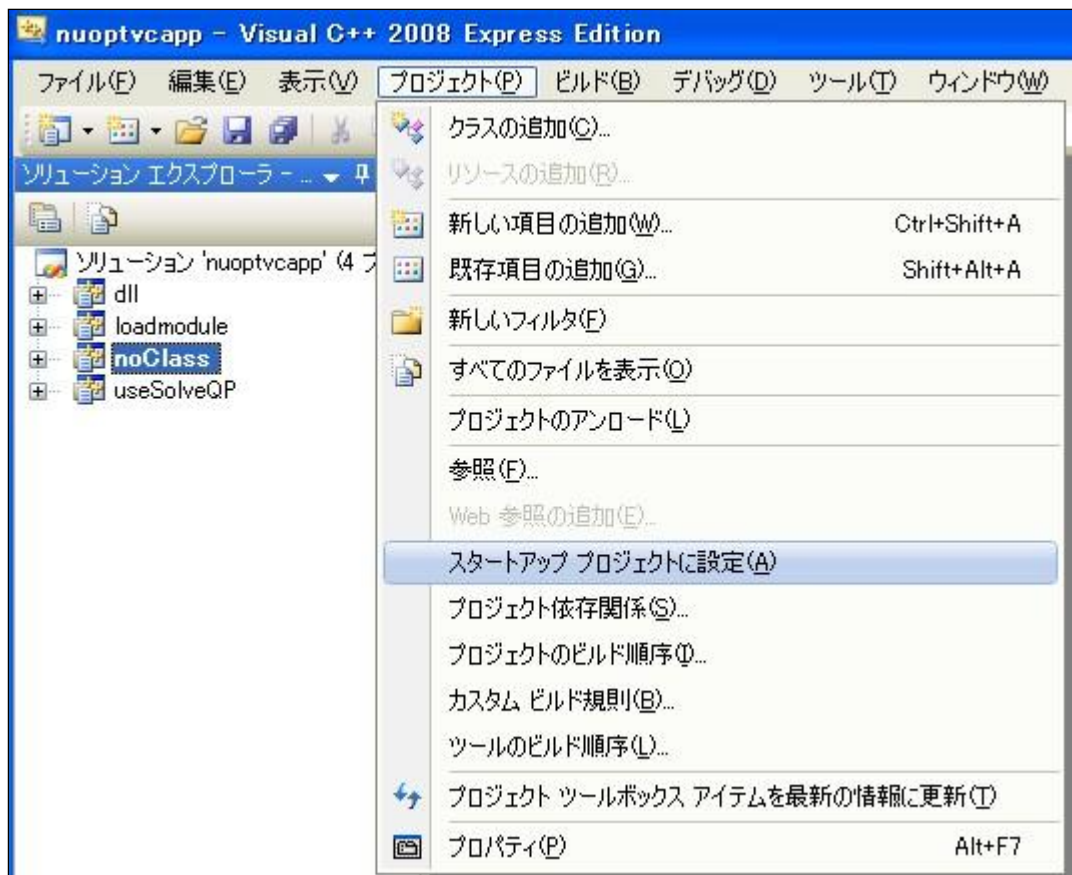
```
    printf(" x= ");
```

```

int i;
for ( i = 0 ; i < narg ; ++i ) {
    printf("%1.0f ",xarg[i]);
}
printf("\n");
}
}

```

これを前項の knapsackSolve () と NUOPT のライブラリとリンクするとロードモジュールが作成できます. VC++のメニューの「プロジェクト」から「スタートアップ プロジェクトに設定」を選び, 次のようにこのプロジェクトを選択します.



つづいて VC++GUI の実行を選択 :



次のような出力が得られます。

```
errCode=0 b=1 obj=0 x= 0 0 0 0 0
errCode=0 b=2 obj=8 x= 0 1 0 0 0
errCode=0 b=3 obj=8 x= 0 1 0 0 0
errCode=0 b=4 obj=8 x= 0 1 0 0 0
errCode=0 b=5 obj=12 x= 0 1 1 0 0
errCode=0 b=6 obj=14 x= 1 1 0 0 0
```

(中略)

```
errCode=0 b=26 obj=25 x= 1 1 1 1 1
errCode=0 b=27 obj=25 x= 1 1 1 1 1
errCode=0 b=28 obj=25 x= 1 1 1 1 1
errCode=0 b=29 obj=25 x= 1 1 1 1 1
errCode=0 b=30 obj=25 x= 1 1 1 1 1
```

Press any key to continue

4.2 UNIX 版ライブラリ (SIMPLE モデルとドライバを分離しない例)

4.2.1 モデル兼ドライバの記述 ~~UNIX~~

次は、SIMPLE の記述を利用して問題を入力、求解、解の出力を行う手続き（サンプルディレクトリ内の MIP.cc）です。

```

-----
#include "simple.h"

//
// ナップサック問題
//
// 引数ならびと関数名は任意

int MIPsolve(int narg,double* aarg,double barg,double* carg
            ,double* xarg,double* farg)
{
    //
    // システムの初期化（これまで定義したシステムをクリア，以降 SIMPLE の記述）
    //
    SimpleInitialize();

    Set S;
    Element i(set=S);

    IntegerVariable x(name="決定ベクトル"
                    ,index=i,type=binary); // 整数変数
    Parameter c(name="価値",index=i);
    Parameter a(name="重量",index=i);
    Parameter b(name="許容重量");
    Objective obj(name="総価値",type=maximize);

    // 引数からデータを設定 (NUOPT/SIMPLE マニュアルを参照)
    a.readD(narg,aarg);
    b = barg;

```

```

c.readD(narg,carg);

0 <= x[i] <= 1;

sum(a[i]*x[i],i) <= b;    // 制約条件
obj = sum(c[i]*x[i],i);   // 目的関数

// NUOPT からの最適化結果ファイル.sol の名前の設定
// options.outfilename = "nuoptout";
// .sol のファイル出力を抑制する場合には次のように書く
options.outfilename = "_NULL_";
// 出力を抑制する
options.outputMode = "silent";

// 最適化の実行
solve();

// x の内容を C++ の配列にダンプ
// (NUOPT/SIMPLE マニュアルを参照)
int lenx;
int* indx;
double* valx;
x[i].val.dump(lenx,indx,valx);

if ( lenx != narg) {
    return 99; // x[i] の実際の長さが narg と異なる (データに矛盾あり)
}

// 引数に設定
int it;
for ( it = 0 ; it < lenx ; ++it ) {
    xarg[indx[it]-1] = valx[it];
    // indx[it] は 1,2, ... narg なので, 1 を引く
}

// 目的関数値の設定

```

```

    *farg = result.optValue;

    // indx, valx は dump 内部で独自に allocate されるので free しておく.
    delete [] indx;
    delete [] valx;

    // NUOPT のエラーコードを返す.
    return result.errorCode;
}
-----

```

この手続き (MIPsolve) は呼ばれるたびに、新しいデータをもとにシステムを作成し直すことを前提としておりますので、手続きが始まるとき定義したモデルの内容をクリアする必要があります。そうするにはここで行っているように最初に SimpleInitialize() をコールします。

4.2.2 モデル兼ドライバのコール *UNIX*

次は SIMPLE の記述を含む手続き MIPsolve をコールするメイン関数です。

```

-----
#include <stdio.h>
#include "simple.h"

// 宣言 (必須)
extern "C" {
    extern void secini();
}

// SIMPLE で書かれた最適化手続き
int MIPsolve(int narg, double* aarg, double barg, double* carg
            , double* xarg, double* farg);

int readData(FILE* fp, char* filename); // データを読む

int main()
{
    //

```

```

// 以下は必須( 初期化 )
//
secini();
SimpleInitialize();

int narg = 5;
double aarg[5] = {4,2,3,6,7};
double carg[5] = {6,8,4,3,4};
double xarg[5];
double barg = 20;
double farg;

int errCode;

//
// barg を変化させながら NUOPT を繰り返しコールする
//
int ib;
for ( ib = 1 ; ib <= 30; ++ib ) {
    barg = (double) ib;
    //
    // システムの定義と求解.
    //
    errCode = MIPSolve(narg,aarg,barg,carg,xarg,&farg);
    printf("errCode=%d b=%g obj=%g ",errCode,barg,farg);
    printf(" x= ");
    int i;
    for ( i = 0 ; i < narg ; ++i ) {
        printf("%1.0f ",xarg[i]);
    }
    printf("\n");
}

//
// SIMPLE が保持している static バッファのクリア

```

```
//
SimpleClearBuffer();

return 0;
}
-----
```

SIMPLE を記述した手続きを呼ぶ場合には、`secini()` と `SimpleInitialize()` を呼ぶ必要があります。ここでは、データファイルを読み込まずに C++ の配列にデータを設定して `MIPsolve` を直接呼んでいます。以下のようにしてデータファイルを読み込んでおくこともできます。

```
char* filename = "c:¥¥temp¥¥data.dat";
FILE* fp = fopen(filename, "r"); // ファイルを開く
readData(fp, filename); // データ
fclose(fp); //
```

こうすると、データの名前と内容がバッファに蓄えられます。蓄えられたデータは SIMPLE オブジェクトで同じ名前 (name) を持つオブジェクトと対応し、宣言時に読み込まれます。

例えばデータファイル内に

```
param = 2;
```

という記述があると、以降

```
Parameter a(name="param");
```

という宣言によって `a` に 2 が代入されます。同じものが複数回現れた場合には、そのすべてにデータの内容が代入されます。例えば、

```
Variable v(name="param");
```

という宣言があれば、`v` にも 2 が代入されます。最後の `SimpleClearBuffer()` は SIMPLE が保持しているスタティックバッファのクリアを行う命令です。このコールを行った後は、コールを行う前に定義したいかなる SIMPLE オブジェクトの内容も参照することはできなくなる代わりに、プロセスの占有メモリ領域を減らすことができます。

4.2.3 実行形式の作成と最適化の実行 *UNIX*

さて、このサンプルコード `useSimple.cc`, `Mip.cc` からロードモジュールを作成して実行してみましょう。

```
prompt% make useSimple
prompt% ./useSimple
```

と打ちます。実行させると、

```
errCode=0 b=1  obj=0  x= 0 0 0 0 0
errCode=0 b=2  obj=8  x= 0 1 0 0 0
errCode=0 b=3  obj=8  x= 0 1 0 0 0
errCode=0 b=4  obj=8  x= 0 1 0 0 0
errCode=0 b=5  obj=12 x= 0 1 1 0 0
errCode=0 b=6  obj=14 x= 1 1 0 0 0
errCode=0 b=7  obj=14 x= 1 1 0 0 0
errCode=0 b=8  obj=14 x= 1 1 0 0 0
errCode=0 b=9  obj=18 x= 1 1 1 0 0
errCode=0 b=10 obj=18 x= 1 1 1 0 0
errCode=0 b=11 obj=18 x= 1 1 1 0 0
errCode=0 b=12 obj=18 x= 1 1 1 0 0
errCode=0 b=13 obj=18 x= 1 1 0 0 1
errCode=0 b=14 obj=18 x= 1 1 1 0 0
errCode=0 b=15 obj=21 x= 1 1 1 1 0
errCode=0 b=16 obj=22 x= 1 1 1 0 1
errCode=0 b=17 obj=22 x= 1 1 1 0 1
errCode=0 b=18 obj=22 x= 1 1 1 0 1
errCode=0 b=19 obj=22 x= 1 1 1 0 1
errCode=0 b=20 obj=22 x= 1 1 1 0 1
errCode=0 b=21 obj=22 x= 1 1 1 0 1
errCode=0 b=22 obj=25 x= 1 1 1 1 1
errCode=0 b=23 obj=25 x= 1 1 1 1 1
errCode=0 b=24 obj=25 x= 1 1 1 1 1
errCode=0 b=25 obj=25 x= 1 1 1 1 1
errCode=0 b=26 obj=25 x= 1 1 1 1 1
errCode=0 b=27 obj=25 x= 1 1 1 1 1
```

```
errCode=0 b=28 obj=25 x= 1 1 1 1 1  
errCode=0 b=29 obj=25 x= 1 1 1 1 1  
errCode=0 b=30 obj=25 x= 1 1 1 1 1
```

という出力が得られます. 各行は異なるデータに対応するナップサック問題の解に対応しています.

5. SIMPLE モデル記述からクラスを生成して利用する例

本章で紹介するのも SIMPLE によって記述したモデルをプログラムの一部として呼び出す方法です³。まず数理計画モデルをモデリング言語 SIMPLE で記述します。次にその記述から数理計画モデルに対応する C++ のクラスを生成します。ユーザプログラムではその C++ のクラスのオブジェクトを宣言することによって

- ◆ データの読み込み
- ◆ 最適化の実行
- ◆ 変数の初期値の設定
- ◆ 最適解や関連する量の表示

などの操作を実現します。クラスオブジェクト同士は独立しているので、複数の問題をひとつの外部プログラムで操作するなどの操作が可能になります。

➤ VC++

ソリューション nuoptvcapp のプロジェクト

loadmodule

がこのインタフェースを用いてナップサックを解くプログラム例です。



➤ UNIX

UNIX 版では、SIMPLE のモデル記述から C++ のクラスを生成して、二次計画問題、ナップサック問題のモデルに対して操作を行う手続き（ドライバ）を作成する例を紹介します。

ファイル

(NUOPT のインストール場所) /userapp/useClass.cc

³ このインタフェースは、「1.1 サポートプラットフォーム」にあるように、一部の UNIX/Linux 版のプラットフォームではサポートされていません。

/QP.smp

/knapsack.smp

がこのインタフェースを用いて二次計画問題，ナップサック問題を解くプログラム例です．

VC++版ライブラリをお使いの方は

5.1VC++版ライブラリ (SIMPLE モデル記述からクラスを生成して利用する例) へ

UNIX 版ライブラリをお使いの方は

5.2UNIX 版ライブラリ (SIMPLE モデル記述からクラスを生成して利用する例) へ

お進みください．

5.1 VC++版ライブラリ (SIMPLE モデル記述からクラスを生成して利用する例)

5.1.1 モデル ~~VC++~~

次に示すプログラムはこのアプリケーションの核心となるモデル記述です。通常のモデルと異なるのは、パラメータの宣言部分に `required` というキーワードがあることですが、これはこの指定のあったデータを C++ の配列から入力することを示しています。その他は通常のモデル記述と同じです。この例ではこのモデルが次のような `knapsack.smp` というファイルに記述されたものとします。

```
//
// ナップサック問題
//

Set S;
Element i(set=S);
IntegerVariable x(index=i,type=binary); // 整数変数
Parameter c(index=i,required);
Parameter a(index=i,required);
Parameter b(required);
Objective obj(type=maximize);
VariableParameter d(index=i);

obj = sum(c[i]*x[i],i); // 目的関数
sum(a[i]*x[i],i) <= b; // 制約条件
```

このファイルは本章で扱っている NUOPT の例を納めたソリューションと同じ場所

(NUOPT のインストール場所) `%samples¥app`

にあります。

5.1.2 genClass のコール ~~VC++~~

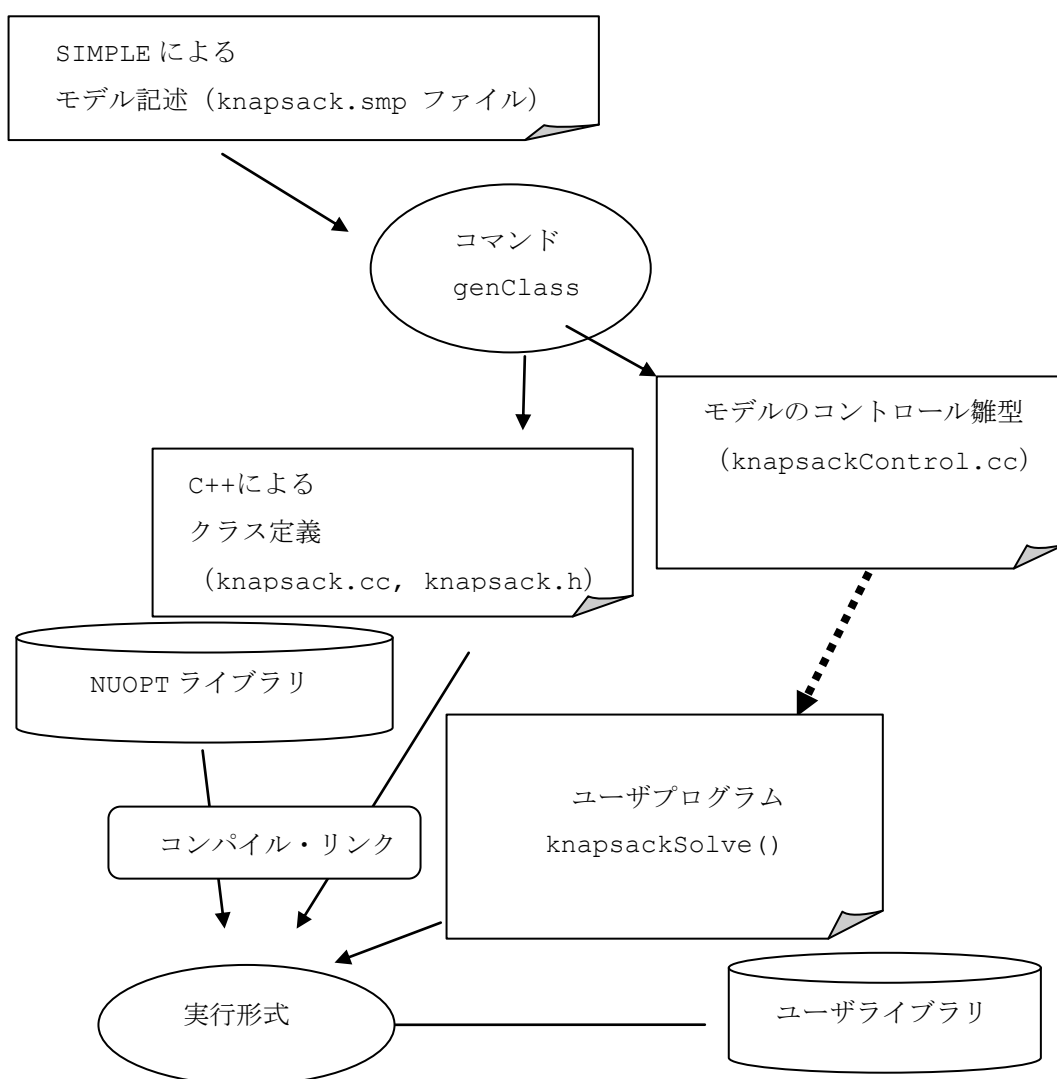
前節のモデルはこのままでは C++ で利用できる形ではありませんが、`genClass` というコマンドを用いて変換すると、対応するクラス宣言 (`knapsack.h`) とクラスの実装 (`knapsack.cc`) が自動生成されます。

次のページに関連するファイルの関係を図示します。ユーザはまず、モデリング言語 SIMPLE を用いてモデル記述を行い、`genClass` によってクラスの実装⁴を自動生成し、ユーザプログラ

⁴ このクラスの実装の内容をユーザは直接意識する必要はありません。

ムからそれを使います。モデルを利用する場合には、こうして生成されたクラス宣言（同 knapsack.h）をインクルードして、クラスオブジェクトを宣言します。このクラスオブジェクトのメンバを通じて、ユーザは自分の C++ プログラム（同 knapsackSolve()）からこのモデルにデータや解を入出力したり（print(), dump()）する操作が可能になります。

実行形式の生成の際には、先ほど自動生成されたクラス実装をコンパイル、リンクします。こうして生成された SIMPLE のクラスは同時に何個でも、また何回でも利用することができます。ただし SIMPLE のクラスを利用するに先立って、ユーザのプログラムから処理前に SimpleInitialize(), 処理後に SimpleClearBuffer() なる関数を呼び出す必要があります（これらは SIMPLE が独自に利用する記憶領域の確保と解放に必要となります）。



genClass の起動は DOS ウィンドウのプロンプトから

```
> genClass knapsack.smp
```

とします. genClass は NUOPT が提供するユーティリティで, この実行のためには別途設定が必要となります. 詳細については NUOPT/SIMPLE マニュアルを参照してください. 以下が knapsack.smp に対する genClass の実行例です.

```
C:\Program Files\Mathematical Systems Inc\NUOPT\SAMPLES
¥app>genClass knapsack.smp
genClass for Windows (Ver. x.x.x), Copyright (C) 200x Mathematical
Systems Inc.
Model description: knapsack.smp
knapsack.cc
knapsack.cc
```

この操作でこの数理計画モデルに対応するクラス定義と実装が genClass を起動したフォルダに作成されます.

| | |
|--------------------|--------------------------|
| knapsack.h | knapsack.smp に対応するクラスの定義 |
| knapsack.cc | 同クラスの実装 |
| knapsackControl.cc | 利用方法サンプル |

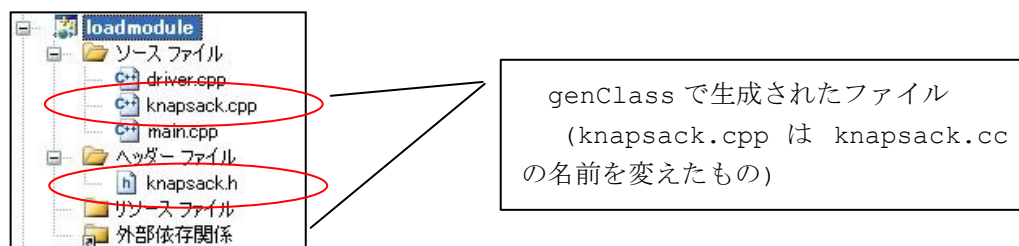
クラスの定義 (knapsack.h) は, この数理計画問題に対して操作を行うコントロール手続き (C++ のコード) の中で操作を行う前に必ずインクルードする必要があります. クラスの実装 (knapsack.cc) の内容は通常ユーザが意識する必要はありませんが, 実行形式を作成する際にユーザのプログラムにコンパイル・リンクする必要があります.

ソリューション nuoptvcapp のプロジェクト

```
loadmodule
```

がこのインタフェースを用いてナップサック問題を解くプログラム例ですが, genClass で生成された実装 (knapsack.cc) とクラスの定義 (knapsack.h) を追加しています.

ここで一点注意があります. 生成された knapsack.cc はプロジェクトに追加する前に knapsack.cpp と拡張子を変更してください. こうすることにより, VC++ の GUI の規約により, このファイルが C++ のコードであると認識されるようになります.



knapsackControl.ccはknapsack.smpで定義したクラスの利用方法のサンプルが記載されています。このコードは一度最適化実行を行うというものです。入力オブジェクトがあるクラスの場合には受け渡し用オブジェクトの宣言が書かれていますので、クラスの利用のコード作成時には参考になります。

```
#include "knapsack.h"

void simpleControl()
{
    Set S;
    Element i( set = S );
    Parameter c( name = "c", index = i );
    Parameter a( name = "a", index = i );
    Parameter b(name = "b");
    System_knapsack s1(c, a, b);
}
```

5.1.3 ドライバ ~~VC++~~

ではこのモデルを解く汎用のC++プログラムを準備しましょう。それはプロジェクトに追加されている

driver.cpp

というファイルで、knapsackSolve という名前の手続きです。このルーチンのインタフェースは入力として、knapsack問題のモデルの

```
Parameter a(index=i);
Parameter b;
Parameter c(index=i);
```

に相当するデータ (aarg, barg, carg) を与えると

```
Variable x(index=i);
```

に相当する変数値 (xarg) と目的関数 (farg) を返すというものです。ドライバのこのインタフェースは問題に特化して調整できるので、より柔軟なコード作成が可能になります。

```

-----
#include "knapsack.h" // インクルード宣言
//
// ナップサック問題の求解
//
//
int knapsackSolve(int narg // 問題のサイズ
    ,double* aarg // 係数 a
    ,double barg // 係数 b
    ,double* carg // 係数 c
    ,double* xarg // 解ベクトル( x )
    ,double* farg // 目的関数
)
{
    // 初期化
    SimpleInitialize();
    { // SimpleInitialize() のコールの後は { を付ける
        // 値転送用のオブジェクト
        Set S;
        Element i(set=S);
        Parameter b;
        Parameter c(index=i),a(index=i);

        // c 配列を初期化用のデータに与える.
        b = barg; // スカラはそのまま代入
        c.readD(narg,carg); // 配列から SIMPLE のオブジェクトへの設定
        a.readD(narg,aarg); // 配列から SIMPLE のオブジェクトへの設定

        //
        // knapsack 問題の求解
        //
        System_knapsack knap(c,a,b);

        int len;
        int* ind;
    }
}

```

```

double* knapx;
knap.x.val.dump(len, ind, knapx);
// knapsack 問題の x を C の配列である knapx に設定

// 解を戻り配列に設定
int it;
for ( it = 0 ; it < len ; ++it ) {
    xarg[it] = knapx[it];
}
*farg = result.optValue;
// 目的関数値を取る簡単な方法 ( asDouble() でも可能 )

// 不要な領域の破壊
delete [] ind;
delete [] knapx;
} // SimpleClearBuffer() のコールの前を } で閉じる.
// 終了処理
SimpleClearBuffer();
return result.errorCode; // エラーコードを返す.
}
-----

```

SimpleInitialize() と SimpleClearBuffer() は SIMPLE を利用した処理の最初と最後に必ず必要なコールです。実装上の理由により、SimpleInitialize のコールより後と、SimpleClearBuffer() のコールより前は { } でくくる必要があります。SIMPLE のオブジェクト (Set や Element) の宣言は、この { } の中で行います。SimpleInitialize をコールせずに SIMPLE のオブジェクトを宣言して利用した場合、あるいはこの { } の外で SIMPLE のオブジェクトを宣言すると実行時エラーとなります。

手続きの中ほどで System_knapsack というクラスのオブジェクト knap を宣言していますが、これが knapsack.smp というモデル記述に対応するクラスのオブジェクトの宣言です。このプログラムの先頭の

```
#include "knapsack.h"
```

がこのモデル定義を含むファイルで、モデル knapsack に対応するクラスを利用する場合には必ずインクルードする必要があります。

一般に NAME.smp なるモデルには System_NAME というクラスが対応します。クラスの定

義ファイル NAME.h には System_NAME の定義が書かれています。そのため、System_NAME を使用する際には必ず NAME.h のインクルードが必要になります。

クラス宣言の中で SIMPLE オブジェクトを required というキーワード付きで

```
// knapsack.smp の中
Parameter c(index=i,required);
Parameter a(index=i,required);
Parameter b(required);
```

のように宣言しているので、呼び出し側の手続きで同様に宣言した受け渡し用のオブジェクト

```
// driver.cpp の中
Set S;
Element i(set=S);
Parameter b;
Parameter c(index=i),a(index=i);
```

に

```
b = barg; // スカラはそのまま代入
c.readD(narg,cary); // 配列は readD を用いる.
a.readD(narg,aary); // 配列は readD を用いる.
```

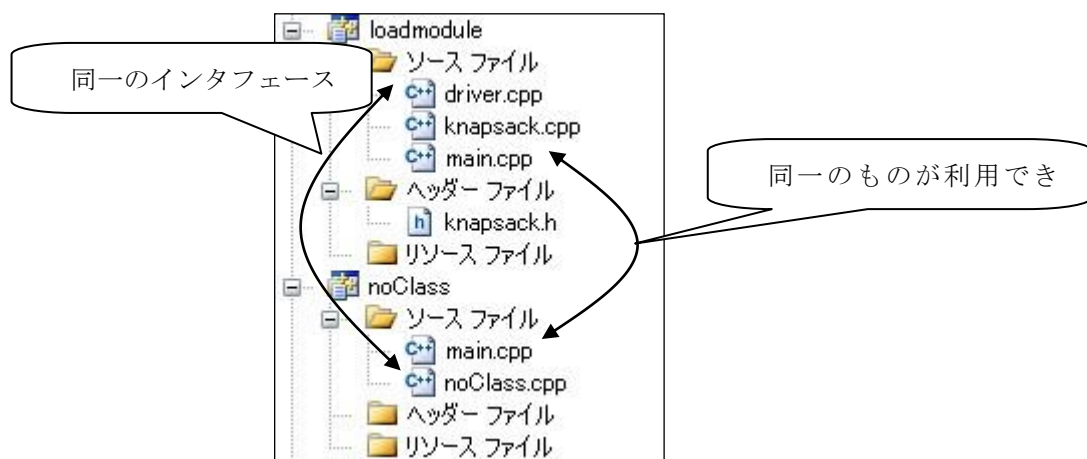
として値を設定、システムオブジェクト knap の宣言の際に

```
System_knapsack knap(c,a,b); // knapsack 問題の求解
```

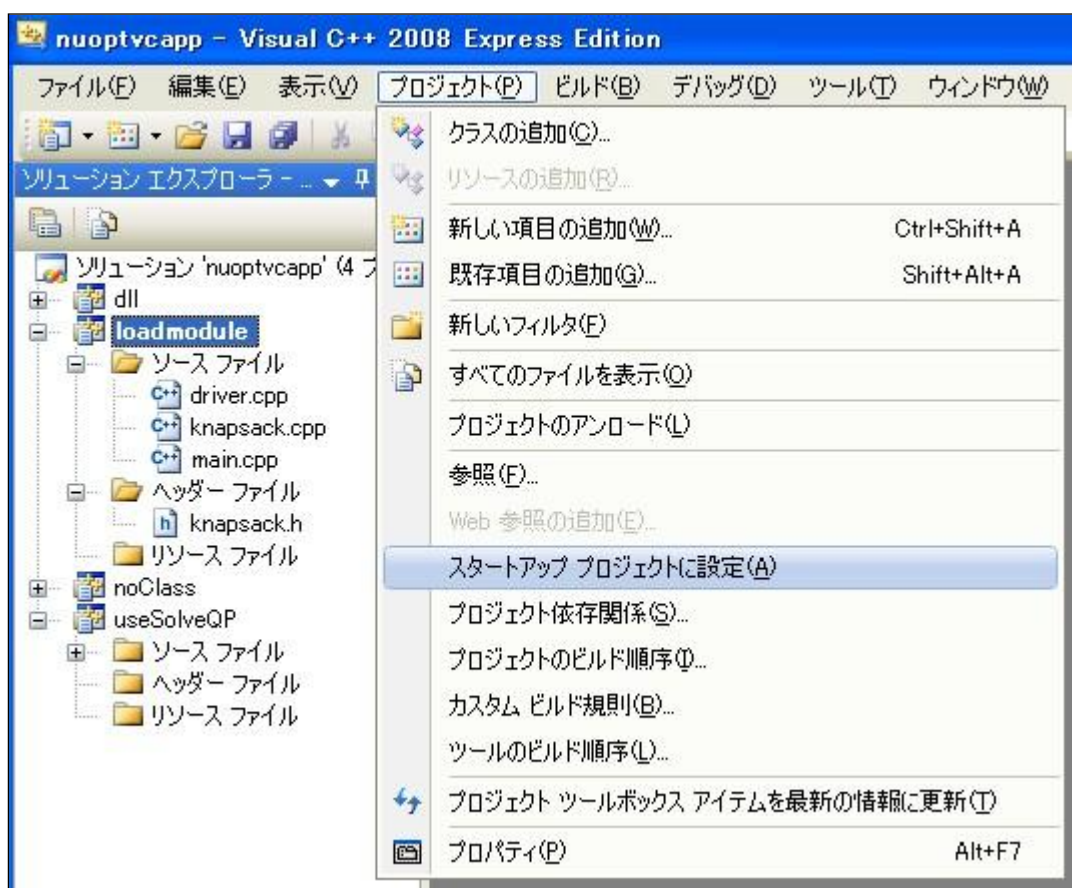
のように渡しています（この引数にはモデル中、required というキーワード付きで宣言したオブジェクトが出現順に並びます）。

5.1.4 C++関数からの呼び出し

driver.cc で定義された knapsackSolve は プロジェクト noClass に含まれている noClass.cpp と同一の仕様ですので、プロジェクト noClass のメインルーチンをそのまま使うことができます。



VC++のメニューの「プロジェクト」から「スタートアップ プロジェクトに設定」を選び、次のようにこのプロジェクトを選択します。



つづいて VC+++GUI の実行を選択：



すると、プロジェクト noClass の出力と同一の出力が得られます。

5.1.5 VisualBasic からの呼び出し ~~VC++~~

ライブラリ部分を DLL にすると一般に VisualBasic などのアプリケーションから呼ぶことができます。プロジェクト dll は同一のドライバルーチンを使って DLL を作成するプロジェクトです。



DLL の入り口となる `knapsackSolve()` をコールするルーチンを作成すると以下ようになります。このルーチンは入力を `knapsackSolve` に渡して一度だけ解くという操作を行います。

```

#include <windows.h>
#include <stdio.h>

// SIMPLE で書かれた NUOPT 側メイン
int knapsackSolve(int narg,double* aarg,double barg,double* carg
    ,double* xarg,double* farg);

// VB から呼ばれる DLL の入り口
#define EXPORT __declspec (dllexport)
#define FORVB _stdcall

extern "C" long EXPORT FORVB nuoptmain(
    long narg // 問題サイズ
    ,double* aarg // ベクトル a
    ,double barg // ベクトル b
    ,double* carg // ベクトル c
    ,double* xarg // ベクトル x(出力)
    ,double* farg // 目的関数値 (出力)
)

{
    int errCode = knapsackSolve(narg,aarg,barg,carg,xarg,farg);
}

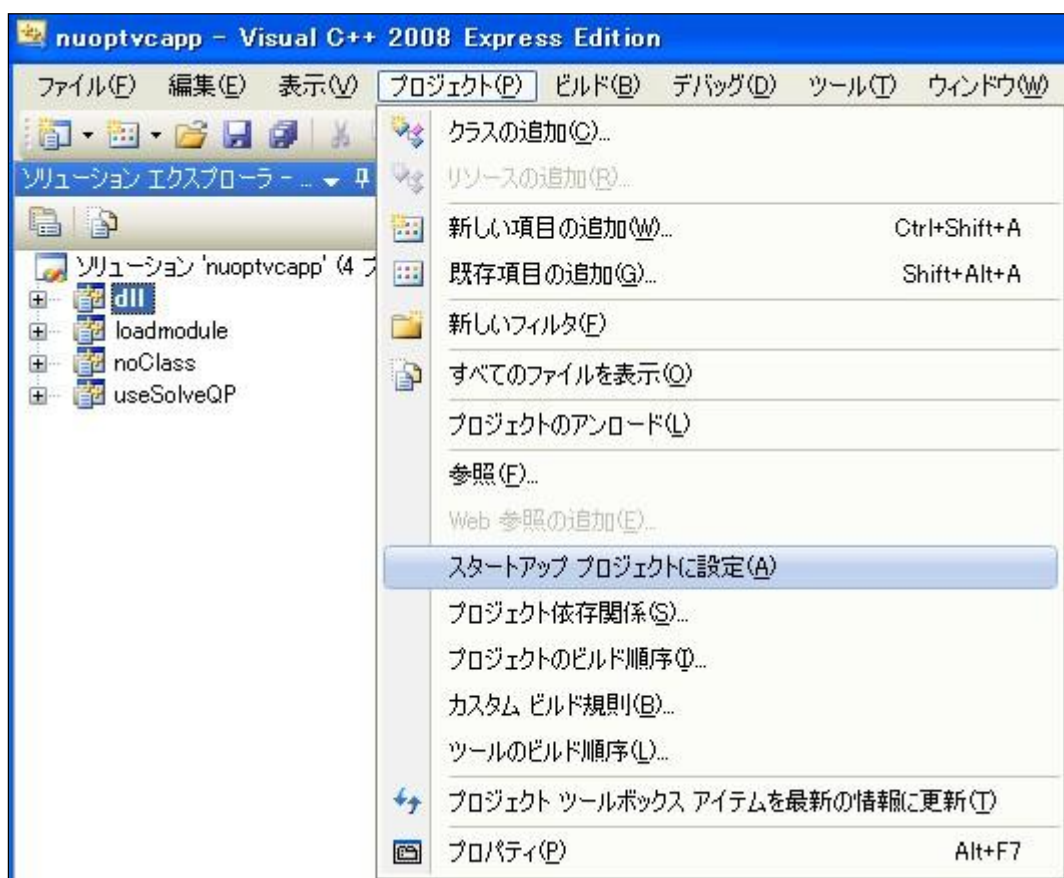
```

DLL のデバッグは

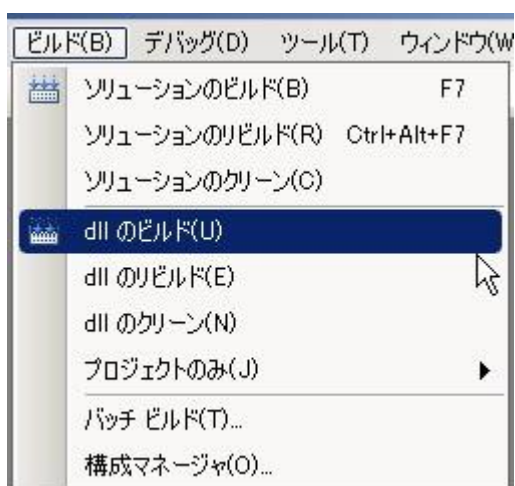
- ◆ 出力が得られない
- ◆ 異常が起こると起動アプリごと動作を停止する

など、困難な点が多いので一度ダミーのメイン関数でコールするロードモジュールなどで動作を確認したのち、DLL を作成することをお勧めします。DLL のメインの宣言方法は通常の Windows アプリケーションと同様です。ここでは、生成した DLL を Excel の VBA からコールする例を示しますのでここでは VBA から呼ばれることを前提とした宣言（_stdcall）となっています。まず、DLL を作成しましょう。

VC++のメニューの「プロジェクト」から「スタートアップ プロジェクトに設定」を選び、次のようにこのプロジェクトを選択します。



こうして、ビルドメニューから



ビルドを選択すると、DLL が作成されます。では、これをリンクして実行する VBA 側の設定

を行います。この DLL を読み込んで実行するサンプルアプリケーションは

(NUOPT のインストール場所) ¥SAMPLES¥app¥dll¥dllsample.xls

です。「マクロを有効にする」で、このエクセルファイルを開き、VisualBasic エディタを開くと、Sheet1 には次のようなコードが書かれています。これはシートからデータを読み取って nuoptmain をコールするコードです。下線部は DLL の絶対パスです（先ほどアクティブな構成の設定でデバッグを選択するとこの場所に DLL が作成されます）。C++ の int は VBA の Long 型に、double は VBA の Double 型にそれぞれ対応します。

Sheet1 に含まれるコード：

```
Private Sub execbutton_Click()
    Dim a() As Double
    Dim c() As Double
    Dim x() As Double
    Dim n As Long
    Dim obj As Double
    n = Range("B2")
    ReDim a(n)
    ReDim c(n)
    ReDim x(n)
    For i = 1 To n
        a(i - 1) = Range("A3").Offset(0, i)
        c(i - 1) = Range("A4").Offset(0, i)
    Next i
    b = Range("B5")
    code = nuoptmain(n, a(0), b, c(0), x(0), obj)
    Range("B7") = code
    Range("B8") = obj
    For i = 1 To n
        Range("A9").Offset(0, i) = x(i - 1)
    Next i
End Sub
```

実行させるには、リンクを行う必要がありますが、そのためには Module1 に次のように宣言を行います。

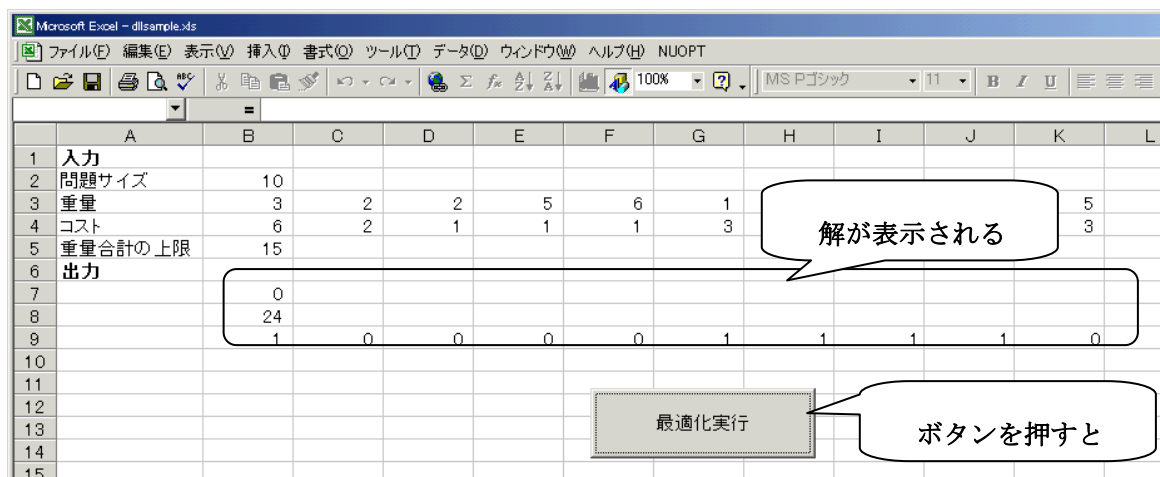
DLL の宣言：

```

Declare Function nuoptmain Lib "Release¥dll.dll" Alias _
    "_nuoptmain@28" (ByVal n As Long, ByVal a As Double, ByVal b As
        Double , ByVal c As Double, ByVal x As Double, ByVal f As Double)
        As Long

```

エクセルシートに戻ってボタンを押すと DLL の実行が行われます。以下はこのコードを使ったアプリケーションの実行例です。



5.1.6 GUI でドライバ (コントロールルーチン) やWINAPI を利用する ~~VC++~~

smp モデルファイルに

```

%%%% #include "C:¥mysrc¥myheader.h" %%%%

```

という行を挟めばモデルとコントロールで共通にこのインクルードが行われます。

この機能を使うと、例えば次のように、WINAPI をモデル定義中に用いることができます。次のモデルはWINAPI (getdate) を用いて、時刻を表示するものです。

```

-----
//
// 簡単な LP (最適化の実行日付を表示する)
//
Variable x;
Variable y;
// 目的関数
Objective cost(type=minimize);

```

```

cost = 180*x + 160*y;
// 制約
6*x + y >= 12;
3*x + y >= 8;
4*x + 6*y >= 24;
// 変数の上下限
0 <= x <= 5;
0 <= y <= 5;

char* getdate(char*);

char chrTime[128];
printf("%s¥n",getdate(chrTime));
fflush(stdout);

%%%% #include <time.h> %%%%

// C++ の関数の定義
char* getdate(char* chrTime)
{
    _strdate(chrTime); // mm/dd/yy 形式で日付を文字列に格納
    return chrTime;
}
-----

```


5.2 UNIX 版ライブラリ (SIMPLE モデル記述からクラスを生成して利用する例)

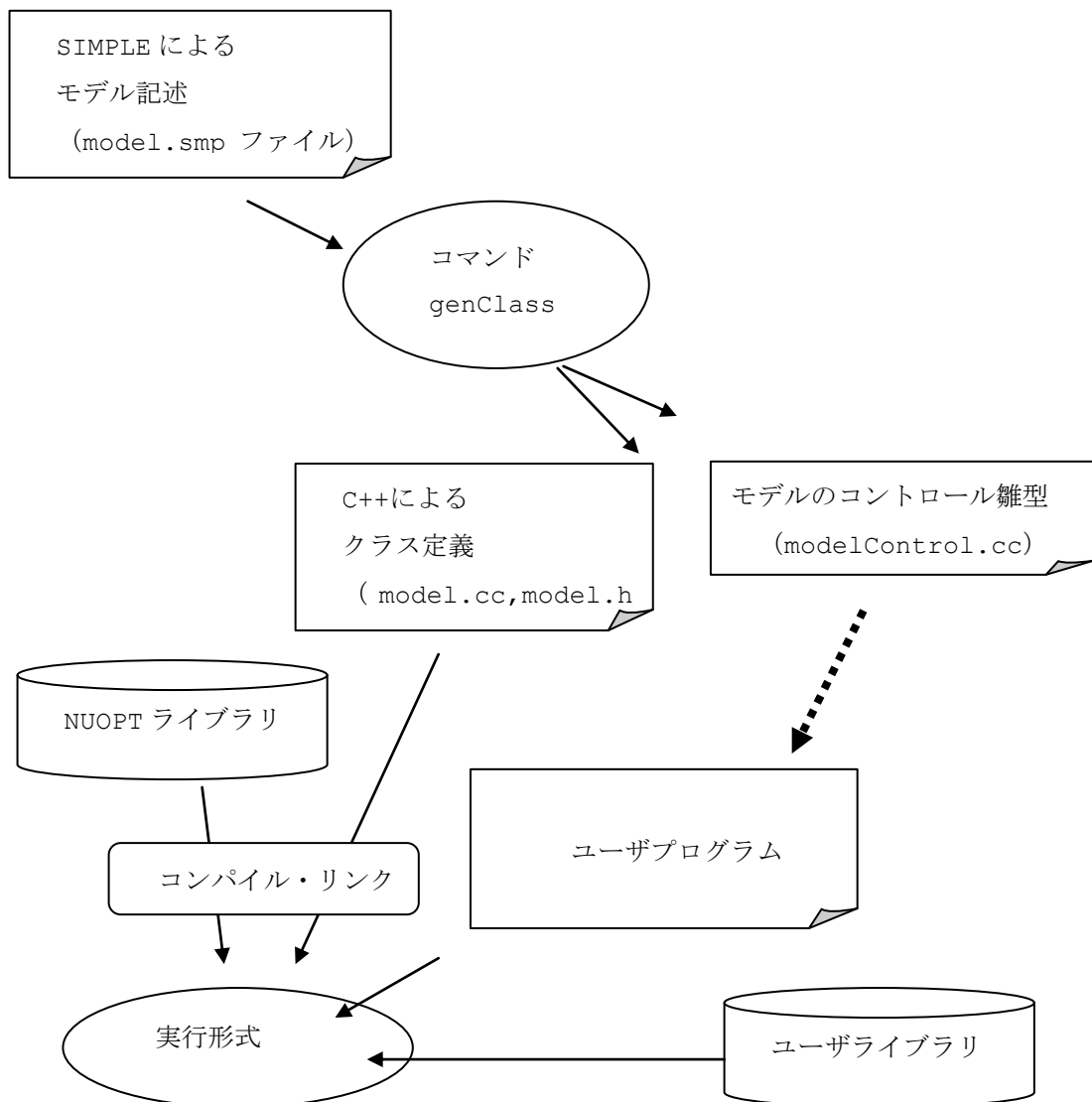
5.2.1 手順の概要

次のページに関連するファイルの関係を図示します。ユーザはまず、モデリング言語 SIMPLE を用いてモデル記述を行います。モデルが記述できたら、その内容を `.smp` という拡張子のファイル（例えば `model.smp`）に格納します。

次に `genClass` というコマンドを用いて `model.smp` から対応するクラス宣言 (`model.h`) とクラスの実装 (`model.cc`) を自動生成します。ユーザはこの内容を意識する必要はありません。

こうして生成されたクラス宣言 (`model.h`) をインクルードすることによって、ユーザのプログラムからこのモデルに対してデータを入力したり、求解を指示したり (`solve()`)、解を出力したり (`cout<<, print(), dump()`) する操作が可能になります。

実行形式の生成の際には、先ほど自動生成されたクラス実装をコンパイル、リンクします。こうして生成された SIMPLE のクラスは同時に何個でも、また何回でも利用することができます。ただし SIMPLE のクラスを利用するに先立って、ユーザのプログラムから初期化関数を呼び出す必要があります（詳細は後述します）。



5.2.2 二次計画問題の例 *UNIX*

サンプルディレクトリの中には次のような簡単な二次計画問題を記述したモデルファイル QP.smp があります.

1. モデルの記述 *UNIX*

```
//
// 簡単な二次計画問題
//
// 集合
Set S;
Element i(set=S);
Set T;
Element j(set=T), k(set=T);
// パラメータ
Parameter c(name="c", index=j);
Parameter Q(name="Q", index=(j,k));
Parameter cu(name="cu", index=i);
Parameter cl(name="cl", index=i);
Parameter A(name="A", index=(i,j));
Parameter bu(name="bu", index=j);
Parameter bl(name="bl", index=j);
// 変数
Variable x(index=j);
// 最小化
Objective f(type=minimize);
f = sum(c[j] * x[j], j)
+ 1.0/2.0 *sum(Q[j,k]*x[j]*x[k], (j,k));
// 条件
Expression constr(index=i);
constr[i] = sum(A[i,j] * x[j], j);
cu[i] >= constr[i] >= cl[i];
bu[j] >= x[j] >= bl[j];
```

2. genClass の起動 **UNIX**

さて、次はこのモデル記述 QP.smp からクラス定義と実装を記述したファイル(C++のコード)を生成します。そのためにはプロンプトから

```
prompt% genClass QP.smp
```

とします。genClass は NUOPT をインストールした環境でのみ実行可能なユーティリティです。そうすると、この数理計画モデルに対応するクラス定義と実装が genClass を起動したディレクトリに作成されます。サンプルの makefile ではこの操作を生成規則に記述しています。

| | |
|--------------|--------------------|
| QP.h | QP.smp に対応するクラスの定義 |
| QP.cc | 同クラスの実装 |
| QPControl.cc | コントロール手続きサンプル |

クラスの定義 (QP.h) は、この数理計画問題に対して操作を行うコントロール手続き (C++のコード) の中で操作を行う前に必ずインクルードする必要があります。クラスの実装 (QP.cc) の内容は通常ユーザが意識する必要はありませんが、実行形式を作成する際にユーザのプログラムにコンパイル・リンクする必要があります。

3. モデルからの問題の生成、求解、出力 **UNIX**

次にこの数理計画モデルに対する操作の例です。以下はサンプルプログラム useClass.cc からこの二次計画問題に関連する操作を行っている部分を抜き出したものです。

```
-----
#include "QP.h" //クラスの定義のインクルード (必須)

...中略...

void simpleControl()
{
    int len,i,*ind;

    //

    // QP の求解
```

```
//
System_QP qp; // QP.smp に対するクラスオブジェクト qp の宣言と最適化実行

qp.f.val.print(); // QP.smp 中のオブジェクトの表示
qp.x.val.print();
qp.constr.val.print();

double* x;
qp.x.val.dump(len,ind,x); // QP の x を C++ の配列にダンプ.

printf("x(QP):%n");
for ( i = 0 ; i < len ; ++i ) {
    printf("[%3d] %10.3e ",ind[i],x[i]);
    if ( (i+1) % 4 == 0 ) {
        printf("%n");
    }
}
printf("%n");

...後略...
-----
```

useClass.cc では simpleControl という手続きの中で二次計画問題に対する操作が記述されています。手続きの名前は任意です。

手続きの最初で System_QP というクラスのオブジェクト qp を宣言していますが、これが QP.smp というモデル記述に対応するクラスのオブジェクトの宣言です。

一般に

NAME.smp なるモデルには System_NAME というクラスが対応

します。クラスの定義ファイル NAME.h には System_NAME の定義が書かれています。そのため、System_NAME を使用する際には必ず NAME.h のインクルードが必要になります。

さて、宣言して作成された qp がその数理計画モデル（問題）そのものに対応します。以下ではこれを説明のため「システムオブジェクト」と呼びます。システムオブジェクトに対して

```
qp.show();
```

とすると、問題の中身が表示されます（showSystem() と同じ）。次にシステムオブジェク

トと数理計画モデルの構成要素についてですが、一般的な原則として以下があります.

System_NAME のオブジェクト `s` について
`s.x` は NAME.smp 中のオブジェクト `x` に対応する.

さらに, `s.x` として参照されたオブジェクトに対する

| | |
|-------|------------------------------------|
| 代入 | = |
| 表示 | <code>print(), cout, dump()</code> |
| 配列の設定 | <code>readD()</code> |

などの操作は通常の SIMPLE オブジェクトに対するのと全く同様に可能です.

例えば

```
qp.f.print();
qp.x.print();
qp.constr.print();
```

とすると, それぞれ QP.smp のモデル中の `f, x, constr` の値が表示されます.

デフォルト動作では宣言を行ったのみで自動的に最適化の実行が行われます. オプションの設定 (`options.noDefaultSolve = 1`) によって, 自動的に最適化の実行が行われるのを抑制することが可能ですが, その場合には

```
qp.solve();
```

として陽に求解を指示します.

サンプルルーチン `useClass.cc` では, QP.smp のデータ (Parameter) は与えていませんが, その場合には, SIMPLE のデータファイルの内容が自動的に設定されます. ただし, そうするにはメイン関数によってデータファイルを読みこんでバッファに蓄えておく必要があります. その方法については後述します.

求解のあと,

```
qp.x.val.dump(len, ind, x); // QP の x を C++ の配列にダンプ.
```

と行うことによって, 解を C++ の配列に解を書き出しています. SIMPLE では一般に

```
(SIMPLE オブジェクト).val.dump
```

によってオブジェクトを配列に書き出すことができますそれを用いた記法です.

4. モデルへのデータ入力 **UNIX**

モデルにデータを設定する方法は

- A) SIMPLE のデータファイルを用いる.
- B) C++の配列を直接設定する.

という二つがあります.

5. データファイルの利用 **UNIX**

useClass.cc では, QP.smp のデータ (Parameter) の設定は 0 の方法で行うことを前提としています. この場合には, このこのデータからシステムオブジェクトを作成する前にメイン関数によってデータファイルを読みこんでバッファに蓄えておく必要があります.

データを読み込むには

```
readData(FILE* fp, char* filename);
```

なる手続きをコールします. fp は C の stdio.h で宣言されているファイル構造体で, 読み込むデータファイルに対応します. データが読み込まれると, データの内容が共用バッファにプールされます. データ読み込みは繰り返すことができます. UseClass.cc の main() 手続きの中の次のコードは, 呼び出し引数として与えられたファイルをすべて読み込んで共用バッファに蓄えます.

```
//
// SIMPLE 形式で記述されたデータを読む
//
int i;
for (i = 1 ; i < argc; i++) {
    char *file = argv[i];
    FILE* fp;
    if (strcmp(file, "stdin") == 0) fp = stdin;
    else fp = fopen(file, "r");
    if (!fp) {
        fprintf(stderr, "can not open %s\n", file);
        exit(1);
    }
    readData(fp, file);
}
```

useClass.cc は QP.smp に対応する例えば次のようなデータ :

```
c = [1] -3 [2] 1;
Q =
[1,1] 11 [1,2] 0
[2,1] 0 [2,2] 22
;
cu = [1] 10 [2] 10 [3] 10;
cl = [1] -1 [2] -2 [3] 2;
A =
[1,1] -1 [1,2] 0.1
[2,1] -0.2 [2,2] -1
[3,1] 2 [3,2] 1
;
bu = [1] 1 [2] 2;
bl = [1] 0 [2] 0;
```

を読み込みますが、この時点で名前と値の対応がバッファに蓄えられます。続いて、

```
System_QP qp;
```

が実行された段階で、QP.smp の中の Parameter である a, Q, cu, cl, A, bu, bl にこの値が設定されます。バッファにプールされたデータとパラメータの対応付けは名前によって行われ

ます。名前はコンストラクト時に `name =` で与えますが、`name =` によって名前を与えられていないオブジェクトには、そのオブジェクトの名前と同じ名前が自動的に与えられます。

例えば、通常

```
Parameter a(name="パラメータ");
```

に対しては

```
パラメータ = 2;
```

というデータファイルの記述が対応しますが、

```
Parameter a;
```

と書くと、これは

```
Parameter a(name="a");
```

としたことに相当して、データファイル中の

```
a = 2;
```

という記述に対応します。

データファイルから読み込んだデータは大域的に有効で、特定のモデルに結びついたものではないことにご注意ください。

例えば

```
Parameter a;
```

という記述を含む二つのモデル `M1.smp`, `M2.smp` があり、それから生成されたクラスの両方を利用するコード、

```
System_M1 m1;
```

```
System_M2 m2;
```

があるとします。

最初に

```
a = 2;
```

というデータファイルを読み込んだ状態でこのコードを実行すると、`m1`, `m2` 両方に `a = 2` が設定されます。

5.2.3 ナップサック問題のモデル (c++の配列からのデータ設定) *UNIX*

useClass.cc ではもうひとつ knapsack.smp というモデルを利用していますが, このモデルのデータは c++の配列からデータを入力しています. その場合にはモデルの記述に変更が必要です. 具体的には外部入力とするパラメータの宣言部分に `required` というキーワードを追加します.

```
//
// ナップサック問題
//

Set S;
Element i(set=S);
IntegerVariable x(index=i,type=binary); // 整数変数
Parameter c(index=i,required);
Parameter a(index=i,required);
Parameter b(required);
Objective obj(type=maximize);

obj = sum(c[i]*x[i],i); // 目的関数
sum(a[i]*x[i],i) <= b; // 制約条件
```

次は useClass.cc の中で knapsack.smp に対するデータを設定している部分です. `required` をつけて宣言したオブジェクトを含む .smp に対応するクラス (ここでは `System_knapsack`) は, `required` をつけて宣言した `Parameter` を順に与えて宣言する必要があります. そうして与えられた `Parameter` が対応するオブジェクトの初期値になります.

```
// knapsack.smp の初期化用のデータの宣言
Set S;
Parameter a(index=S);
Parameter c(index=S);
Parameter b;

// データを C++ 側から与える.
double cary[10] = { 42, 12, 45 , 5 , 2, 61, 89 , 32 , 47, 18};
double aary[10] = { 39, 13, 68 , 15 , 10 , 20 , 31 , 15 , 41 , 16};
```

```

// C++ の配列を初期化用のデータに与える.
b = 121; // スカラはそのまま代入
c.readD(10,cary); // 配列は readD を用いる.
a.readD(10,aary); // 配列は readD を用いる.

System_knapsack knap(c,a,b); // knapsack 問題の求解

double* knapx;
knap.x.val.dump(len,ind,knapx); // knapsack 問題の x を knapx にダンプ

// 表示
printf("x(knapsack):¥n");
for ( i = 0 ; i < len ; ++i ) {
    printf("[%3d] %10.3e ",ind[i],knapx[i]);
    if ( (i+1) % 4 == 0 ) {
        printf("¥n");
    }
}
printf("¥n");

delete [] ind;

```

上の例では、まず、useClass.cc の中で c, a, b を宣言して、readD や代入によってデータの内容を設定、続いて knap の宣言に与えています。こうすることによってモデル中の c, a, b に useClass.cc の中の c, a, b の値が与えられます。useClass.cc のなかの c, a, b と knapsack.smp の中の c, a, b とはここでは同じ名前ですが、必ずしもそうである必要はありません。

5.2.4 初期設定と main 関数 *UNIX*

前項のように SIMPLE のクラスをユーザプログラムから利用するには初期設定をおこなっておく必要があります。

次が simpleControl を呼び出している useClass.cc のメイン部分です。

```
-----

#include "simple.h" // 必要な初期設定
void simpleControl();

//
//   メイン関数サンプル
//
//
int main(int argc, char** argv)
{
    // SIMPLE 内部の初期化 (これはいつでも必須)
    SimpleInitialize();

    //
    //   SIMPLE 形式で記述されたデータを読む
//       (ファイル名が引数から与えられるものとする)
    //
    int i;
    for (i = 1 ; i < argc; i++) {
        char *file = argv[i];
        FILE* fp;
        if (strcmp(file, "stdin") == 0) fp = stdin;
        else fp = fopen(file, "r");
        if (!fp) {
            fprintf(stderr, "can not open %s¥n", file);
            exit(1);
        }
        readData(fp, file);
    }
}
```

```

simpleControl(); // モデルの求解など

// SIMPLE が利用するスタティックバッファのクリア
SimpleClearBuffer();

return 0;
}
-----

```

このプログラムはデモ用に最低限の機能を果たすサンプルです。ユーザはこの内容にこだわることなく、自由に記述することができますが、以下に述べる注意を守する必要があります。

まず、メイン手続きで（すべての NUOPT 関連の処理を行う前に）

```
SimpleInitialize();
```

を必ず一度だけ呼ぶ必要があります。これを呼ぶためには、

```
#include "simple.h"
```

というヘッダファイルのインクルードが必要です。

実行形式を作成するには

使用するモデルファイルから生成されたクラスの実装（QP.cc に相当するもの）
 NUOPT のライブラリ

をユーザプログラムにリンクする必要があります。

最後の SimpleClearBuffer() は SIMPLE が保持しているスタティックバッファのクリアを行う命令です。このコールを行った後は、コールを行う前に定義したいかなる SIMPLE オブジェクトの内容も参照することはできなくなる代わりに、プロセスの占有メモリ領域を減らすことができます。

次はメイクファイルの内容（一部）です。ライブラリはこのメイクファイルで "LIB" という変数に定義されています。

UseClass.cc では、QP.smp の他、knapsack.smp というモデルを使用しているので、これらをまず、genClass に入力、生成された QP.cc, knapsack.cc を useClass.cc とリンクしています。

```
QP.cc : QP.smp # *.smp からソースを生成する規則
    genClass $*.smp

knapsack.cc : knapsack.smp
    genClass $*.smp

useClass : QP.o knapsack.o useClass.o # 実行形式作成
    link -out:$@ QP.o knapsack.o useClass.o $(LIBS)
```

5.2.5 実行形式の作成と最適化の実行

さて、サンプルコード `useClass` のロードモジュールを作成して実行してみましょう.

```
prompt% make useClass
```

とすると, `QP.cc`, `knapsack.cc`, `useClass.cc` がコンパイル, リンクされて `useClass` が作成されます. 引数として `qp312.dat` (`QP.smp` 用のサンプルデータ) を与えてロードモジュールを実行すると, 以下のような出力が得られます.

```
%prompt ./useClass qp312.dat
<reading data_file: qp312.dat>
展開中 目的関数 (1/3 name="f")
展開中 制約式 (2/3)
展開中 制約式 (3/3)
NUOPT x.x.x, Copyright (C) 1991-20xx Mathematical Systems Inc.
PROBLEM_NAME QP
NUMBER_OF_VARIABLES 2
NUMBER_OF_FUNCTIONS 4
PROBLEM_TYPE MINIMIZATION
METHOD TRUST_REGION_IPM
<preprocess begin>.....<preprocess end>
<iteration begin>
    res=7.0e+00 .... 1.7e+00 .... 1.6e-01 .... 2.8e-04 .. 4.8e-10
<iteration end>
STATUS OPTIMAL
VALUE_OF_OBJECTIVE 2.318181819
ITERATION_COUNT 18
FUNC_EVAL_COUNT 22
FACTORIZATION_COUNT 34
RESIDUAL 4.845278896e-10
ELAPSED_TIME(sec.) 0.02
SOLUTION_FILE solver.sol
f=2.31818
x[1]=0.939394
```

```

x[2]=0.121212
constr[1]=-0.927273
constr[2]=-0.309091
constr[3]=2
x[ 1] = 9.394e-01 x[ 2] = 1.212e-01
x(QP):
[ 1] 9.394e-01 [ 2] 1.212e-01
** QP is solved **
展開中 目的関数 (1/2 name="obj")
展開中 制約式 (2/2)
NUOPT x.x.x, Copyright (C) 1991-20xx Mathematical Systems Inc.
PROBLEM_NAME                      knapsack
NUMBER_OF_VARIABLES                10
(#INTEGER/DISCRETE)                10
NUMBER_OF_FUNCTIONS                2
PROBLEM_TYPE                       MAXIMIZATION
METHOD                             SIMPLEX
<preprocess begin>.....<preprocess end>
<iteration begin>
#ROW =      1 #INTROW =      2 #INTROW_D      2
      1.2B

      up:          243 lo:          -1e+50          time:
0.0s:mem(Mb)=0
                                llen:0 #prob:0 #piv:7
#1  up:          243 lo:          241 gap:          2 time:
0.0s:mem(Mb)=0
                                llen:0 #prob:0 #piv:13
#2  up:          243 lo:          242 gap:          1 time:
0.0s:mem(Mb)=0
                                llen:0 #prob:0 #piv:22
      up:          242 lo:          242          time:
0.0s:mem(Mb)=0
                                llen:0 #prob:0 #piv:31

----- breakdown -----

```



```

BB      :      0.0(sec), call=2, succ=0
root/solve:      0.0(sec), call=1, succ=1, i=2
rounding :      0.0(sec), call=1, succ=1, i=2
_____ breakdown _____

<iteration end>
STATUS                                OPTIMAL
VALUE_OF_OBJECTIVE                     242
SIMPLEX_PIVOT_COUNT                     31
RESIDUAL                               1.76716579e-16
ELAPSED_TIME(sec.)                      0.01
SOLUTION_FILE                           solver.sol
x(knapsack):
[ 1]  1.000e+00 [ 2]  0.000e+00 [ 3]  0.000e+00 [ 4]  0.000e+00
[ 5]  0.000e+00 [ 6]  1.000e+00 [ 7]  1.000e+00 [ 8]  1.000e+00
[ 9]  0.000e+00 [10]  1.000e+00
** knapsack is solved **

```

上に挙げた内容は NUOPT からの求解に関するメッセージです.

```

System_QP qp;
...
System_knapsack knap(c,a,b);

```

として生成された問題について順に求解が行われていることがわかります. 問題の変数の数 (NUMBER_OF_VARIABLES) や目的関数の値 (VALUE_OF_OBJECTIVE) を知ることができます. NUOPT の標準出力の内容については NUOPT/SIMPLE マニュアルをご覧ください.

5.2.6 その他の操作 *UNIX*

これで簡単な操作について一通り解説しましたが, 例えば

- ◆ NUOPT のパラメータを指定する.
- ◆ 最適化の初期値を設定する.
- ◆ 解をいろいろなフォーマットで印刷, ファイル出力する.

などが通常の SIMPLE の記述と同様に可能です. 以下ではこれらについて具体的に解説しま

す. NUOPT のパラメータを設定するには, 通常の `.smp` の記法と同様に

```
options.パラメータ名 = ...;
```

というコードを挿入します. 例えば NUOPT の標準出力を抑制するには

```
options.outputMode = "silent";
```

とします. また, デフォルト出力される NUOPT の求解レポート `*.sol` の出力を抑制するには

```
options.outfilename = "_NULL_";
```

と設定します. 例えば, `useClass.cc` で次のように書くと,

```
void simpleControl()
{
    // NUOPT の標準出力を抑制,
    options.outputMode = "silent";
    // NUOPT の解ファイルの出力を抑制
    options.outfilename = "_NULL_";

    int len;
    int* ind;
    int i;

    ...
}
```

次のように NUOPT からの標準出力が抑制されます.

```
<reading data_file: qp312.dat>
f=2.31818
x[1]=0.939393
x[2]=0.121214
constr[1]=-0.927272
constr[2]=-0.309092
constr[3]=2
x(QP):
[ 1] 9.394e-001 [ 2] 1.212e-001
** QP is solved **
x(knapsack):
[ 1] 1.000e+000 [ 2] 0.000e+000 [ 3] 0.000e+000 [ 4] 0.000e+000
[ 5] 0.000e+000 [ 6] 1.000e+000 [ 7] 1.000e+000 [ 8] 1.000e+000
[ 9] 0.000e+000 [10] 1.000e+000
** knapsack is solved **
```

変数の初期値の設定はシステムオブジェクト内の変数に相当するオブジェクトに対して代入を行います. すなわち useClass.cc の例では

```
System_QP qp;
qp.x[1] = 2.0; // x[1]の初期値の設定
```

のように行います. ただし, デフォルト動作では qp を宣言した段階で, 初期値の設定を行う前に求解が行われてしまいますので, これを抑制し, 陽に求解を指示するようにしましょう. 次のようにします.

```
options.noDefaultSolve = 1; // デフォルトで求解を行わないようにする
System_QP qp;           // qp の宣言 (求解は行わない)
qp.x[1] = 2.0;           // 初期値の設定
qp.solve();              // 求解を指示
```

変数のすべてのコンポーネントに同じ初期値を設定するなどの場合には, モデルの中の集合や要素オブジェクトを利用して

```
qp.x[qp.j] = 2.0; // モデル中で x[j] = 2.0; とするのと同じ
```

あるいは

```
Element j(set=qp.T); // モデル内の T をまわる要素を宣言する.
qp.x[j] = 2.0; // j の回る範囲について x の初期値を設定する.
```

などの SIMPLE 独特の記述方法が可能です. ここで, 通常の `int` 型のループ変数を使って

```
int j;
for ( j = 1 ; j <= 3 ; ++j ) {
    qp.x[j] = 2.0;
}
```

のように書くこともできますが, 特に大規模なモデルの場合 (ループ長が 1000 以上になるような場合), には, `Element` をつかった表現にすることをお勧めします. これは SIMPLE の処理は `Element` の利用を前提として最適化されているためです.

`simple_printf()` を利用すると, オブジェクトの内容を書式を設定して出力することができます. 例えば `useClass.cc` で求解を行ったのちに,

```
simple_printf("x[%3d] = %10.3e ", qp.j, qp.x[qp.j]);
```

と書くと

```
x[ 1] = 9.394e-001 x[ 2] = 1.212e-001
```

のような出力が得られます (同様の書式で `simple_fprintf(fp,...);` とすれば任意のファイルに結果を出力することができます).

6. 外部接続時に利用される **SIMPLE** のツール

プロジェクト `loadmodule` の `driver.cpp` や プロジェクト `noClass` の `noClass.cc` (UNIX 版では `useClass.cc` や `useSimple.cc`) では **SIMPLE** のモデルを定義するだけでなく、値を設定したり解を取得したりしていますが、このような場合に必要なツールについて解説します。

6.1 モデルから作成されたオブジェクト（システムオブジェクト）の操作

`driver.cpp` (UNIX 版では `useClass.cc`)で行っているように、`genClass` で生成したクラス定義から

```
System_knapsack knap(c,a,b);
```

として生成されたオブジェクト（ここでは `knap`）がデータを与えられて作成したその数理計画モデル（この場合には `knapsack` 問題）そのものに対応します（以下ではこれを説明のため「システムオブジェクト」と呼びます）。ここで

```
knap.show();
```

とすると、問題の中身が表示されます（`showSystem()` と同じ）。

システムオブジェクトと数理計画モデルの構成要素については、一般的な原則として以下があります。

`System_NAME` のオブジェクト `s` について

`s.x` は `NAME.smp` 中のオブジェクト `x` に対応する。

すなわち、

```
//
// ナップサック問題
//

Set S;
Element i(set=S);
IntegerVariable x(index=i,type=binary); // 整数変数
Parameter c(index=i,required);
Parameter a(index=i,required);
Parameter b(required);
Objective obj(type=maximize);

obj = sum(c[i]*x[i],i); // 目的関数
sum(a[i]*x[i],i) <= b; // 制約条件
```

と定義されたモデルから生成された `knap` について、VC++の GUI で “.” を打った後に以下のように、参照可能なメンバーが現れますが、それぞれはこのモデル中のオブジェクトに対応しています。

```
System_knapsack knap(c,a,b);
knap.|
a
b
c
d
i
obj
S
x
apx;
.dump(len,ind,knapx
< 問題の x を 0の配
解と戻り配列に設定
```

例えば

```
knap.x
```

はモデル中の変数 (Variable `x`) に対応し、このオブジェクトに対する表示手続き：

```
print(),cout,simple_printf()
```

は通常の SIMPLE オブジェクトに対するのと全く同様に可能です。すなわち

```
knap.x.print();
simple_printf("objective = %d¥n",knap.obj);
```

とすると、それぞれ knapsack.smp のモデル中の `x,obj` の値が表示されます.

```
simple_printf("x[%s] = %d¥n",knap.i,knap.x[knap.i]);
```

は少々複雑ですが、"`knap.i`" はモデル中の Element `i` の意味となりますので、モデル中で

```
simple_printf("x[%s] = %d¥n",i,x[i]);
```

としたのと同じ、変数と添字の書式付表示となります.

6.2 C/C++の配列の内容の設定

モデルを操作するルーチンが行う最初の操作は C/C++の配列として渡されたデータを SIMPLE のオブジェクトに設定するということです. スカラー値の場合には, double または int の値をそのまま

```
Parameter b;
b = barg; // barg は double の入力引数
```

と代入できますが, 添字付けられた大量のオブジェクトを配列から一気に読み込むには readD という手続きを使います. readD は一般に C の配列から SIMPLE のオブジェクトを設定するためのツールで, 本章のようなアプリケーション接続の際によく利用されます. 呼び出しの一般形は次の通りです.

```
void readD(int len1,int len2,...,int lenM,double* data) const
```

引数の型:

```
len1,len2,...,lenM : 次元のサイズ
data :               実際のデータ
```

与えられる配列データ (data) を一般の多次元配列 (添字は 1 から始まる整数値) に読みかえて解釈するので, 行列など多次元の配列を定義することができます. 次は実際の利用例です.

```
// 配列内容
double cont[27]={1.1, 1.2, 1.3, 1.4, 1.5, 1.6, 1.7,
                 2.1, 2.2, 2.3, 2.4, 2.5, 2.6, 2.7,
                 3.1, 3.2, 3.3, 3.4, 3.5, 3.6, 3.7,
                 4.1, 4.2, 4.3, 4.4, 4.5, 4.6};

Set a1(name="a1"); Element i1(set=a1);
Parameter p1(index=i1); // 1次元配列データ
p1.readD(5, cont);
// 結果: p1: [1]=1.1, [2]=1.2, [3]=1.3, [4]=1.4, [5]=1.5

Set a2(name="a2",dim=2); Element i2(set=a2);
Parameter p2(index=i2); // 2次元配列データ
p2.readD(2, 3, cont);
```



```
// 結果: p2: [1,1]=1.1, [1,2]=1.2, [1,3]=1.3
//           [2,1]=1.4, [2,2]=1.5, [2,3]=1.6

Set a3(name="a3",dim=3); Element i3(set=a3);
Parameter p3(index=i3); // 3次元配列データ
p3.readD(2, 3, 2, cont);

// 結果: p3: [1,1,1]=1.1, [1,1,2]=1.2, [1,2,1]=1.3, [1,2,2]=1.4
//           [1,3,1]=1.5, [1,3,2]=1.6, [2,1,1]=1.7, [2,1,2]=2.1
//           [2,2,1]=2.2, [2,2,2]=2.3, [2,3,1]=2.4, [2,3,2]=2.5
```

6.3 求解

データの設定が済んだら数理計画問題を解きますが, loadmodule プロジェクトの driver.cpp (UNIX 版では useClass.cc) のように, genClass で生成したクラス定義から作ったモデルを解いている場合には宣言を

```
System_knapsack knap(c,a,b); // knapsack 問題の求解
```

と宣言を行えば自動的に求解が行われます. 変数の初期値の設定を行ってから求解したい場合などは

```
options.noDefaultSolve = 1;
```

と設定してからオブジェクトの宣言を行い,

```
knap.x[i] = 1; // 初期値の設定
knap.solve(); // ここで求解
```

と solve() という手続きを呼びます.

noClass プロジェクトの noClass.cpp (UNIX 版では MIP.cc) の場合のようにモデル定義と操作を同時に行っている場合には

```
solve(); // 最適化の実行
```

とすれば, それ以前に定義したモデルに対する求解が行われます.

6.4 C の配列への書き出し

操作する手続きが次に行うのは, 求解した結果を C++ の配列の形で取得することです. システムオブジェクトに対して `dump()` という手続きを起動します. `loadmodule` プロジェクトの `driver.cpp` (UNIX 版では `useClass.cc`) では

```
int len;
char** ind;
double* knapx;
knap.x.val.dump(len, ind, knapx);
```

と行うことによって, C++ の配列 `knapx` に解を書き出しています. 一般に `dump` の引数は

```
dump(int len, char*& ind, double* data);
```

で,

```
len: ind, data の総長さ
ind: インデックス文字列の配列 (長さ len)
data: データ本体 (長さ len)
```

です. `data[0], data[1], ...` には添字 `ind[0], ind[1], ...` がそれぞれ対応しています. データの並び順はインデックスをソートした際の自然な順番 (数字の場合には昇順, 文字列の場合には辞書順) となり, この場合, 入力データは `readD` によって設定されているので, データ並びに対応する `knapx` には番号順に値が設定されることが保証されます. そのため, `driver.cpp` (UNIX 版では `useClass.cc`) ではインデックスを見ないで戻りの配列に値を設定しています. なお, `ind, data` に対応する領域は `dump` 内部で確保されるためコールした側で解放する必要があります. スカラー値 (添字のないオブジェクト) は長さ 1 のオブジェクト (添字の値としてはヌル文字列が設定されます) として同様に `dump` で取得することができますが, 便利な手続きとして `double` を返す `asDouble()` という手続きがあり,

```
double objval = obj.asDouble();
```

のように値を取ることができます.

6.5 計算結果に関する情報の取得

大域変数である `result` に直前の最適化の結果が設定されます。よく利用されるのは

```
int result.status ... 最適化の終了時の状態
```

で、最適化のステータスコード（正常終了時には0）を返します。

```
double result.optValue;
```

は最適化後の目的関数の値で、`dump()` による取得よりも簡便なので、ここでは目的関数値を戻すのに利用しています。

6.6 求解操作と代入

`VariableParameter` の値を変化させながら複数回最適化を行う場合、モデルに対応するシステムオブジェクト `model` について行う場合には

```
for ( int p = 1; p <= 5 ; ++p ) {
    model.p = p; // VariableParameter の設定
    model.solve(); // 求解
}
```

のように記述を行います。（`p` がモデル中の `VariableParameter` の名前とします）。システムオブジェクトのメンバ（上記では `p`）に対しての代入は通常のモデル内での代入と同様に機能します。

`noClass` プロジェクトの `noClass.cpp` の場合のようにモデル定義と操作を同時に行っている場合には

```
for ( int pi = 1; pi <= 5 ; ++pi ) {
    p = pi; // VariableParameter の設定
    solve(); // 求解
}
```

とします（`VariableParameter p` と同じ名前の `int` 変数 `p` を使うことはできませんので、`pi` としています）。

6.7 NUOPT オプション

プログラム内で NUOPT の動作を制御するパラメータを設定することができます。

SIMPLE モデルに対してパラメータを設定するには、モデルやドライバ中に

```
options.パラメータ名 = 値;
```

と書きます。“options”は大域的に有効な `nuoptParam` のクラスオブジェクトです。設定した内容は次の NUOPT の起動時に反映されます。“options”は大域的に有効なので、以前の指定が残ることにご注意ください。

`solveLP`, `solveQP` を用いて問題を解く際に NUOPT のパラメータを設定するには

```
nuoptParam param;
```

のように NUOPT のパラメータ群を示す `nuoptParam` なるクラスのオブジェクトを定義して（名前は任意）,

```
param.パラメータ名 = 値
```

として、パラメータを設定、その `nuoptParam` のオブジェクトを `solveLP`, `solveQP` の最初の引数として与えます。こうすると、その問題を解く際（`solveLP`, `solveQP` のコール）に対してここで設定したパラメータが与えられます。例えばモデルのアルゴリズムを単体法に指定する場合は、

```
nuoptParam param;
param.method = "simplex";
```

と書きます。

`nuoptParam` クラスで設定できるパラメータは、モデリング言語 SIMPLE の `options` で定義できるパラメータと同じです。設定できるパラメータの詳細については「NUOPT/SIMPLE マニュアル」の「パラメータ設定」をご参考ください。

7. VC++プロジェクトの設定

7.1 Microsoft Visual Studio 2010 プロジェクトの設定

ソリューション

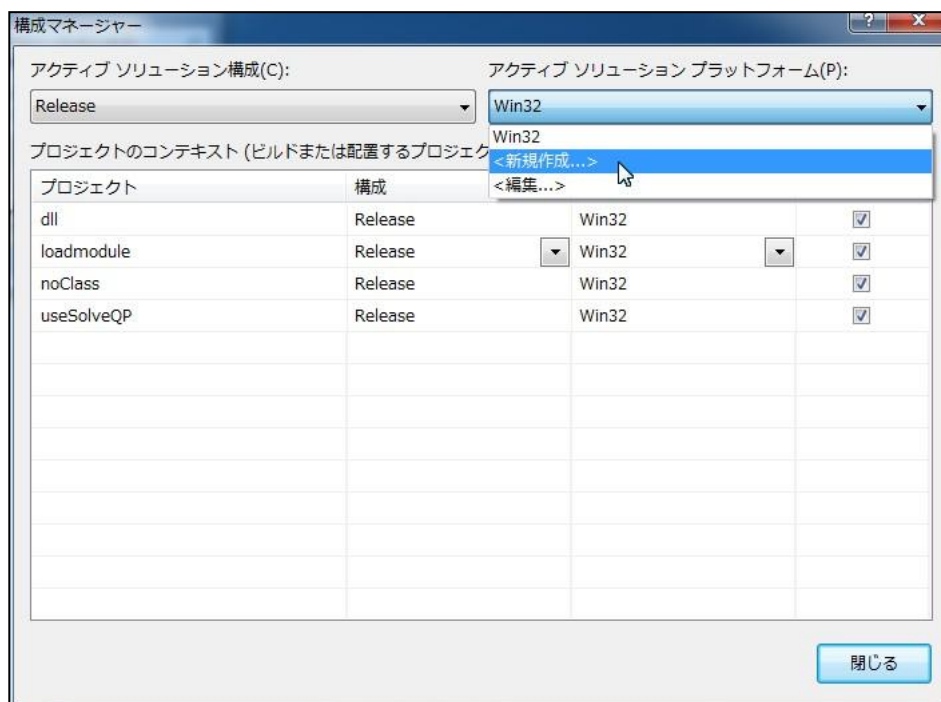
nuopvcapp

に追加されているプロジェクトでは設定済みですが、一般に NUOPT のライブラリとの連結を行ってライブラリ (.LIB), あるいは DLL を作成する場合には、プロジェクトの設定を行う必要があります。以下では、Visual Studio 2010 から NUOPT を利用する際に行う必要のある設定を紹介します。

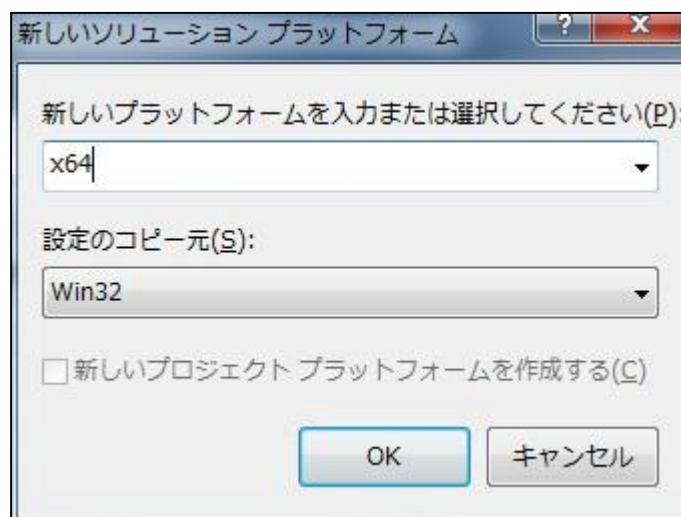
まず、NUOPT のインストール時に 64bit コンパイラを選択した場合は、Win32 プロジェクト設定を 64 ビット プロジェクト構成に変更する必要があります。以下この変更方法について説明します。最初に画面上部にあるコンボボックスをクリックし、「構成マネージャー」を選択します。



次にアクティブソリューションプラットフォーム欄をクリックし、「新規作成」を選択します。



[新しいプラットフォームを入力または選択してください] 欄をクリックし、「x64」と入力後、[OK] ボタンをクリックします。



以上の設定で、ソリューション内のすべてのプロジェクトが 64 ビットプロジェクト構成になります。

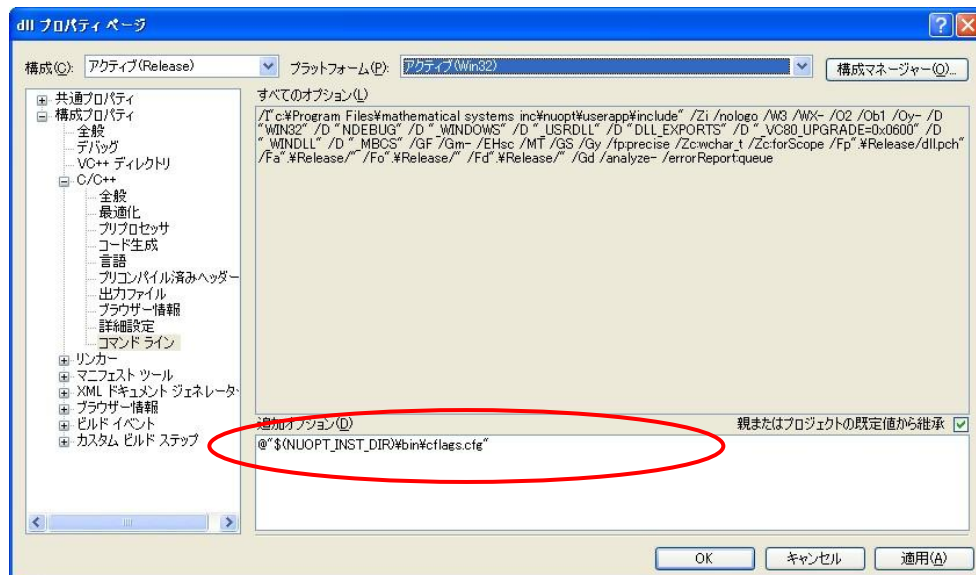
次にプロジェクトの構成を「Release」にする必要があります。下図のように、メニューバー下部にあるコンボボックスに「Release」と設定します。



次にビルドおよびリンクの設定を行います。これより以下の設定は全て[プロジェクト]→[プロパティ]→[構成プロパティ]から行います。まず「構成プロパティ」→「C/C++」→「コマンドライン」と選択し、ウインドウの下部ある「追加のオプション」に

```
@"$ (NUOPT_INST_DIR) %bin%flags.cfg"
```

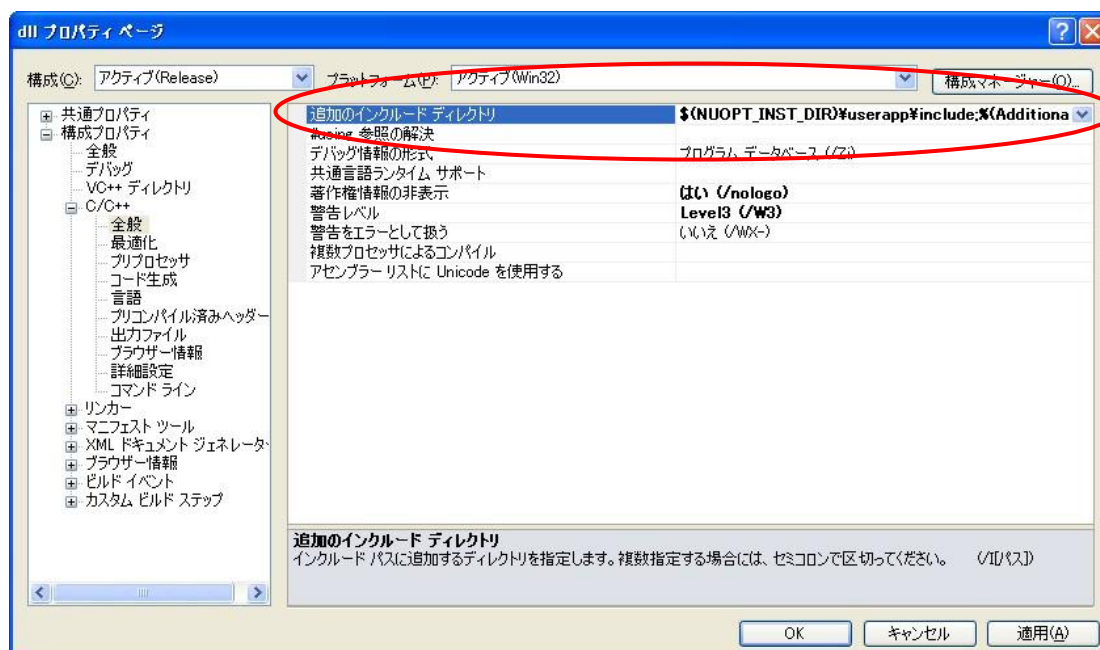
を追加します。NUOPT_INST_DIR はNUOPT のインストール場所を表す環境変数です。



「構成プロパティ」→「C/C++」→「全般」と選択し、ウインドウ内にある「追加のインクルードディレクトリ」に

```
$ (NUOPT_INST_DIR) %userapp%include
```

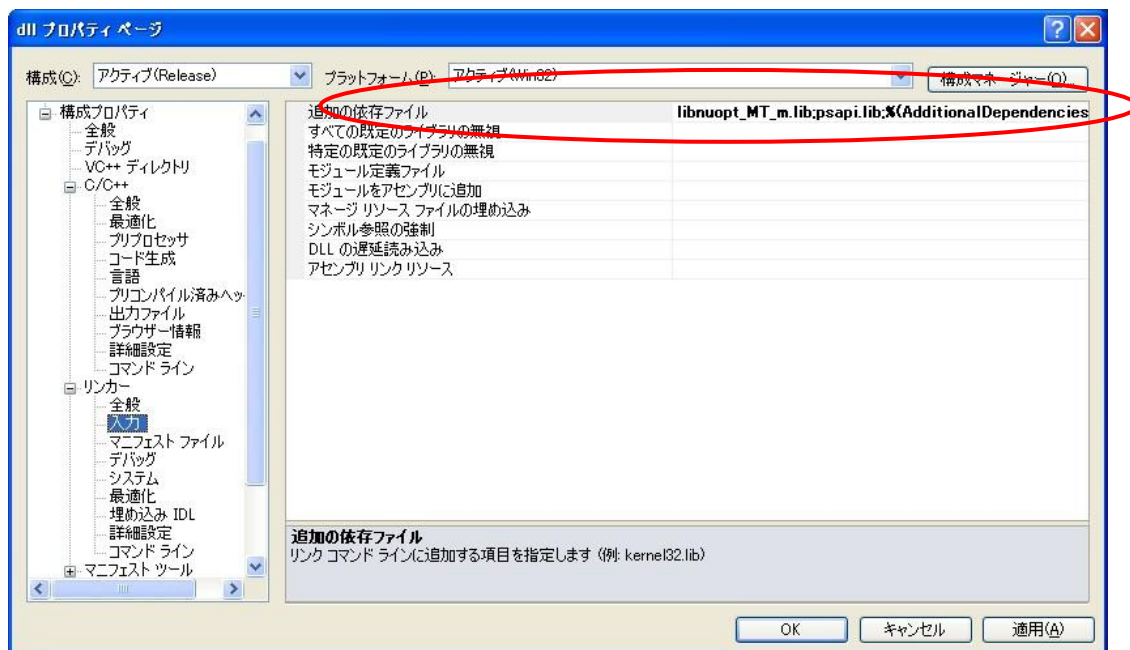
を追加します。なお、下線部はNUOPT のインストール場所に対応します。



「構成プロパティ」→「リンカ」→「入力」と選択し、ウインドウ内にある「追加の依存ファイル」に

```
libnuopt_MT_m.lib;psapi.lib;
```

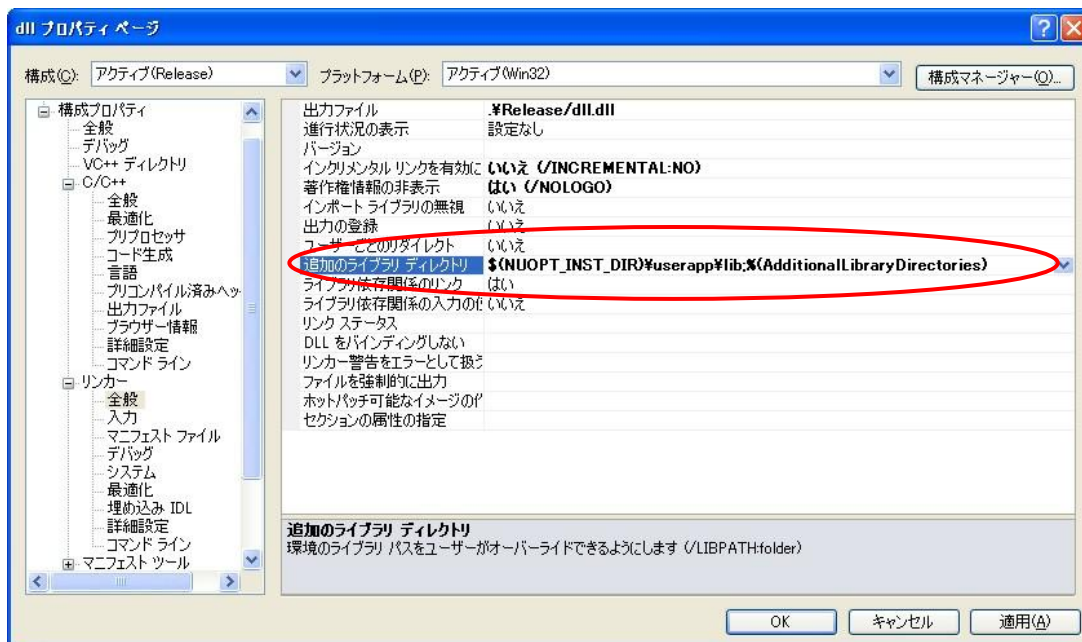
を追加します。なお本設定は NUOPT のライブラリに接続しているアプリケーションで使用するライブラリがデフォルトの「マルチスレッド」でコンパイルする場合です。詳細は以降にある「※注意 1」をご覧ください。



「構成プロパティ」→「リンカ」→「全般」と選択し、ウインドウ内にある「追加のライブラリディレクトリ」に

\$ (NUOPT INST DIR)¥userapp¥lib;

を追加します。上記の下線部は NUOPT のインストール場所に対応します。



※注意 1 (アプリケーションで利用しているランタイムライブラリについて) :

上記は NUOPT のライブラリに接続しているアプリケーションで使用するランタイムライブラリが「マルチスレッド」でコンパイルされている場合です (この設定はプロジェクト→プロパティ→C/C++→コード生成で現れる「ランタイムライブラリ」の選択に対応します)。もし、NUOPT のライブラリと接続するコードがデフォルトと違って以下のようにになっている場合には、3. で指定するライブラリの名前を「マルチスレッド DLL」なら

```
libnuopt_MD_m.lib
```

としてください。

7.2 Microsoft Visual C++ 6 プロジェクトの設定

まず, NUOPT の添付例には, nuoptapp.sln が付属していますが, これは Visual Studio 2005 以降のソリューションです. VC6 では nuoptvcapp.dsw がこれに対応しますので, こちらをご利用下さい. ワークスペース

nuopvcapp

に追加されているプロジェクトでは設定済みですが, 一般に NUOPT のライブラリとの連結を行ってライブラリ (.LIB), あるいは DLL を作成する場合には, プロジェクト→設定で次の設定を行う必要があります.

1. 「プロジェクトオプション」のウインドウの先頭に

```
@ " $(NUOPT_INST_DIR)¥bin¥cflags.cfg"
```

を追加します. 下線部は NUOPT のインストール場所を表す環境変数です. この設定がないと

インクルード ファイルがオープンできません. 'strstream.h':

というエラーが現れます.

2. C/C++タブ, カテゴリを「プリプロセッサ」にして「インクルードファイルのパス」を

```
$(NUOPT_INST_DIR)¥userapp¥include
```

下線部は NUOPT のインストール場所に対応します. この設定が誤っていると

インクルード ファイルがオープンできません. 'simple.h'

というエラーが現れます.

3. リンクタブ, カテゴリを「インプット」にして「オブジェクトライブラリモジュール」の先頭に

```
libnuopt_ML_m.lib
```

を追加します.

この設定が存在しないとリンクの際に

```
SystemInterface::SystemInterface(char const *)
```

などの未解決エラーになります. また,

_memmove はすでに LIBCD.lib(memmove.obj) で定義されています

などのエラーが多数出力される場合には, 以下の注意の項をご覧ください. アプリケーションで

利用しているランタイムライブラリの設定の問題である可能性があります.

4. さらに「追加ライブラリのパス」を

```
$(NUOPT_INST_DIR)¥userapp¥lib
```

にします.

下線部は NUOPT のインストール場所を表す環境変数です. この設定が誤っていると

ファイル "libnuopt_ML_m.lib" を開けません。
というエラーになります。

以上の設定を終えたら、ビルドが可能です。

※注意1（アプリケーションで利用しているランタイムライブラリについて）：

ただし上記は NUOPT のライブラリに接続しているアプリケーションで使用するランタイムライブラリがデフォルトの「シングルスレッド*」あるいは「シングルスレッド（デバッグ）」でコンパイルされている場合です（この設定はプロジェクト→設定の「C/C++タブ」で「コード生成」で現れる「使用するランタイムライブラリ」の選択に対応します）。もし、NUOPT のライブラリと接続するコードがデフォルトと違って以下のようにになっている場合には、3. で指定するライブラリの名前を

「マルチスレッド」あるいは「マルチスレッド（デバッグ）」なら

`libnuopt_MT_m.lib`

「マルチスレッド DLL」あるいは「マルチスレッド DLL（デバッグ）」なら

`libnuopt_MD_m.lib`

としてください。

※注意2（無害な警告について）：

Debug / Release の Debug を選ぶと以下の警告が出ますが、無害です。

LINK : warning LNK4098: defaultlib "LIBC" は他のライブラリの使用と競合しています; /NODEFAULTLIB:library を使用してください

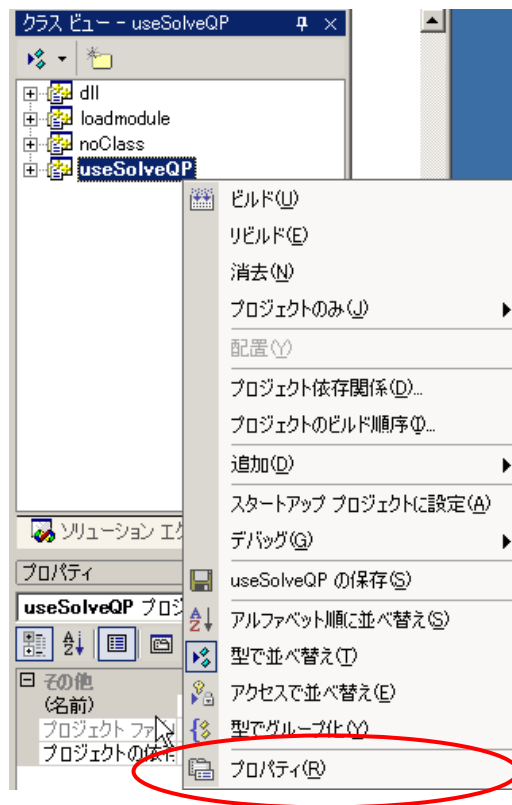
7.3 Microsoft Visual C++.net プロジェクトの設定

「NUOPT 外部接続マニュアル」では、Visual Studio 2010 の GUI を元にした記述を行っている箇所があります。本節では、Microsoft Visual C++.net（以下 VC.NET）の GUI の操作方法について簡単にご説明します。

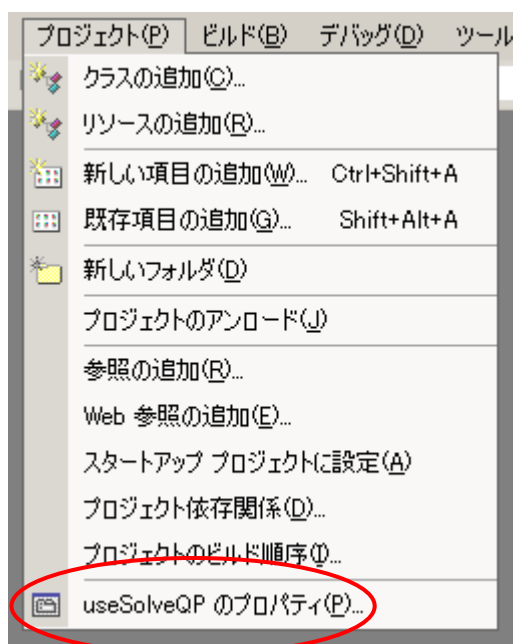
nuoptvcapp.sln をダブルクリックなどすると、VC.NET の GUI が起動します。

VC.NET の GUI から NUOPT を VC++ プロジェクトとして利用する際の設定内容は、以下のいずれかの操作によって表示されるウインドウから設定できます。

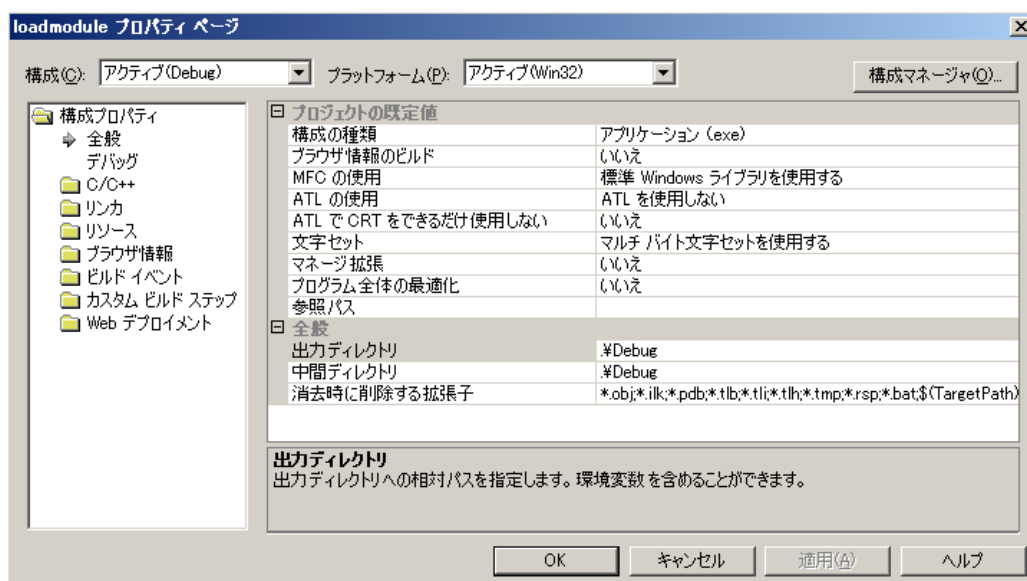
(a) GUI の右側にある「クラスビュー」ウインドウ内に各プロジェクトが表示されています。そのプロジェクト上で右クリックすると、下図のようなメニューが表示されます。そのメニューの「プロパティ」を選択すると、設定ウインドウが表示されます。



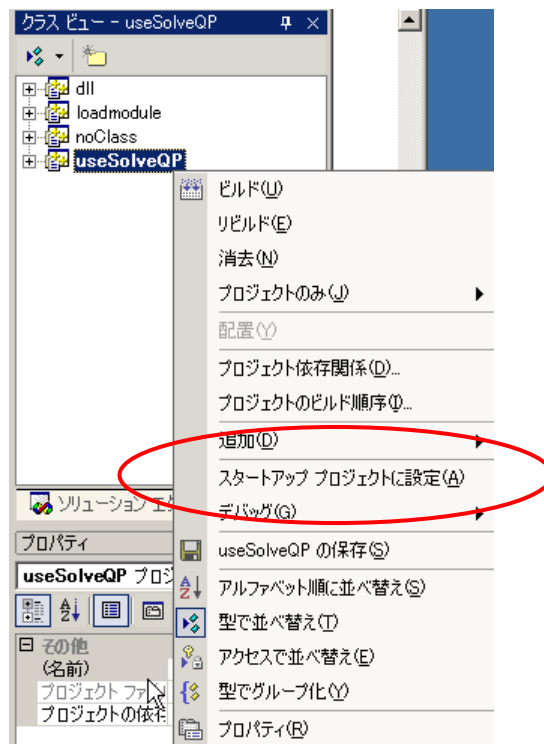
(b) 下図のようにメニューバーから「プロジェクト」→「プロパティ」とすると、設定ウインドウが表示されます。



そのときに表示されるウインドウは下図のようなものです。



なお、(b) の場合に表示されるウインドウは、「スタートアッププロジェクト」に設定されているプロジェクトに対応する設定ウインドウです。「スタートアッププロジェクト」を設定するには、GUI 右側に表示されている「クラスビュー」内に表示されているプロジェクトのうち、「スタートアッププロジェクト」に設定したいプロジェクトの上で右クリックし、下図のようなメニューを表示させます。



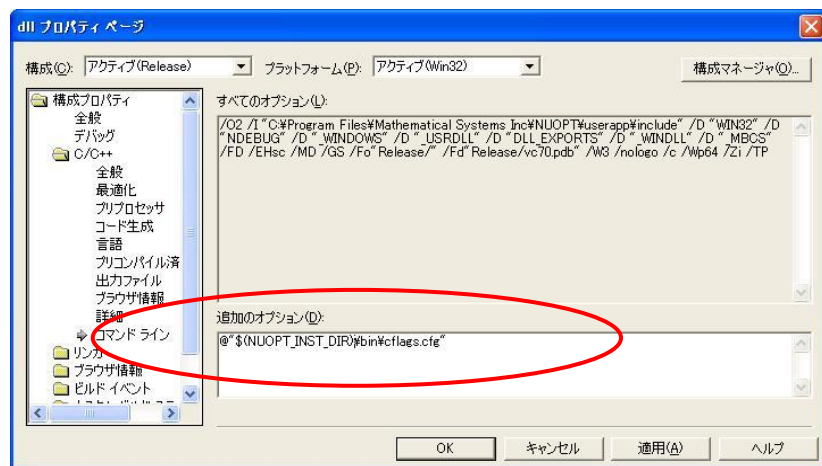
上図のメニューから「スタートアッププロジェクトに設定」を選択すると、当該プロジェクトが「スタートアッププロジェクト」となります。

それでは、VC.NET から NUOPT を利用する際に行う必要のある設定を紹介します。

「構成プロパティ」→「C/C++」→「コマンドライン」と選択し、ウインドウの下部ある「追加のオプション」に

```
@"$ (NUOPT_INST_DIR) %bin%cflags.cfg"
```

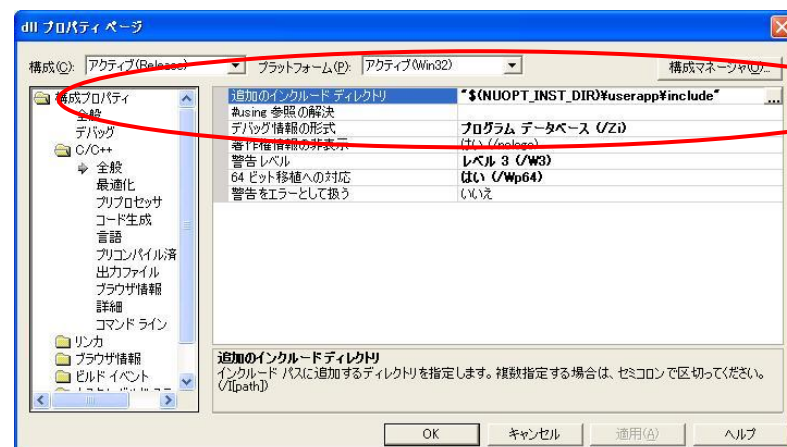
を追加します。下線部は NUOPT のインストール場所を表す環境変数です。



「構成プロパティ」→「C/C++」→「全般」と選択し、ウインドウ内にある「追加のインクルードディレクトリ」に

`$(NUOPT_INST_DIR)\bin\cflags.cfg`

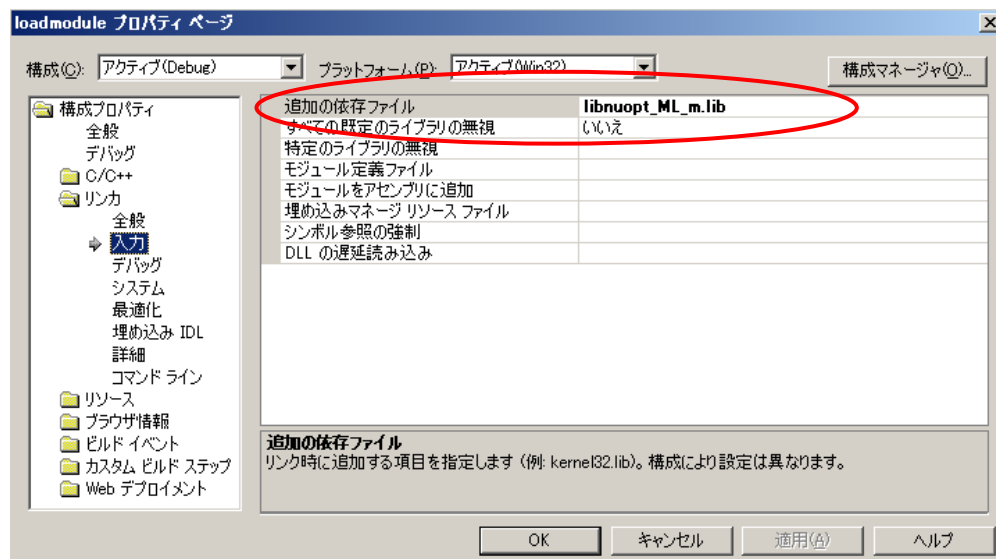
を追加します。なお、下線部は NUOPT のインストール場所を表す環境変数です。



「構成プロパティ」→「リンカ」→「入力」と選択し、ウインドウ内にある「追加の依存ファイル」に

`libnuopt_ML_m.lib`

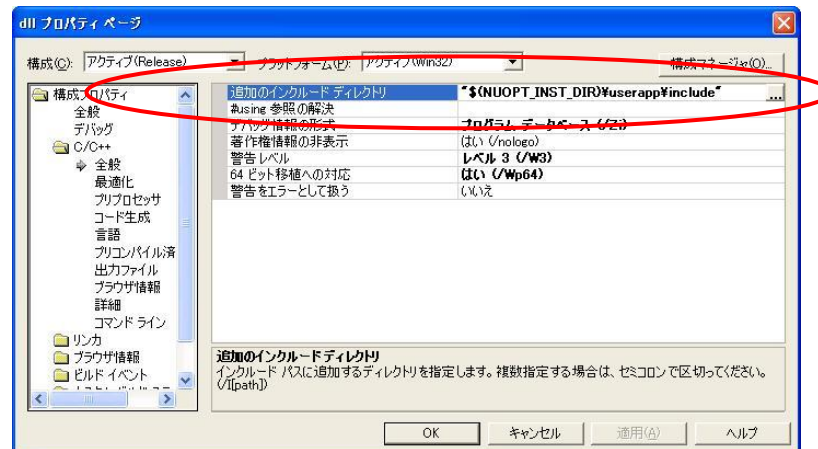
を追加します(本設定は NUOPT のライブラリに接続しているアプリケーションで使用するライブラリがデフォルトの「シングルスレッド*」あるいは「シングルスレッド (デバッグ)」でコンパイルされている場合です。それ以外の場合には、本マニュアル 7.1 の (注意 1) をご覧下さい)。



「構成プロパティ」→「リンク」→「全般」と選択し、ウインドウ内にある「追加のライブラリディレクトリ」に

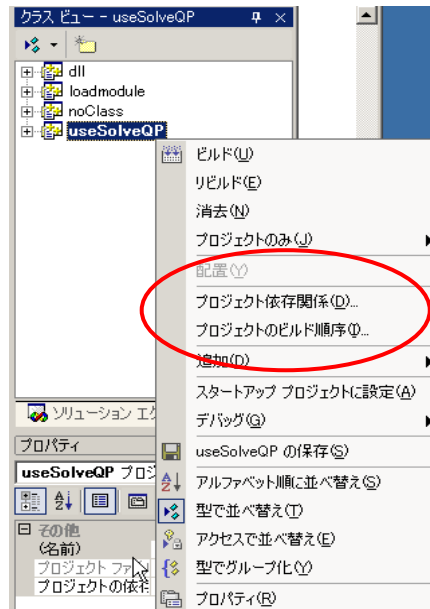
```
$ (NUOPT_INST_DIR)¥userapp¥lib
```

を追加します。下線部は NUOPT のインストール場所を表す環境変数です。

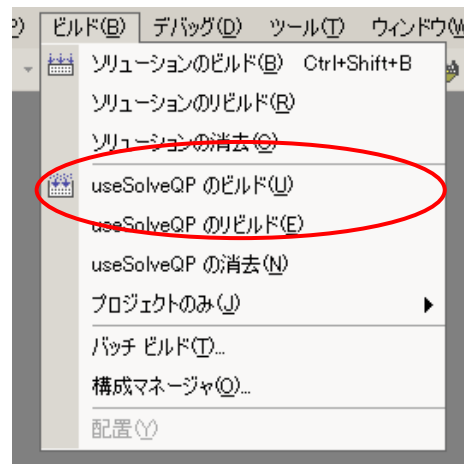


これらの設定の後、ビルドが可能になります。ビルドを行う方法として、次の二つがあります。

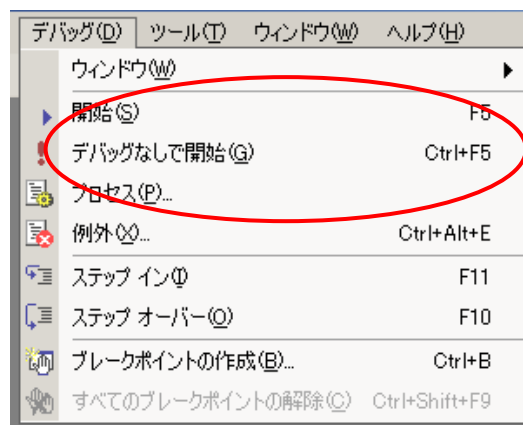
方法 1 : 「クラスビュー」にて当該プロジェクトを右クリックして表示されるメニューから「ビルド (リビルド)」を選択する。



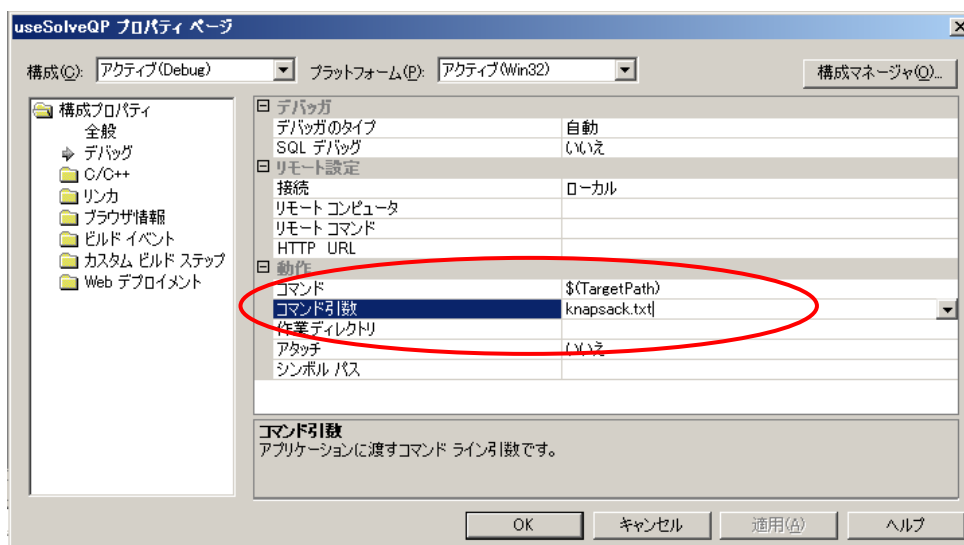
方法 2 : 当該プロジェクトが「スタートアッププロジェクト」である場合には、メニューバーの「ビルド」から実行することもできます。



ビルドしたプロジェクトは、メニューバーの「デバッグ」から「開始 (デバッグなしで開始)」を選択することで実行できます。



このとき、コマンドに引数を与える必要がある場合（NUOPT に付属の例ではプロジェクト 'useSolveQP' がこれにあたります）は、上記 (a) もしくは (b) にて表示されるウインドウにて「構成プロパティ」→「デバッグ」と選択し、そのウインドウに現れる「コマンド引数」にその内容を記述してください。



7.4 外部 CLAPACK (CBLAS) の使用方法

NUOPT V13 から外部 CLAPACK

(CBLAS) を NUOPT ライブラリへリンクすることができるようになりました。これにより大規模な線形計画問題において内点法を用いる場合の求解速度が速くなる場合があります。例えば、Intel 社の MKL を使用することで、CPU が Core2 Quad 3GHz (Q9650) で求解時間が 1/3 となった問題がありました⁵。

本節では、外部 CLAPACK (CBLAS) を NUOPT ライブラリへリンクする方法について説明をします。基本的な設定方法はコンパイラのバージョンが異なっても同じであるため、ここでは Microsoft Visual Studio 2010 を例にします。

まずは、「7.1 Microsoft Visual Studio 2010 プロジェクトの設定」を行い、正しくソリューションがビルドできることを確認してください。

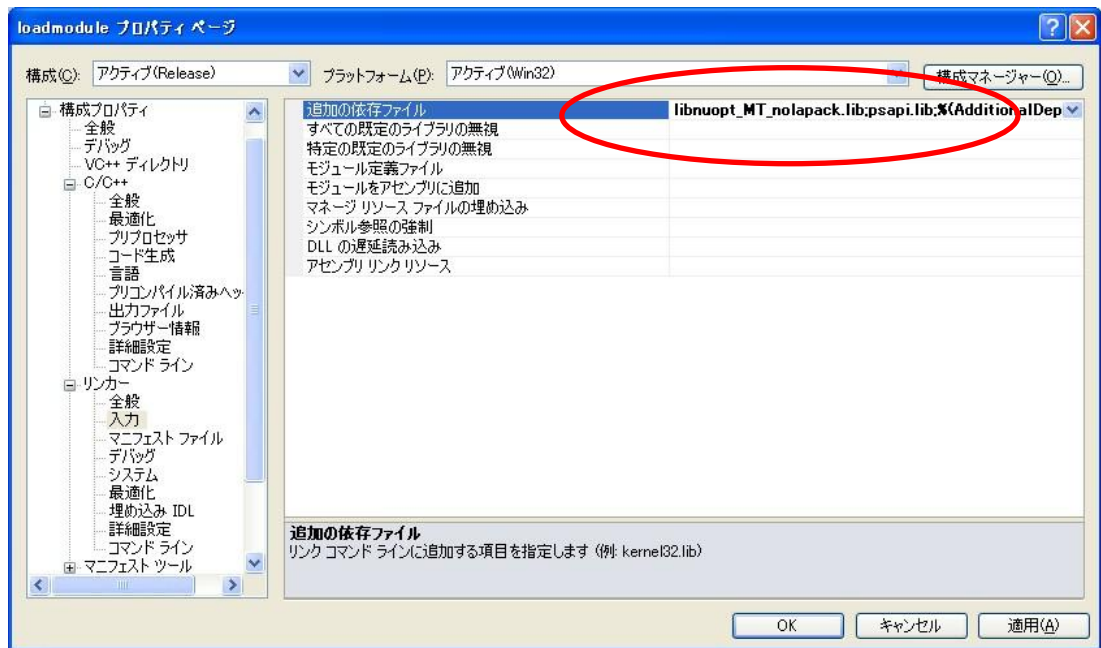
次に、NUOPT のライブラリを外部 CLAPACK とリンクするためのものに変更します。具体的には、プロジェクト→プロパティ→構成プロパティから、「構成プロパティ」→「リンカ」→「入力」と選択し、ウインドウ内にある「追加の依存ファイル」の

```
libnuopt_MT_m.lib;psapi.lib
```

⁵ これは結果の一例であり、全ての問題で必ず同程度速度が速くなることを保証できるわけではありません。しかしながら、MKL の場合はスレッド化されるため、Many Core の環境では多くの問題でより高パフォーマンスとなることが期待できます。

を次のように変更します。

```
libnuopt_MT_nolapack.lib;psapi.lib
```



この後、ソリューションのビルドを行うと、以下のようなエラーメッセージが出力され正しくビルドが完了しません。これは外部 CLAPACK (CBLAS) の関数のリンクに失敗しているためです。そのため、以下で外部 CLAPACK (CBLAS) ライブラリの設定を行います。

4>リンクしています...

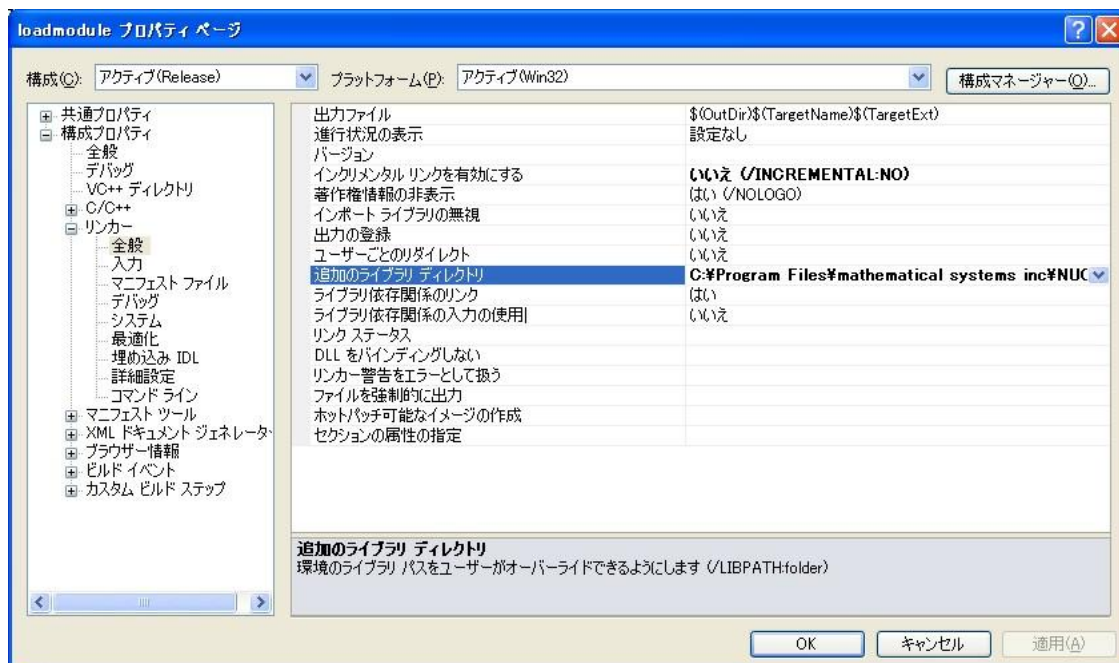
3>libnuopt_MT_nolapack.lib(Vt.obj) : error LNK2001: 外部シンボル"_idamax_" は未解決です。

3>libnuopt_MT_nolapack.lib(rhoupsdp.obj) : error LNK2001: 外部シンボル"_idamax_" は未解決です。

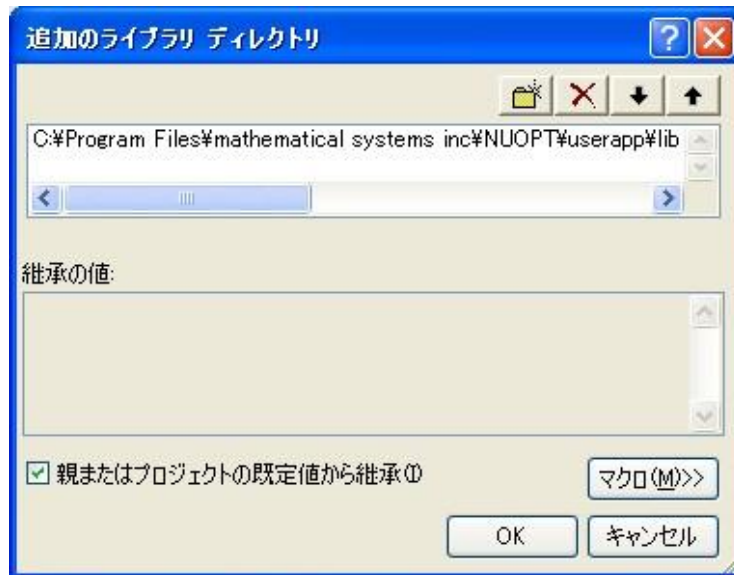
3>libnuopt_MT_nolapack.lib(dgefa.obj) : error LNK2001: 外部シンボル"_idamax_" は未解決です。

...

先の「追加の依存ファイル」に外部 CLAPACK (CBLAS) のライブラリを入力してください。これは使用する外部 CLAPACK (CBLAS) によりライブラリ名が決まりますので、必要なら CLAPACK (CBLAS) のマニュアル等をご覧ください。次に、この(これらの)ライブラリがあるフォルダを指定します。「構成プロパティ」→「リンカ」→「全般」と選択し、ウインドウ内にある「追加のライブラリ ディレクトリ」の右側にあるボタンをクリックしてください。



ボタンをクリックすると次のようなダイアログが表示されます。



このダイアログから、先に指定した外部 CLAPACK (CBLAS) のあるフォルダを追加してください。ライブラリが複数ある場合は複数のフォルダを指定する必要があるかもしれません。適切なフォルダに関しては外部 CLAPACK (CBLAS) のマニュアル等をご覧ください。

以上で外部 CLAPACK (CBLAS) の設定になります。ご不明な点がございましたら

nuopt-support@msi.co.jp

までお問い合わせください。

7.5 分枝限定法の並列化の利用

NUOPT V14 から分枝限定法の並列化ができるようになりました。ここではこの機能を外部接続で利用するにあたって必要な手順を説明します。なお、分枝限定法の並列化に必要な動作環境については「NUOPT/SIMPLE マニュアル」における「分枝限定法の並列化」の章を参考にしてください。

まずは、「7.1Microsoft Visual Studio 2010 プロジェクトの設定」を行い、正しくソリューションがビルドできることを確認してください。

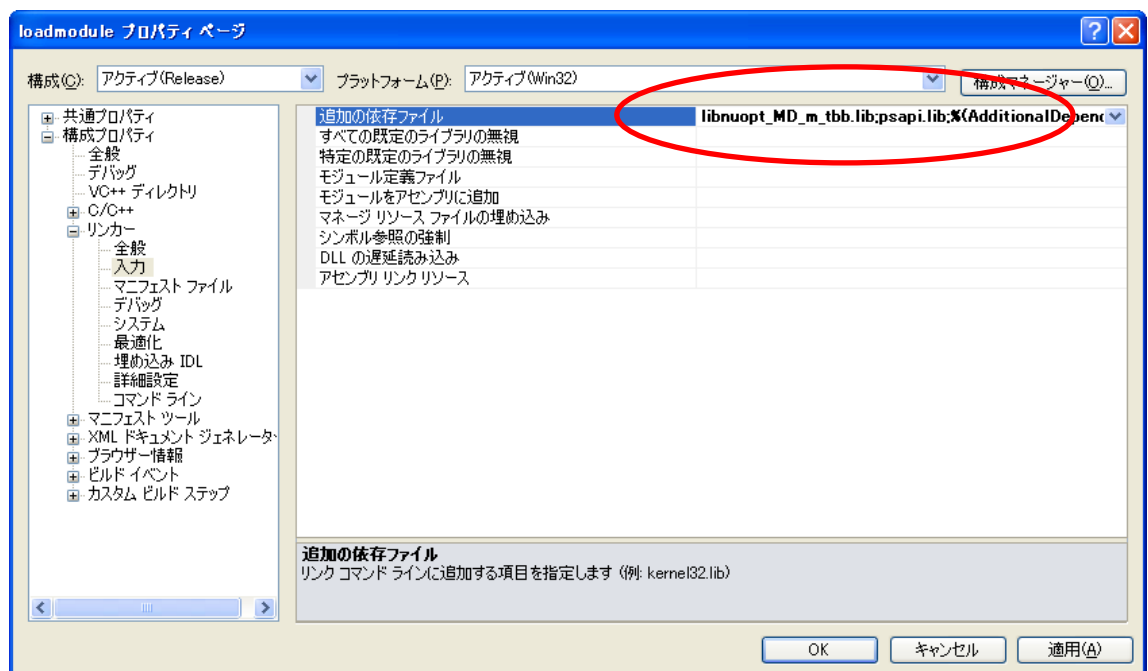
分枝限定法の並列化を利用する場合は、アプリケーションがリンクするランタイムライブラリが「マルチスレッド DLL」である必要があります。この設定はプロジェクト→プロパティ→C/C++→コード生成で現れる「ランタイムライブラリ」において「マルチスレッド DLL」を選択することに対応します。

次に、NUOPT のライブラリを分枝限定法の並列化処理対応するライブラリに変更します。具体的には、プロジェクト→プロパティ→構成プロパティから、「構成プロパティ」→「リンカ」→「入力」と選択し、ウインドウ内にある「追加の依存ファイル」の

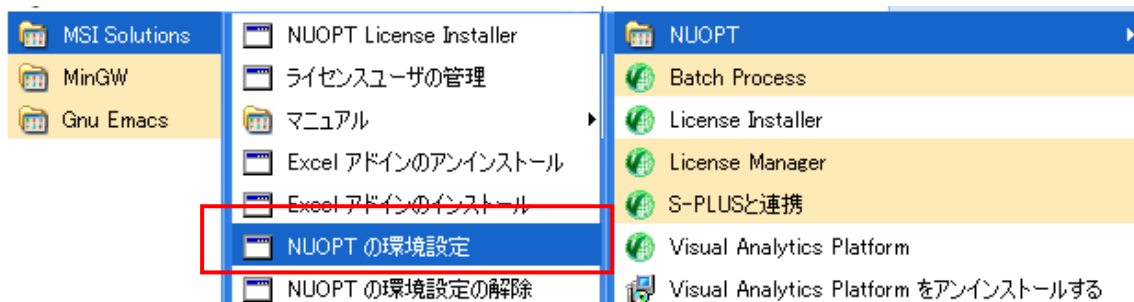
```
libnuopt_MT_m.lib;psapi.lib
```

を次のように変更します。

```
libnuopt_MD_m_tbb.lib;psapi.lib
```

最後に、作成されたアプリケーションの実行には NUOPT の配布する DLL を利用する必要があります。このため [すべてのプログラム] -> [MSI Solutions] -> [NUOPT] -> [NUOPT の環境設定] を選択し実行に必要な環境を設定します。



以上で分枝限定法の並列化の設定になります。ご不明な点がございましたら

nuopt-support@msi.co.jp

までお問い合わせください。

索引

—
_stdcall 68

A

asDouble() 99

B

bL 22

bU 22

C

C++のライブラリ

 solveLP, solveQP 18

CBLAS 117

cflags.cfg 108

cL 22

CLAPACK 117

cout 94

cU 22

D

dir 25

DLL 67

dllsample.xls 70

dpc 25

driver.cpp 62

dump() 99

G

genClass 59, 60, 76

 実行例 61

I

ibL 22

ibU 22

icL 22

icU 22

L

libnuopt_MD_m.lib 107, 109

libnuopt_ML_m.lib 108

libnuopt_MT_m.lib 109

loadmodule 57

M

main.cpp 47

N

noClass 42

noClass プロジェクト 100

noDefaultSolve 91

nuoIf.h 20

nuoptParam 101

nuoptResult 27

nuoptvcapp.sln 5

O

outfilename 37, 90

outputMode 37, 90

P

pri 25

print() 94

R

readD 83, 96
 required 59, 65, 82
 result 100
 result.optValue 100
 result.status 100

S

secini() 54
 show() 93
 showSystem() 93
 simple_fprintf 92
 simple_printf 92
 simple_printf() 94
 SimpleClearBuffer() 46, 60, 64, 85
 SimpleInitialize() 46, 52, 54, 60,
 64, 85
 solveLP 18, 22
 solveQP 18, 22

U

upc 25
 useSolveQP.cc 29

W

WINAPI の利用 71

え

エラーコード 28

き

擬コスト (upc, dpc) 25

く

クラスの呼び出し
 main.cpp 47

こ

混合整数線形計画問題 18

し

準連続変数 24
 上下限 18, 22

せ

整数変数 24
 線形計画問題 18, 29

と

等式制約 23
 ドライバ 57, 62

な

ナップサック問題 5

に

二次計画問題 29

は

バイナリ変数 24
 パラメータ
 NUOPT の動作を制御する～ 101
 一覧 101
 求解制御の～ 22
 分枝する方向の～ 25

ふ

プロジェクト dll 67
 分枝優先順位 (pri) 25
 分枝優先方向 (dir) 25

め

メイクファイル 85

よ

抑制

NUOPT 出力の～ 37

解ファイル solver.sol の～ 37

ら

ランタイムライブラリ 107, 109

れ

連続変数 24