

УДК 681.324

П.Е. Пустовойтов

Национальный технический университет «ХПИ», Харьков

ЭРЛАНГОВСКАЯ АППРОКСИМАЦИЯ САМОПОДОБНОГО СЛУЧАЙНОГО ПОТОКА С ЗАДАНЫМИ СВОЙСТВАМИ

В работе предлагается процедура формирования самоподобного потока на основе закона распределения Эрланга. Проведено исследование качества формирования самоподобного потока, доказывающее правильность работы процедуры.

Ключевые слова: компьютерные сети, математическое моделирование, имитационное моделирование, оптимизация, самоподобие, фракталы.

Введение

Специфические особенности трафика с медленно затухающим распределением длин пакетов и интервалов между ними негативно сказывается на качестве функционирования узла компьютерной сети [1]. Высокая дисперсия такого распределения приводит к крайней изменчивости и непостоянству нагрузки. Кроме того, как отмечено в [2], суперпозиция самоподобных потоков не приводит к пуассоновости результирующего потока, что является прямым следствием наличия последствия в составляющих суммарного потока. Это, в частности, приводит к тому, что традиционно используемые соотношения теории массового обслуживания, полученные на основе допущения об экспоненциальности входящего потока, оказываются неверными для самоподобных потоков. Это обстоятельство вызывает необходимость использования для оценки эффективности систем, на вход которых поступает самоподобный поток, имитационных моделей. В связи с этим рассмотрим процедуру формирования самоподобного потока на основе распределения Эрланга n -го порядка и оценим качество формирования самоподобного потока.

Постановка задачи. При рассмотрении самоподобных процессов с формальных позиций вводится параметр Херста – $H \in (0.5 < H < 1)$ [3]. С учетом этого параметра случайный процесс $X(t)$ называется статистически самоподобным с параметром H , если для любого вещественного $a > 0$ процесс $a^{-H}X(at)$ обладает теми же статистическими характеристиками, что и процесс $X(t)$, т.е. имеют место равенства средних, дисперсий, автокорреляционных функций.

Характерной чертой самоподобного процесса является долгосрочная зависимость процесса, наблюдаемого на каком-либо интервале, от значений этого процесса на предыдущих интервалах. Эта зависимость проявляется в более медленном убывании значений автокорреляционной функции такого процесса по сравнению с процессами, для которых имеет место краткосрочная зависимость.

Нормированная автокорреляционная функция для самоподобного процесса описывается выражением

$$r_x(\tau) = (1 + \tau)^{-\beta/2}, \quad (1)$$

где показатель степени β связан с параметром Херста H следующим соотношением:

$$\beta = 2(1 - H). \quad (2)$$

Тогда
$$r(\tau) = (1 + \tau)^{-(1-H)}. \quad (3)$$

Для несамоподобного процесса $H = 0.5$ и $\beta = 1$. При наличии самоподобия параметр $H > 0.5$.

Плотность распределения длины интервала между событиями для потока Эрланга n -порядка имеет вид

$$f_n(x) = \frac{\lambda^n x^{n-1}}{(n-1)!} e^{-\lambda x}, \quad x > 0. \quad (4)$$

Наличие степенного множителя в описании плотности (4) приводит к замедлению ее убывания и появлению типичного для самоподобных процессов «тяжелого» хвоста.

В [4] отмечается, что наличие тяжелого хвоста является основной причиной долгосрочной зависимости и самоподобия сетевого трафика. Так как эрланговский поток представляет собой просеянный пуассоновский поток, то для получения потока Эрланга, например, 2-го порядка интенсивностью λ достаточно сформировать пуассоновский поток интенсивностью 2λ и извлечь из этого потока каждое четное событие.

Перейдем к описанию второго принципиально го свойства самоподобного потока – последствия. В соответствии с (1) для заданного значения параметра Херста H могут быть рассчитаны коэффициенты корреляции между случайными длинами межсобытийных интервалов. Тогда задача формирования потока с заданным показателем самоподобия H заключается в следующем: получить последовательность случайных величин с плотностью распределения Эрланга заданного порядка, коррелированных в соответствии с корреляционной матрицей $K = \{k_{ij}\}$, элементы которой определяются корреляционной функцией (1).

Основные результаты

Пусть последовательность случайных величин $\xi_1, \xi_2, \dots, \xi_n$ имеет плотность распределения Эрланга заданного (например, второго) порядка. Теперь искомым последовательность x_1, x_2, \dots, x_n случайных величин с тем же математическим ожиданием (например, равным a), но коррелированных в соответствии с матрицей $\{k_{ij}\}$ получим с использованием линейного преобразования

$$\begin{aligned} x_1 &= c_{11}(\xi_1 - a) + a, \\ x_2 &= c_{12}(\xi_1 - a) + c_{22}(\xi_2 - a) + a, \\ x_3 &= c_{13}(\xi_1 - a) + c_{23}(\xi_2 - a) + c_{33}(\xi_3 - a) + a, \end{aligned} \quad (5)$$

$$x_n = c_{1n}(\xi_1 - a) + c_{2n}(\xi_2 - a) + \dots + c_{nn}(\xi_n - a) + a.$$

Коэффициенты преобразования (5) отыскиваются по формуле [5]:

$$c_{ij} = \frac{\left(\frac{k_{ij}}{a^2} - c_{1i}c_{1j} - c_{2i}c_{2j} - \dots - c_{i-1,i}c_{i-1,j} \right)}{c_{ii}}, \quad j > i.$$

Подстановка полученных значений c_{ij} , $i = 1, 2, \dots, n$, $j \geq i$, в (5) позволяет рассчитать искомый набор коррелированных случайных величин.

Более простая схема получения коррелированной последовательности случайных величин соответствует ситуации, когда учитывается только корреляция между соседними элементами последовательности [5].

Пусть по-прежнему, в качестве базовой используется некоррелированная последовательность случайных величин $\xi_1, \xi_2, \dots, \xi_n$, имеющая плотность распределения Эрланга заданного порядка. Эта последовательность формируется путем просеивания последовательности случайных величин с пуассоновским распределением.

Пусть

$$M[\xi_j] = a, \quad M[\xi_j - a]^2 = D.$$

Зададим требуемое значение коэффициента корреляции k между соседними элементами формируемой последовательности. Искомую коррелированную последовательность получим по формулам

$$\begin{aligned} \zeta_1 &= \xi_1, \\ \zeta_2 &= c_{12} \xi_1 - a + c_{22} \xi_2 - a + a, \\ \zeta_3 &= c_{23} \xi_2 - a + c_{33} \xi_3 - a + a, \\ &\dots \\ \zeta_j &= c_{j-1,j} \xi_{j-1} - a + c_{jj} \xi_j - a + a, \\ \zeta_{j+1} &= c_{j,j+1} \xi_j - a + c_{j+1,j+1} \xi_{j+1} - a + a. \end{aligned} \quad (6)$$

Коэффициенты преобразования имеют следующий вид [5]:

$$\begin{aligned} C_{12} &= k, & C_{22} &= 1 - C_{12}^2 \quad 1/2, \\ C_{23} &= \frac{k}{C_{22}}, & C_{33} &= 1 - C_{23}^2 \quad 1/2, \\ &\dots & & \dots \\ C_{j,j+1} &= \frac{k}{C_{jj}}, & C_{j+1,j+1} &= 1 - C_{j,j+1}^2 \quad 1/2. \end{aligned} \quad (7)$$

С использованием этих соотношений построим последовательность случайных величин ζ_1, ζ_2, \dots

Проверка качества получаемой коррелированной последовательности случайных величин осуществляется следующим образом. Пусть задан набор элементов последовательности x_1, x_2, \dots, x_n . Рассчитаем эмпирические значения для среднего и дисперсии:

$$m = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^n x_j, \quad S_n^2 = \frac{1}{n-1} \sum_{j=1}^n (x_j - m)^2.$$

Кроме того, для каждого j определяем интегральное отклонение

$$D_j = \sum_{k=1}^j x_k - jm.$$

Теперь оценим уровень изменчивости заданной случайной последовательности длиной n как

$$R_n = \max_j D_j - \min_j D_j.$$

В [3] было показано, что для самоподобных процессов имеет место соотношение

$$\frac{R_n}{S_n} \cong \left(\frac{n}{2} \right)^H, \quad (8)$$

где H – параметр самоподобия.

Из (8) следует

$$\log \frac{R_n}{S_n} \cong H \log \left(\frac{n}{2} \right). \quad (9)$$

Соотношение (9) позволяет приближенно оценить значение параметра Херста для любой последовательности случайных величин. С целью использования (9) для возрастающей последовательности n_1, \dots, n_p наборов случайных величин рассчитаем

соответствующие значения $\frac{R_{n_1}}{S_{n_1}}, \dots, \frac{R_{n_p}}{S_{n_p}}$. Тогда наилучшая в смысле наименьших квадратов оценка параметра H определяется путем минимизации

$$J = \sum_{\ell=1}^p \left(\log \frac{R_{n_\ell}}{S_{n_\ell}} - H \log \frac{n_\ell}{2} \right)^2,$$

$$\text{откуда} \quad \frac{dJ}{dH} = -2 \sum_{\ell=1}^p \left(\log \frac{R_{n_\ell}}{S_{n_\ell}} - H \log \frac{n_\ell}{2} \right) = 0$$

$$\text{и} \quad \hat{H} = \frac{\sum_{\ell=1}^p \log \frac{R_{n_\ell}}{S_{n_\ell}} \cdot \log \prod_{\ell=1}^p \frac{R_{n_\ell}}{S_{n_\ell}}}{\sum_{\ell=1}^p \log \frac{n_\ell}{2} \cdot \log \prod_{\ell=1}^p \frac{n_\ell}{2}}. \quad (10)$$

В конкретному експерименті формувались послідовності коррелиованих випадкових величин з заданими значеннями $H_1 = 0.65$, $H_2 = 0.8$. При цьому внаслідок просеивання пуассоновського потоку з заданою інтенсивністю формувалася набір випадкових величин $\xi_1, \xi_2, \xi_3, \dots$, розподілених в відповідності з законом Ерланга другого порядку. Далі з використанням (6), (7) здійснюється побудова самоподібних потоків з коефіцієнтом кореляції, котрі розраховувалися по формулі (3). Результати експеримента: $\hat{H}_1 = 0.62$, $\hat{H}_2 = 0.77$.

Більш точні значення параметра Херста можна отримати, якщо побудувати графік залежності $\log R_{n_\ell} / S_{n_\ell}$ від $\log n_\ell / 2$, апроксимувати його прямою і оцінити тангенс кута її нахилу.

Результати експеримента приведені на графіках (рис. 1).

Очевидно, що отримані в експерименті значення тангенса кута нахилу прямої, апроксимуючої залежність $\ln R_{n_\ell} / S_{n_\ell}$ від $\ln N_\ell / 2$, близькі до вихідних значень. Таким чином, робоспособність запропонованої процедури формування самоподібної послідовності з заданим параметром Херста підтверджена.

Висновки

При побудові імітаційних моделей комп'ютерних мереж необхідно враховувати властивість самоподібності в реальному мережевому трафіку. При виборі закону розподілу для опису потоків пакетів в мережі необхідно враховувати той факт, що він повинен мати довгий повільно затухаючий хвіст. В роботі пропонується процедура генерації самоподібного потоку з заданим значенням параметра H на основі закону розподілу Ерланга n -го порядку.

Приведені приклади генерації, побудовані графіки, що доводять правильність роботи процедури.

ЕРЛАНГІВСЬКА АПРОКСИМАЦІЯ САМОПОДІБНОГО ВИПАДКОВОГО ПОТОКУ ІЗ ЗАДАНИМИ ВЛАСТИВОСТЯМИ

П.С. Пустовойтов

У роботі запропоновано процедуру формування самоподібного потоку на основі закону розподілу Ерлангу. Проведено дослідження якості формування самоподібного потоку, що доводить вірність роботи процедури.

Ключові слова: комп'ютерні мережі, математичне моделювання, імітаційне моделювання, оптимізація, самоподібність, фрактали.

ERLANG APPROXIMATION OF SELF-SIMILARITY FLOWING FORMATION WITH ASSIGNED PROPERTIES

P.E. Pustovoitov

It was suggested the procedure of self-similarity flowing formation based on Erlang distribution law. It was researched a quality of self-similarity flowing formation, which proves a procedure accuracy.

Keywords: computer networks, mathematical design, imitation design, optimization, self-similarity, fractals.

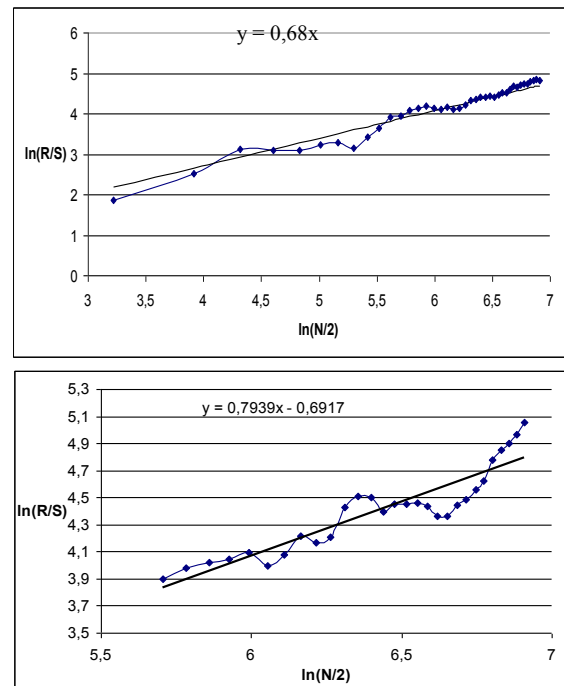


Рис. 1. Результати експеримента

Список литературы

1. Вишневикий В.М. Теоретические основы проектирования компьютерных сетей / В.М. Вишневикий. – М.: Техносфера, 2003. – 512 с.
2. Вентцель Е.С. Теория вероятностей: Учеб. для вузов / Е.С. Вентцель. – М.: Высш. шк., 1999. – 576 с.
3. Hurst H. Long-term Storage. An Experimental Study / H. Hurst, R. Black, Y. Simaika. – London: Coustable, 1965. – 184 p.
4. Шелухин О.И. Фрактальные процессы в телекоммуникациях: монография / О.И. Шелухин, А.М. Тенякиев, А.В. Осин; под ред. О.И. Шелухина. – М.: Радиотехника, 2003. – 480 с.
5. Пустовойтов П.Е. Формирование самоподобного случайного процесса с заданными свойствами / П.Е. Пустовойтов, Н.И. Яцук // Системи обробки інформації. – Х.: Харківський університет Повітряних Сил, 2009. – Вип. 3(77). – С. 81-85.

Поступила в редколлегию 15.06.2010

Рецензент: д-р техн. наук, проф. Л.Г. Раскин, Национальный технический университет «Харьковский политехнический институт», Харьков.