

TECHNISCHE UNIVERSITÄT DRESDEN

ZENTRUM FÜR INFORMATIONSDIENSTE
UND HOCHLEISTUNGSRECHNEN
PROF. DR. WOLFGANG E. NAGEL

Belegarbeit Computational Science and Engineering
Verteilte GPGPU-Berechnungen mit Spark

Maximilian Knespel

Hochschullehrer: Prof. Dr. Wolfgang E. Nagel
Betreuer: Dipl.-Inf. Nico Hoffmann

Dresden,

Inhaltsverzeichnis

1	Einführung	2
2	Apache Spark	3
2.1	MapReduce	4
2.2	Architektur	5
2.3	Konfiguration von Spark auf einem Slurm-Cluster	6
3	Rootbeer	7
4	Eigene Implementierung	10
4.1	Kompilierung	10
4.2	Probleme	10
5	Leistungsanalyse	12
5.1	Rechenintensiver Testalgorithmus	12
5.1.1	Monte-Carlo Algorithmen	12
5.1.2	Berechnung von Pi	12
5.2	Testsysteme	14
5.2.1	System 1: Heimsystem	14
5.2.2	System 2: Taurus	15
5.3	Monte-Carlo-Simulation verschiedener Implementationen	17
5.4	Monte-Carlo-Simulation mit Spark + Rootbeer	18
6	Zusammenfassung	21
	Literaturverzeichnis	22
A	Standardabweichung des Mittelwertes	25

1 Einführung

Im Rahmen dieser Belegarbeit soll ein Ansatz entwickelt werden, der es ermöglicht mit Java oder Scala auf heterogenen Clustersystemen mit Grafikkarten zu rechnen. Es wurde sich für eine Kombination aus Spark für die Kommunikation im Cluster und Rootbeer für die Grafikkartenprogrammierung entschieden.

Spark vereinfacht die ausfallsichere Programmierung von Clustern mittels des Map-Reduce-Programmiermodells und stellt zahlreiche Bibliotheken z.B. für Graphenalgorithmen und statistische Analysen zur Verfügung.

Für Rootbeer wurde sich entschieden, weil es das Schreiben von CUDA-Kernels aus Java heraus erlaubt. Die so geschriebenen Kernel-Funktionen können dann sowohl auf Grafikkarten als auch auf dem Host ausgeführt werden.

Zuerst werden in den Kapiteln 2 und 3 die benutzten Frameworks genauer vorgestellt, in Kapitel 4 wird auf die eigene Implementierung eingegangen und in Kapitel 5 werden Benchmarks, die mit dieser Implementierung angefertigt wurden, ausgewertet.

2 Apache Spark

Spark ist ein Programmierframework für Datenanalyse auf Clustern, was vor allem im Zusammenhang mit "Big Data" an Beliebtheit gewonnen hat. Es vereinigt hierbei ausfallgehärtete Funktionalitäten von Batchverarbeitungssystemen bzw. Cluster-Management wie z.B. SLURM, Kommunikation zwischen Prozessen, wie z.B. OpenMPI und OpenMP sie zur Verfügung stellen, und zusätzliche problemspezifische Programmierbibliotheken. Spark stellt Programmierschnittstellen für Java, Scala und Python zur Verfügung. Für Scala und Python existieren interaktive Eingabeaufforderungen mit der z.B. interaktive Echtzeitanalysen auf Clustern mit Spark möglich sind.

Apache Spark oder auch Spark Core stellt die Grundfunktionalität für verteiltes Rechnen bereit. Das inkludiert die erwähnte Ausfallsicherheit, Management von Knoten über ein Web-Interface und Prozess-Scheduling[16]. Die Programmierschnittstelle hierfür sind der Spark-Kontext und die Resilient Distributed Datasets (RDD).

Beispielhaft für den Spark-Stack seien hier die Bibliotheken MLlib[2] und GraphX erwähnt.

MLlib, kurz für Machine Learning Library, umfasst Funktionen wie lineare Regression, den K-Means-Algorithmus, Latent Dirichlet Allocation, Hauptkomponentenanalyse, das für Maschinennlernen benötigte stochastische Gradientenverfahren, u.v.m.

GraphX erweitert Spark-RDDs zu Kanten- und Knoten-RDDs die als Tupel einen Graph beschreiben [4]. Auf diesen abgeleiteten Datentypen sind übliche RDD- und Mengenoperationen wie `subgraph`, `diff`, u.a. für das Erstellen und Modifizieren von Graphen möglich. Ein solcher Graph kann z.B. Webseitenrelationen, jeder Link ist eine Kante im Graph, jede Domain ein Knoten, darstellen. Auf diesen Graphen sind Algorithmen wie PageRank oder das Auszählen von Dreiecken in Graphen ausführbar.

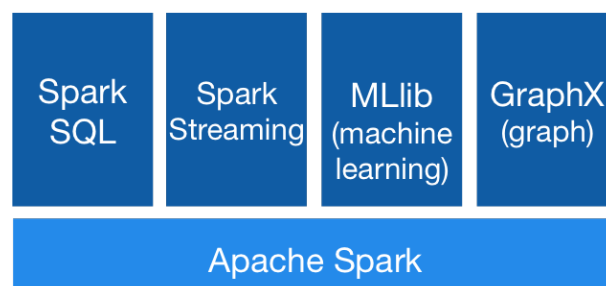


Abbildung 2.1: Zusammensetzung des Spark-Frameworks[3]

2.1 MapReduce

Spark basiert auf dem MapReduce-Paradigma, welches 2004 in einem Paper der Google-Mitarbeiter Dean und Ghemawat[12, 13] in Anlehnung an die aus funktionalen Programmiersprachen bekannten Map- und Reduce-Befehle eingeführt wurden. Viele der benötigten Algorithmen wie Häufigkeitsanalyse oder Webseitengraphen hatten zuvor ihren eigenen Programmcode für die Kommunikation und Ausfallsicherheit im Cluster und folgten von der Struktur her einem simplen Schema: zuerst werden Eingabedaten datenparallel verarbeitet und anschließend werden die Zwischenergebnisse zu Endergebnissen reduziert. Diese einfach gestrickten Algorithmen mussten aber trotzdem auf beträchtlichen Datenmengen auf Knoten hoher Ausfallwahrscheinlichkeit laufen. Diese Funktionalität, also die Kommunikation im Cluster und die Ausfallsicherheit, wurde so in eine MapReduce-Bibliothek ausgelagert.

MapReduce bezeichnet hierbei sowohl das Programmierparadigma als auch die Bibliothek, die diese ausfallsicher und parallelisiert zur Verfügung stellt. Dafür definiert der Nutzer eine Map-Funktion die aus einer Liste jedes Schlüssel-Wert-Paar (k, v) auf eine Liste aus neuen Schlüssel-Wert-Paaren abbildet:

$$\mathbf{Map} : (k, v) \mapsto [(l_1, x_1), \dots, (l_{r_k}, x_{r_k})] \quad (2.1)$$

k und l sind hierbei die Schlüssel und v und x die dazugehörigen Werte. Für $r_k = 1$ erhält man den Grenzfall, dass jeder Schlüssel-Wert-Tupel auf exakt einen neuen Schlüssel-Wert-Tupel abgebildet wird.

Da es per Definition keine Abhängigkeiten zu anderen Schlüssel-Wert-Paaren für die Berechnung der Map-Funktion gibt, kann jedes Datum parallel berechnet werden. Das MapReduce-Framework stellt außerdem Funktionen zum Einlesen von Daten zur Verfügung und verteilt diese automatisch an die Knoten des Clusters, wo diese dann parallel verarbeitet werden.

In einem impliziten Shuffle-Schritt werden alle Paare mit gleichem Schlüssel lokal gruppiert, d.h. es werden alle Paare z.B. mit Schlüssel $k_1 = \text{'Dresden'}$ auf dem gleichen Knoten im Cluster gesammelt. Dieser Schritt kann also sehr kommunikationsaufwendig sein. Der Nutzer kann nur über die Art der Schlüssel auf diesen Prozess Einfluss nehmen. Man erhält als Ergebnis des Shuffle-Schritts einen Tupel aus einem Schlüssel und einer Liste an dazugehörigen Werten.

$$\mathbf{Shuffle} : [(k_1, x_1), \dots, (k_n, x_n)] \mapsto \left[\left(l_1, [y_1^1, \dots, y_{r_1}^1] \right), \dots, \left(l_m, [y_1^m, \dots, y_{r_m}^m] \right) \right] \quad (2.2)$$

Im nachfolgenden Reduce Schritt werden die Tupel aus Schlüssel und Werteliste mit einer vom Nutzer definierten Reduce-Funktion abgebildet auf eine neue Werteliste. Im einfachsten Fall kann die neue Werteliste nur ein Element enthalten, z.B. die Summe oder den Mittelwert der alten Werte.

$$\mathbf{Reduce} : (l, [y_1, \dots, y_{s_l}]) \mapsto [w_1, \dots, w_{m_l}] \quad (2.3)$$

Auch die Reduce-Operation kann also bezüglich einzigartiger Schlüssel datenparallel ausgeführt werden. Anfangs war dieses Paradigma nur für einfache Beispiele wie Wortfrequenzanalysen gedacht, aber mittlerweile wurden auch komplexere Algorithmen wie z.B. Matrixmultiplikation[26] oder das Problem des Finden einer maximalen Überdeckung[6] ins MapReduce-Schema portiert.

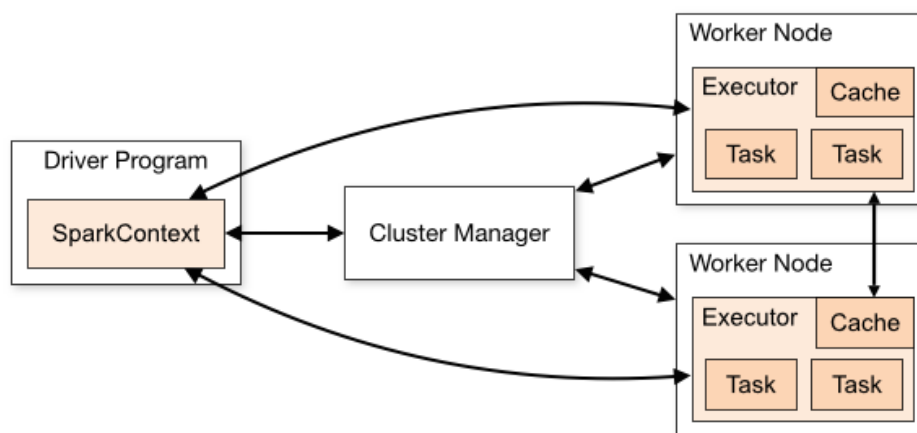


Abbildung 2.2: Master/Slave-Struktur eines Spark-Clusters[3]

Eine lange Zeit beliebte Implementation basierend auf dem MapReduce-Paper[12] ist Apache Hadoop[1]. Hadoop besteht aus einem verteilten Dateisystem, dem Hadoop Distributed File System (HDFS), und einer Bibliothek namens MapReduce, die Funktionen für das Rechnen auf den verteilten Daten anbietet.

Apache Spark[3] ist eine alternative Implementation des MapReduce-Modells. Es versucht viele der Probleme von Hadoop zu beheben, bietet jedoch neben dem Zugriff vom lokalen Dateisystem auch den Zugriff von HDFS und weiteren verteilten Dateisystemen an.

Einer der Hauptvorteile von Spark ist der Geschwindigkeitsgewinn bei der iterativen Anwendung von Map und Reduce durch die Möglichkeit die Daten auch im Arbeitsspeicher, nicht nur auf der Festplatte, der Knoten zwischenspeichern.

2.2 Architektur

Für kleinere Tests kann Spark local auf einem Computer bzw. Knoten ausgeführt werden:

```
spark-shell --master local[*]
```

In diesem Beispielaufwurf der interaktiven Spark-Shell werden so viele Threads genutzt wie es logische Kerne gibt.

Für das Ausführen auf einem Cluster ist jedoch das getrennte Starten von einem Spark Driver (Master) und mindestens einem Executor (Slave, Worker) notwendig, vgl. Abb. 2.2. Der Spark-Driver führt das geschriebene Spark-Programm aus und verteilt u.a. die für die Map-Funktion benötigten Daten an die Executoren, welche die zugewiesenen Berechnungen dann durchführen.

Jeder Executor wird in einer eigenen Java Virtual Machine (JVM), also einem eigenen Prozess ausgeführt. Normalerweise, und so auch hier, wird für jeden Knoten ein Executor-Prozess gestartet, welcher mit der in der `SPARK_WORKER_CORES`-Umgebungsvariable definierten Anzahl an Threads arbeitet. Für den hier vorgestellten Benchmark wird `$SPARK_WORKER_CORES` identisch der Anzahl an Grafikkarten auf dem Knoten gewählt, sodass jeder Thread mit genau einer Grafikkarte arbeitet.

Ein RDD kann z.B. mit `parallelize` erstellt werden [5].



```
val distData = sc.parallelize( 1 to 10, 5 )
```

In diesem Beispiel wurden die Zahlen 1 bis 10 in ein RDD geladen. Das zweite Argument gibt die Anzahl an Partitionen an, die das RDD nutzen soll. Hier werden die Daten also in 5 Partitionen, in älteren Versionen von Spark auch Slices genannt, aufgeteilt. Eine Partition ist wie ein Task zu verstehen, der von einem der Executoren ausgeführt wird. Die Anzahl an Partitionen gibt damit eine Obergrenze für die Parallelisierbarkeit vor. Um Gebrauch von einer optimalen Lastverteilung zu machen sollte man eine Größenordnung mehr Partitionen haben, als die Sparkinstanz logische Kerne bzw. Threads zur Verfügung hat.

2.3 Konfiguration von Spark auf einem Slurm-Cluster

Viele Cluster stellen schon einen Task-Scheduler für Multinutzerumgebungen, wie z.B. PBS (Portable Batch System) oder SLURM (Simple Linux Utility for Resource Management), zur Verfügung, um Rechenzeit auf dem Cluster möglichst effizient und gerecht zu verteilen. Außerdem ermöglichen sie das verteilte Starten von Programmen, z.B. jene die mit MPI programmiert wurden. Der für die Benchmarks genutzte Cluster, siehe Kapitel 5.2.2, arbeitet mit SLURM.

Um Spark nutzen zu können, müssen zuerst Master- und Slave-Knoten gestartet werden. Damit alle gleichzeitig gestartet werden, sollten sie innerhalb desselben Jobs initiiert werden. Dies z.B. mit SLURMs `--multi-prog` Option realisiert werden. Diese erwartet als Argument einen Pfad zu einer Konfigurationsdatei, in der für jeden Rang ein möglicherweise anderes auszuführendes Programm angegeben ist.

Alternativ kann man auch anhand von der Umgebungsvariable `SLURM_PROCID` im Skript entweder einen Master-Knoten oder einen Slave-Knoten starten. Diese Möglichkeit wurde aufgrund der Übersichtlichkeit, weil damit alle Funktionalitäten in einem Skript vereint werden können, gewählt, siehe `startSpark.sh`  und `common/start_spark_slurm.sh`  [17].

Auf dem Master-Knoten wird der Spark Driver mit

```
1 "$SPARK_ROOT/bin/spark-class" org.apache.spark.deploy.master.Master \
2   --ip $(hostname) --port 7077 --webui-port 8080 &
```

gestartet. Alle anderen Knoten starten einen Executor-Prozess mit:

```
1 "$SPARK_ROOT/bin/spark-class" org.apache.spark.deploy.worker.Worker \
2   spark://$(scontrol show hostname $SLURM_NODELIST | head -n 1):7077
```

Hierbei wird vorausgesetzt, dass der Masterknoten, also jener für den `$SLURM_PROCID=0` ist, der erste Knoten in `$SLURM_NODELIST` ist. Dies wurde per assert vom Masterknoten aus auch geprüft und ist bei keinem der rund 50 Versuche fehlgeschlagen.

Wenn Spark gestartet ist, kann sich z.B. mit einer aktiven Eingabeaufforderung an den Master verbunden werden:

```
1 export MASTER_ADDRESS=spark://$MASTER_IP:7077
2 spark-shell --master=$MASTER_ADDRESS
```

Die Umgebungsvariable `MASTER_ADDRESS` wird automatisch vom `startSpark.sh`-Skript [17] gesetzt.

3 Rootbeer

Rootbeer[25] ist ein von Philip C. Pratt-Szeliga entwickeltes Programm und Bibliothek welches das Schreiben von CUDA-Kerneln in Java erleichtert. Zum aktuellen Zeitpunkt Mai 2016 hat Rootbeer leider noch Beta-Status und wurde seit ca. einem Jahr nicht weiterentwickelt[22].

Mit Rootbeer lassen sich CUDA-Kernel direkt in Java schreiben anstatt in C/C++. Dafür muss zuerst vom Nutzer die `org.trifort.rootbeer.runtime.Kernel`-Klasse implementiert und zu einer Java class-Datei kompiliert werden. Wenn das komplette zu schreibende Programm zu einer jar-Datei zusammengefügt wurde, dann muss diese noch einmal an den Rootbeer-Compiler übergeben werden. Rootbeer nutzt Soot[15, 18], um den Bytecode in Jimple zu übersetzen. Jimple ist eine vereinfachte Zwischendarstellung von Java-Bytecode, welcher ca. 200 verschiedene Befehle besitzt, in Drei-Address-Code mit nur 15 Befehlen. Der Jimple-Code wird dann analysiert und in CUDA übersetzt welcher dann mit einem installierten NVIDIA-Compiler übersetzt wird. All das geschieht automatisch, aber die Zwischenschritte kann man zur Fehlersuche unter Linux in `$HOME/.rootbeer/` einsehen. Die erstellte cubin-Datei wird zusammen mit `Rootbeer.jar` der jar-Datei des selbstgeschriebenen Programms hinzugefügt.

Die zweite große Vereinfachung, die Rootbeer zur Verfügung stellt, ist die Automatisierung des Datentransfers zwischen GPU und CPU. Das besondere hierbei ist, dass Rootbeer die Nutzung von beliebigen, also insbesondere auch nicht-primitiven Datentypen erlaubt. Diese Datentypen serialisiert Rootbeer automatisch und unter Nutzung aller CPU-Kerne und transferiert sie danach auf die Grafikkarte.

Diese zwei Vereinfachungen obig machen die erste Nutzung von Rootbeer verglichen zu anderen Lösungen sehr einfach, sodass Rootbeer insbesondere für das Erstellen von Prototypen günstig ist. In Kontrast dazu ist es jedoch auch mögliche wiederum sehr nah an der Grafikkarte zu programmieren. Dafür kann man mit Rootbeer auch manuell die Kernel-Konfiguration angeben, mehrere GPUs ansprechen und auch shared memory nutzen.

Für die Nutzung von Rootbeer unter Debian-Derivaten ist das `openjdk-7-jdk`-Paket und das `nvidia-cuda-toolkit`-Paket notwendig. Leider funktioniert Rootbeer nicht mit JDK 8. JDK 7 funktioniert vollends in den hier durchgeführten Beispielen, aber volle Unterstützung ist bisher nur für JDK 6 offiziell gegeben[23].

Ein Minimalbeispiel für einen Kernel, dessen Threads nur ihre ID in einen Array schreiben sieht wie folgt aus:

```
1 import org.trifort.rootbeer.runtime.Kernel;
2 import org.trifort.rootbeer.runtime.RootbeerGpu;
3
4 public class ThreadIDsKernel implements Kernel
5 {
6     private int miLinearThreadId;
7     private long[] mResults;
```



```

8      /* Constructor which stores thread arguments: seed, diceRolls */
9      public ThreadIDsKernel( int riLinearThreadId, long[] rResults )
10     {
11         miLinearThreadId = riLinearThreadId;
12         mResults          = rResults;
13     }
14     public void gpuMethod()
15     {
16         mResults[ miLinearThreadId ] = RootbeerGpu.getThreadId();
17     }
18 }

```

minimal/ThreadIDsKernel.java

Der Aufruf der Kernels geschieht über eine Liste von Kernel-Objekten, die per Konstruktor mit Parametern initialisiert wurden. Diese Liste wird an `rootbeer.run` übergeben, der den Kernel dann mit einer passenden Konfiguration startet.

```

1 import java.io.*;
2 import java.util.List;
3 import java.util.ArrayList;
4 import org.trifort.rootbeer.runtime.Kernel;
5 import org.trifort.rootbeer.runtime.Rootbeer;
6
7 public class ThreadIDs
8 {
9     /* prepares Rootbeer kernels and starts them */
10    public static void main( String[] args )
11    {
12        final int nKernels = 3000;
13        long[] results = new long[nKernels];
14        /* List of kernels / threads we want to run in this Level */
15        List<Kernel> tasks = new ArrayList<Kernel>();
16        for ( int i = 0; i < nKernels; ++i )
17        {
18            results[i] = 0;
19            tasks.add( new ThreadIDsKernel( i, results ) );
20        }
21        Rootbeer rootbeer = new Rootbeer();
22        rootbeer.run(tasks);
23        System.out.println( results[0] );
24    }
25 }

```

minimal/ThreadIDs.java

Zuerst müssen diese beiden Dateien mit ‘javac‘ kompiliert werden und dann zusammen mit einer ‘manifest.txt‘-Datei, die die Einsprungsklasse anzeigt, zu einem Java-Archiv gepackt werden, welches im letzten Schritt mit Rootbeer kompiliert und dann ausgeführt wird.

```

1 javac ThreadIDsKernel.java -classpath "$ROOTBEER_ROOT/Rootbeer.jar:." &&
2 javac ThreadIDs.java      -classpath "$ROOTBEER_ROOT/Rootbeer.jar:." &&
3 cat > manifest.txt <<EOF
4 Main-Class: ThreadIDs

```

```

5 Class-Path: .
6 EOF
7 jar -cvfm preRootbeer.tmp.jar manifest.txt ThreadIDsKernel.class ThreadIDs.class
  &&
8 java -jar "$ROOTBEER_ROOT/Rootbeer.jar" preRootbeer.tmp.jar ThreadIDs.jar -64bit
  &&
9 java -jar ThreadIDs.jar

minimal/compile.sh

```

Bei der Kompilierung mit `Rootbeer.jar` muss beachtet werden, dass alle benutzten Klassen mit in der jar-Datei enthalten sind, sonst quittiert Soot mit folgender Fehlermeldung:

```
1 java.lang.RuntimeException: cannot get resident body for phantom class
```

Bei Nutzung von `scala` heißt das insbesondere, dass `scala.jar` mit in das Java-Archiv gepackt werden muss.

Weiterhin ist zu beachten, dass die an Rootbeer/Soot übergebene Datei entgegen der Linux-Ideologie mit `.jar` enden muss, insbesondere führen Dateinamen wie `gpu.jar.tmp` zu der Fehlermeldung

```

1 There are no kernel classes. Please implement the following interface to use
  rootbeer:
2 org.trifort.runtime.Kernel

```

Bei der Benutzung von Rootbeer, kam es leider zu einigen Bugs, die teilweise in einem geforkten Repository auf Github behoben wurden, siehe [24]. Das wichtigste Problem sei hier kurz vorgestellt.

Auf dem benutzten Cluster ist das von Rootbeer automatisch benutzte Arbeitsverzeichnis über alle Knoten geteilt. Dies führt zu einem Problem, wenn man Rootbeer auf verschiedenen Nodes oder von verschiedenen Threads aus nutzen möchte, da bei einem Kernel-Aufruf `~/rootbeer/rootbeer_cuda_x64.so.1` aus der jar-Datei extrahiert wird. Wenn also ein Thread meint die Datei fertig entpackt zu haben, während ein anderer Thread die Datei nochmal entpackt, aber noch nicht fertig ist, dann kann ein `java.lang.UnsatisfiedLinkError` auftreten. Dies wurde behoben, indem ein Pfad aus Hostname, Prozess-ID und Datum genutzt wird:

```

1 m_rootbeerhome = home + File.separator + ".rootbeer" + File.separator
2                 + getHostname() + File.separator
3                 + getProcessId("pid") + "-" + System.nanoTime()
4                 + File.separator;

```

Dies resultiert z.B. in diesen Pfad: `~/rootbeer/taurus2093/7227-311934180383710/`.

4 implementation

4.0.1 Rechenintensiver Testalgorithmus

Monte-Carlo-Algorithmen sind Algorithmen, die mit Hilfe von (Pseudo-)Zufallszahlen das gesuchte Ergebnis statistisch approximieren. Dafür werden Stichproben aus statistischen Verteilungen durch z.B. physikalisch begründete Abbildungen transformiert und jene Ergebnisse statistisch ausgewertet. Diese Art von Verfahren eignet sich z.B. zur Berechnung von sehr hochdimensionalen Integralen, die mit üblichen Newton-Cotes-Formeln nicht praktikabel wären. Eine andere Anwendung ist die Analyse von durch kosmischer Strahlung ausgelösten Teilchenschauern mit Hilfe von Markov-Ketten[21].

Monte-Carlo-Algorithmen sind als statistische Stichprobenverfahren schon länger bekannt, wurden aber erst mit dem Aufkommen der ersten Computer, z.B. dem ENIAC um 1947-1949, praktikabel[20]. Der Name, nach der Spielbank "Monte-Carlo", wurde von N. Metropolis vorgeschlagen und hielt sich seitdem. Der Vorschlag zu dieser Art von Algorithmus kam von John von Neumann auf, als man mit dem ENIAC thermonukleare Reaktionen simulieren wollte. Aber Fermi wird nachgesagt schon Jahre zuvor statistische Stichprobenverfahren in schaflosen Nächten händisch angewandt zu haben und mit den überraschend genauen Resultaten seine Kollegen in Staunen zu versetzen.

Monte-Carlo-Verfahren sind inhärent leicht zu parallelisieren, da eine Operation, die Simulation, mehrere Tausend oder Milliarden Mal ausgeführt wird. Eine Schwierigkeit besteht jedoch darin den Pseudozufallszahlengenerator (pseudorandom number generator - PRNG) korrekt zu parallelisieren. Das heißt vor allem muss man unabhängige Startwerte finden und an die parallelen Prozesse verteilen. - Zeitangaben sind hierbei nicht sinnvoll. Das betrifft alle möglichen Zeitgeber in Rechnern wie z.B. .

4.0.2 Berechnung von Pi

Um Pi zu berechnen wird Pi als Integral dargestellt, da sich beschränkte Integrale durch Monte-Carlo-Verfahren approximieren lassen.

$$\pi = \int_{\mathbb{R}} \int_{\mathbb{R}} \begin{cases} 1 & |x^2 + y^2| \leq 1 \\ 0 & \text{sonst} \end{cases} dx dy \quad (4.1)$$

Das heißt wir integrieren die Fläche eines Einheitskreises. Durch die Ungleichung wissen wir auch, dass nur für $x, y \in [-1, 1]$ der Integrand ungleich 0 ist.

Da es programmatisch trivialer ist Zufallszahlen aus dem Intervall $[0, 1]$ anstatt $[-1, 1]$ zu ziehen,

wird das Integral über den Einheitskreis in ein Integral über einen Viertelkreis geändert:

$$\pi = 4 \int_0^\infty dx \int_0^\infty dy \begin{cases} 1 & |x^2 + y^2| \leq 1 \\ 0 & \text{sonst} \end{cases} \quad (4.2)$$

Das Integral aus Gl. 5.2 wird nun mit

$$\mu_N = \langle f(\vec{x}_i) \rangle := \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N f(\vec{x}_i), \quad \vec{x}_i \text{ uniform zufallsverteilt aus } \Omega := [0, 1] \times [0, 1] \quad (4.3)$$

approximiert. Im allgemein ist f eine beliebige Funktion, aber für die Berechnung von Pi ist f die Einheitskugel in 2D, vgl. Gl. 5.2. Gemäß dem Gesetz der großen Zahlen ist dann $\lim_{N \rightarrow \infty} \mu_N = \pi$. Für den algorithmischen Ablauf siehe Algorithmus 1

Eingabe : Anzahl an Zufallsziehungen N

Ausgabe : Approximation von π

sum $\leftarrow 0$

für $i \leftarrow 1$ **bis** N **tue**

$x \leftarrow \text{UniformRandom}(0,1)$

$y \leftarrow \text{UniformRandom}(0,1)$

wenn $x^2 + y^2 < 1$ **dann**

 sum \leftarrow sum + 1

Ende

Ende

Algorithmus 1 : Berechnung von Trägern mittels Stichproben

Der Vollständigkeit halber seien kurz ein paar Worte zu den Rändern erwähnt; das betrifft die Zufallszahlen die entweder aus einem rechteckigen oder abgeschlossenen Intervall $[0, 1]$ stammen können, d.h. der Vergleich schließt die Gleichheit mit ein oder nicht.

Aus der Integraltheorie ist klar, dass die Ränder ein Nullmaß haben und damit keine Rolle spielen. Aber für diskrete Verfahren könnte dies zu einer zusätzlichen systematischen Fehlerquelle führen, die das Fehlerskalierverhalten möglicherweise beeinträchtigt.

Am Beispiel von nur vier Zuständen für Zufallszahlen für den rechteckigen Fall, also $x, y \in \{0, 0.25, 0.5, 0.75\}$, sei dies einmal durchdacht. Damit ergibt sich

$$x^2 + y^2 = \{0, 0.0625, 0.125, 0.25, 0.3125, 0.5, 0.5625, 0.625, 0.8125, 1.125\} \quad (4.4)$$

Hier macht es aufgrund der begrenzten Anzahl an Zuständen, unter denen die 1.0 ohnehin nicht auftritt, keinen Unterschied ob man $<$ oder \leq vergleicht, man erhielte Pi zu 3.6. Hinzu kommt aber, dass Zustände auf den Grenzen $x = 0$ und $y = 0$ liegen, sodass die Grenzen vierfach gezählt werden da wir nur den Viertelkreis berechnen und mit vier multiplizieren.

Man hat also ohnehin immer einen Diskretisierungsfehler von $\mathcal{O}(\Delta x)$ wobei Δx die Diskretisierungslänge zwischen zwei Zuständen ist. Angemerkt sei, dass dies für Gleitkommazahlen komplizierter gestaltet.

Abschließend sei angemerkt, dass Monte-Carlo-Methoden dafür gedacht sind einen praktisch unerschöpflichen Raum Stichprobenartig auszutesten, sodass Diskretisierungs- und Randfehler

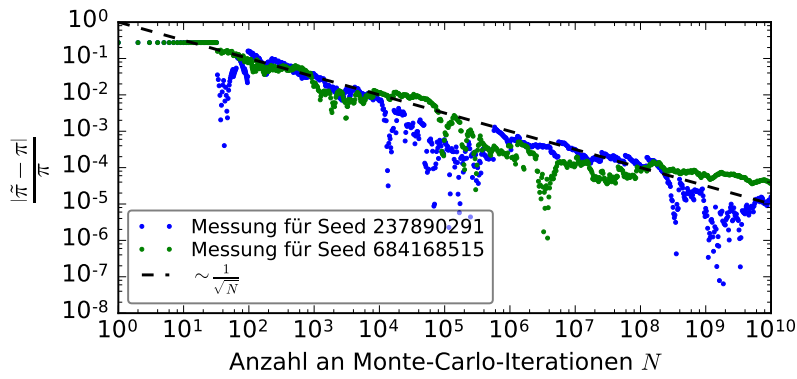


Abbildung 4.1: captiontext

ohnehin als vernachlässigbar angenommen werden. Wenn man merkt, dass es zu Diskretisierungsfehler wie obig an den Rändern kommt, oder man gar die Anzahl aller möglichen Zustände an Zufallszahlen erschöpft hat und sich die Approximation damit nicht mehr verbessern kann, sollte man über ein anderes Verfahren nachdenken oder den Zufallsgenerator anpassen und z.B. mit 128-Bit statt 32-Bit betreiben. Auch die maximale Periodenlänge von Pseudozufallsgeneratoren spielt hier eine Rolle!

Da die Monte-Carlo-Pi-Integration einer Mittelwertbildung entspricht, vgl. Gl.5.3, ist die statistische Unsicherheit gegeben durch die Standardabweichung des Mittelwerts σ_{μ_N} , welche gegeben ist als

$$\sigma_{\mu_N} \frac{\sigma}{\sqrt{N}} \quad (4.5)$$

wobei σ die Standardabweichung der Stichprobe ist, vgl. Anhang A. Wenn f_i in einem beschränkten Intervall liegt, dann ist auch die Standardabweichung der Stichproben f_i beschränkt, sodass die Standardabweichung auf den Mittelwert $\propto \frac{1}{\sqrt{N}}$ abnimmt.

4.1 Kompilierung

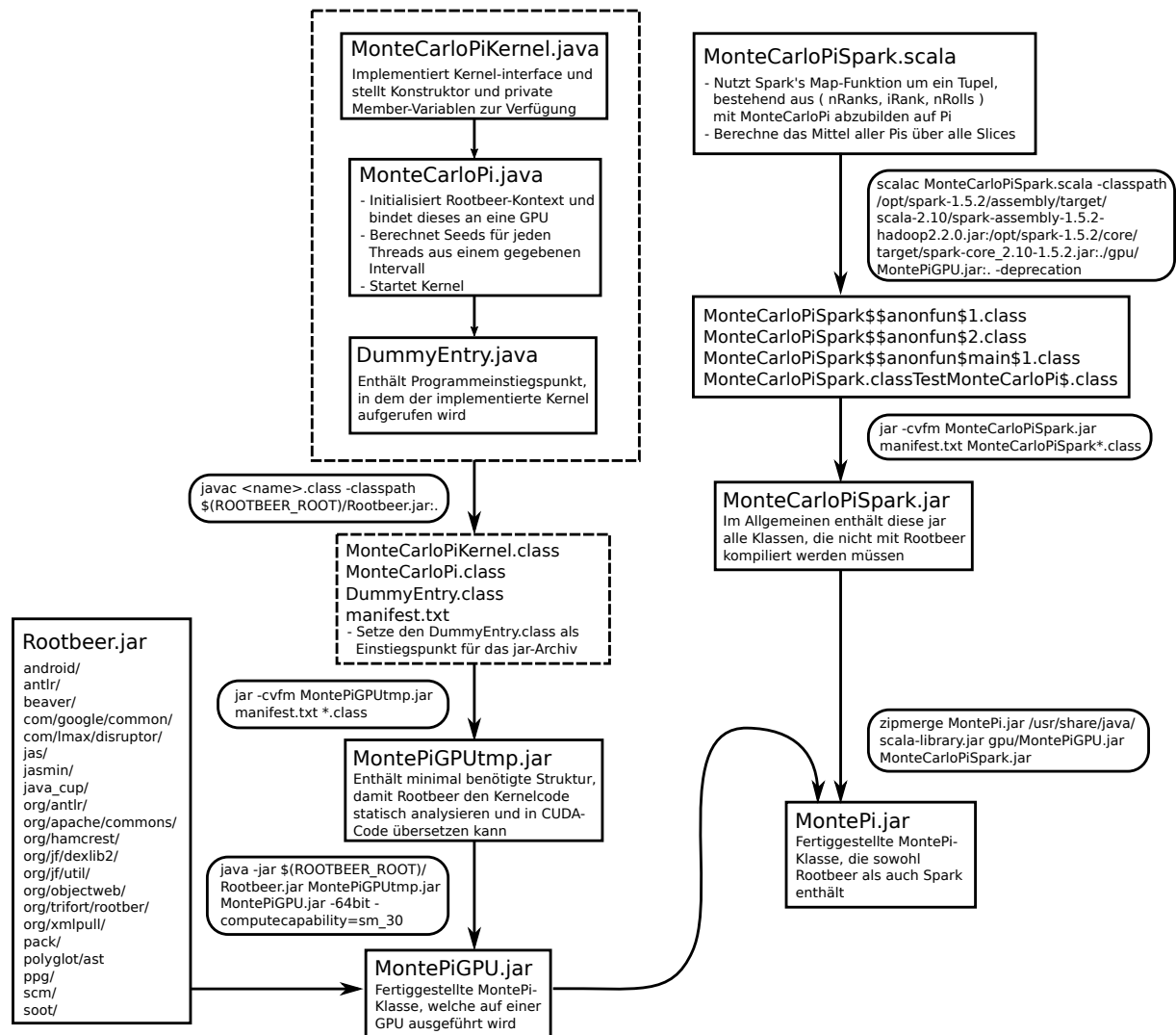


Abbildung 4.2: Kompilationsschema mit Kommandozeilenbefehlen und Zwischenstadi.

!!! Problem: Hab mehrere Fehler gefunden deren Kenntnis möglicherweise eine Vereinfachung des Schemas bedeutet. Da bin ich noch am rumspielen, daher ist das halbfertig.

4.2 Probleme

Implementierung: Was ist bei GPUs zu beachten (Seeds, 64-Bit) Was ist bei Rootbeer zu beachten? - private Variablen werden wirklich immer per memcpy hin und her transportiert. - muss nicht auf ungerade Kernel-Zahl achten, werden automatisch aussortiert

5 Leistungsanalyse

5.1 Testsysteme

5.1.1 System 1: Heimsystem

Aufgrund der leichten Verfügbarkeit und als Beispiel für Grafikkartenbeschleuniger im nicht-professionellen Verbrauchersegment, wurden einige Tests auf einem herkömmlichen Arbeitsplatzrechner ausgeführt:

Prozessor	Intel(R) Core(TM) i3-3220 (Ivy-Bridge), 3.30 GHz, 2 Kerne (4 durch SMT), AVX[7]
Arbeitsspeicher	4 × 4 GiB DDR3 1600 MHz CL9[11]
Grafikkarte	GigaByte GTX 760 WindForce 3X Overclocked, Codename: GK104-225-A2 (Kepler), 1152 CUDA-Kerne, 1085 MHz (1150 MHz Boost), 2 GiB GDDR5-VRAM mit 1502 MHz PCIe-3.0-x16-Schnittstelle[14, 9, 10]

Tabelle 5.1: Heimsystemkonfiguration

Die Maximalleistung in der Berechnung von Fließkommazahlen einfacher Genauigkeit (SPFLO) im Verhältnis einer Multiplikation zu einer Addition beträgt

$$3.30 \text{ GHz} \cdot 2 \text{ Kerne} \left(1 \frac{\text{AVX ADD Einheit}}{\text{Kern}} + 1 \frac{\text{AVX MUL Einheit}}{\text{Kern}} \right) \cdot 8 \frac{\text{SPFLO}}{\text{AVX Einheit}} \quad (5.1)$$

$$= 105.6 \text{ GSPFLOPS} \quad (5.2)$$

für den Prozessor. Informationen zur Architektur, wie die Anzahl an AVX-Einheiten wurde aus Ref.[30] entnommen.

Die Maximalleistung der Grafikkarte beträgt:

$$1.085 \text{ GHz} \cdot 1152 \text{ CUDA-Kerne} \cdot 1 \frac{\text{FMA-Einheit}}{\text{CUDA-Kern}} \cdot 2 \frac{\text{SPFLO}}{\text{FMA-Einheit}} = 2500 \text{ GSPFLOPS} \quad (5.3)$$

Zugegeben, es wurde beim Prozessor gespart und bei der Grafikkarte nicht, aber der Geschwindigkeitsunterschied von 24x begründet dennoch das Interesse daran Grafikkarten zu nutzen, auch wenn es bei Grafikkarten mehr zu beachten gibt, um diese Maximalleistung erhalten zu können.

5.1.2 System 2: Taurus

Für Skalierungstests wurde einer der Hochleistungsrechner der TU-Dresden, ein Bull HPC-Cluster mit dem Namen Taurus, benutzt. Der Bau der ersten Phase von Taurus war 2013 abgeschlossen[32]. Zum Zeitpunkt der Nutzung (2015/2016) waren alle Knoten von Phase 1 schon in die 2015 fertiggestellt[28] Phase 2 integriert wurden[31] und werden nun beide unter dem Namen Taurus zusammengefasst.

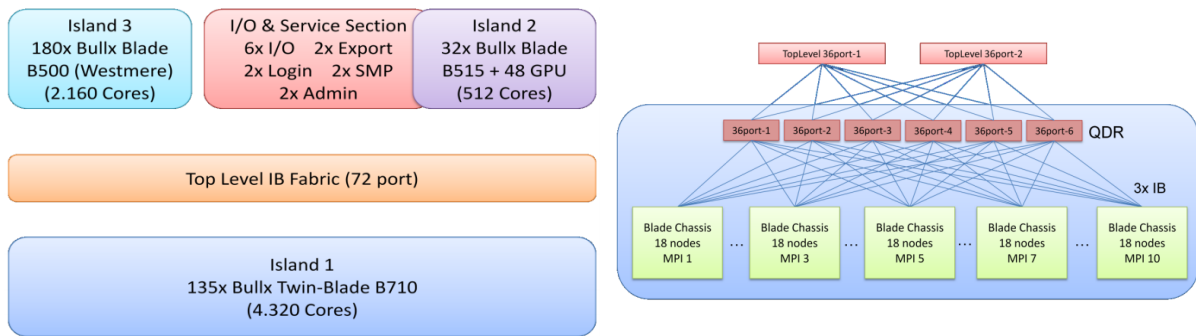


Abbildung 5.1: Links: Übersicht Taurus Phase 1. **Rechts:** Schema der Topologie von Insel 2, auf der ausschließlich gerechnet wurde. Die Bilder wurden übernommen aus Ref.[32]

Gerechnet wurde auf Insel 2 von Taurus, vgl. Tabelle 5.2. Wenn nicht anders erwähnt, dann beziehen sich Benchmarks auf die Tesla K20x Knoten.

	Phase 1	Phase 2
Knoten	44	64
Hostnamen	taurusi2[001-044]	taurusi2[045-108]
Prozessor	2x Intel Xeon CPU E5-2450 (8 Kerne) @ 2.10GHz, MultiThreading deaktiviert, AVX, 2x 268.8 GSPFLOPS	2x Intel(R) Xeon(R) CPU E5-2680 v3 (12 Kerne) @ 2.50GHz, MultiThreading deaktiviert, AVX2 insbesondere FMA3[8], 2x 537.6 GSPFLOPS
GPU	2x NVIDIA Tesla K20x	4x NVIDIA Tesla K80
Arbeitsspeicher	32 GiB	64 GiB
Festplatte	128 GiB SSD	128 GiB SSD

Tabelle 5.2: Zusammensetzung Insel 2 von Taurus[29]

	K20x	K80
Chip	GK110	GK210
Takt	0.732 GHz	0.560 GHz
CUDA-Kerne	2688	4992
Speicher	6 GiB, GDDR5 384 Bit Busbreite	2 × 12 GiB, GDDR5 384 Bit Busbreite
Bandbreite	250 GB s ⁻¹	2 × 240 GB s ⁻¹
Theoretische Spitzenleistung	3935 GSPFLOPS 1312 GDPFLOPS	5591 GSPFLOPS 1864 GDPFLOPS

Tabelle 5.3: Spezifikationen der Kepler-Grafikkarten von Taurus[10, 27]

Zu den Spitzenleistungen in Tabelle 5.3 sei angemerkt, dass jeder CUDA-Kern einfache Fließkommagenauigkeit berechnet und auf drei CUDA-Kerne eine Doppelpräzisionseinheit kommt, wodurch sich die DFLOPS berechnen. Die K80 hat außerdem einen Boost-Modus mit 0.875 GHz, also einer Leistungssteigerung von 1.56.

5.2 Monte-Carlo-Simulation verschiedener Implementationen

In Abb.5.3 wurde die Ausführungszeit von Monte-Carlo-Simulationen in verschiedenen Programmiersprachen über die Anzahl an Monte-Carlo-Iterationen gemessen. Gemessen wurde die Zeit mit dem Linux `time`-Befehl und zwar die `real`-Zeit. Es fällt auf, dass alle Versionen eine Initialisierungszeit haben. Bei der C++-Version beträgt diese jedoch nur knapp 30 ms, während die reine Java-Version schon ca. 70 ms benötigt. Die Nutzung von Scala erhöht dies schon auf 200 ms und die Nutzung von Rootbeer führt eine weitere Initialisierungszeit von 430 ms ein, sodass für wenig Iterationen die Rootberversion bis zu 20x langsamer sind. Erst für 10 Milliarden Iterationen beginnt die Initialisierungszeit im Vergleich zur Rechenzeit vernachlässigbar zu werden, sodass aber da die Lastenskalierung ein lineares Verhalten annimmt. Bei der C++-Version ist dies schon bei ca. 100 Millionen Iterationen der Fall.

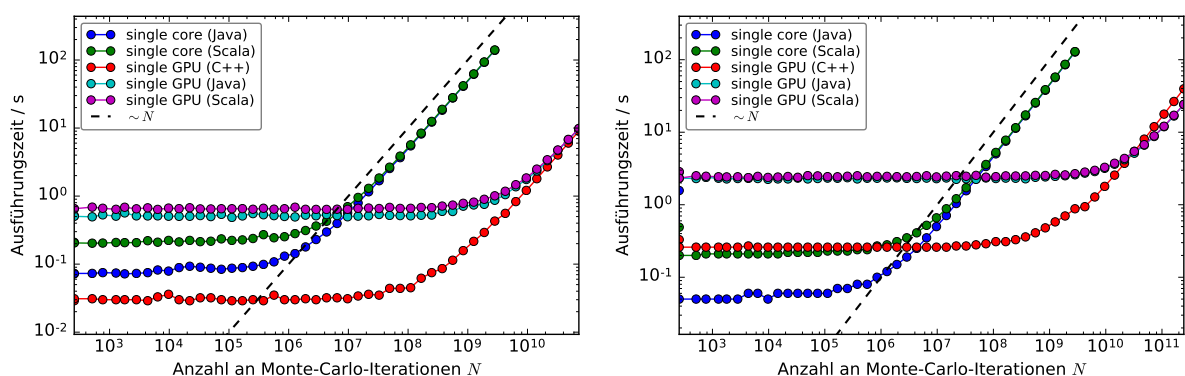


Abbildung 5.2: Benötigte Ausführungszeit der Monte-Carlo Pi-Berechnung in Abhängigkeit von der Anzahl an Iterationen. Getestet auf **links:** System 1 und **rechts:** System 2 (Taurus), siehe Kapitel 5.2.1

Im Programmausdruck 5.1 ist die Hauptschleife, die hauptsächlich die Arbeitslast generiert,

zu sehen. Es handelt sich also für jede der zwei Zufallszahlen um eine Multiplikation und zwei Divisionen und dann nochmals zwei Multiplikationen für die Berechnung des Quadrat des Radius, also zusammen acht Operationen pro Iteration und neun Operationen für Iterationen die im Kreis liegen. Dies tritt für $\frac{\pi}{4} = 0.785\%$ der Fälle auf, das heißt die Rechenlast, definiert als die Anzahl an arithmetischen Operationen N_{Op} sollte sich wie folgt aus der Anzahl an Iterationen N berechnen:

$$N_{Op} = \left[\frac{\pi}{4} \cdot 9 + \left(1 - \frac{\pi}{4} \right) \cdot 8 \right] N = 8.8 \cdot N \quad (5.4)$$

Zuletzt ist aus dem Plot abzulesen, dass für große Lasten wie z.B. für drei Milliarden Iterationen die Versionen, die von Grafikkarten Gebrauch machen, um einen Faktor 140 (Scala) bis 320 (C++) schneller sind als die Java Version, die auf einem Prozessor-Kern ausgeführt wird. Dieser große Unterschied zwischen CPU und GPU lässt darauf schließen, dass Java weder AVX noch mehrere Kerne gleichzeitig nutzt. Das heißt für die CPU-Versionen wäre für das Testsystem 1 noch ein Geschwindigkeitsgewinn von $8 \frac{Op}{AVX-Einheit} \cdot 2 \text{ Kerne}$ erreichbar. Dies würde den Geschwindigkeitsunterschied von 320 auf 20 reduzieren, was in Übereinstimmung mit dem Verhältnis der Peakflops aus Kapitel 5.2.1 wäre.

```

1 for ( int i = 0; i < dnDiceRolls; ++i )
2 {
3     dRandomSeed = (int)( (randMagic*dRandomSeed) % randMax );
4     float x = (float) dRandomSeed / randMax;
5     dRandomSeed = (int)( (randMagic*dRandomSeed) % randMax );
6     float y = (float) dRandomSeed / randMax;
7     if ( x*x + y*y < 1.0 )
8         nHits += 1;
9 }

```

Listing 5.1: Hauptschleife der Monte-Carlo Pi-Berechnung

Dieses Branching verändert also nicht das Skalierverhalten linear mit N , sondern führt nur zu einem veränderten Faktor. Daher ist in Abb.5.3 lineares Verhalten zu beobachten.

5.3 Monte-Carlo-Simulation mit Spark + Rootbeer

In Abbildung 5.4 ist die Laufzeit über die Anzahl an Kernen bzw. Grafikkarten dargestellt. Aus Gründen der Rechenzeit wurde für eine Anzahl von $N = 1, 2, 4, 8, 16, 24, 32$ Knoten die Leistungsanalyse für $4(N - 1)$ bis $4N$ Kerne/Grafikkarten durchgeführt. Dies ist vor allem in der Abbildung rechts zu sehen, wo die Messpunkte immer in fünfer-Gruppen auftreten.

Zwar nicht in der Abbildung dargestellt, wurde auch für $4N + 1$ und $4N + 2$ gemessen. Das heißt Spark hat zwei mehr Slices zu verarbeiten als es Kerne gibt. Dies führt dazu, dass zwei Kerne doppelt so viel Arbeit wie der Rest haben, wodurch es zu einem sprunghaften Anstieg der Laufzeit kommt. Aus diesem Grund ist es normalerweise besser, wenn die Anzahl an Slices viel größer als die Anzahl an Kernen bzw. Grafikkarten wäre. Dies würde aber die ohnehin schon recht hohe Mindestproblemgröße noch einmal um ein, zwei weitere Größenordnungen erhöhen.

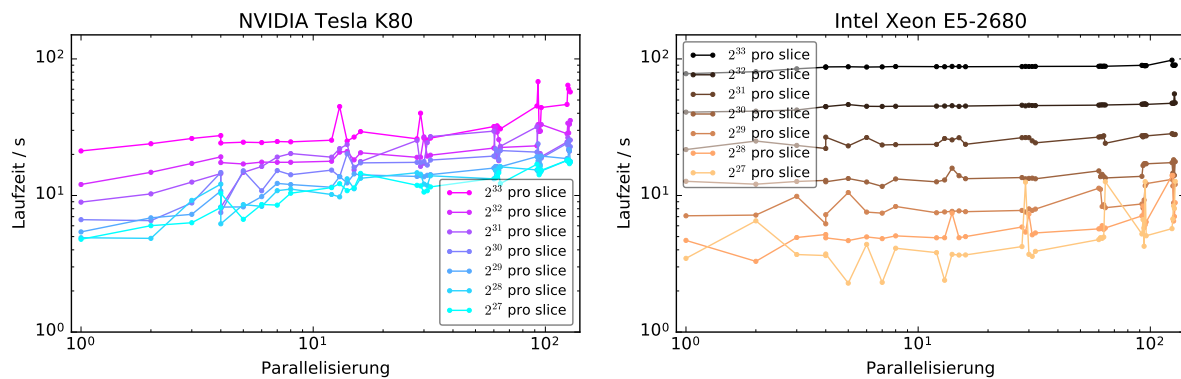


Abbildung 5.3: Benötigte Ausführungszeit der Monte-Carlo Pi-Berechnung in Abhängigkeit von der Anzahl an **links:** Kernen und **rechts:** Grafikkarten. Getestet auf System 2, siehe Kapitel 5.2.2

Weiterhin auffällig sind zufällig auftretende Spitzen in sowohl im CPU als auch im GPU-Benchmark. Z.b. für eine Arbeitslast von 2^{33} Iterationen pro Slice auf 24 Knoten also 92 bis 96 Grafikkarten schwankt die Ausführungszeit zwischen 30s, 45s und 68s. Möglicherweise liegt dies an einer ungünstigen Verteilung der Slices auf die Knoten. Die vorliegende Version nimmt eine lineare Verteilung an, sodass Slice 0 auf Grafikkarte 0 von Knoten 0 rechnet, während Slice 1 auf Grafikkarte 1 von Knoten 0 und Slice 4 auf Grafikkarte 0 von Knoten 1 rechnet. Die Zeit die eine Grafikkarte für diese Last benötigt ist 22s. Es ist also wahrscheinlich, dass zumindest im Fall der 68s drei verschiedene Prozesse auf einem Knoten dieselbe Grafikkarte anfordern. Diese Vermutung wurde getestet, indem jeder Slice seinen Hostnamen ausgeben soll. Mit dem Skript aus Listing ?? ist dies schnell interaktiv getestet:

```
1 startSpark --time=04:00:00 --nodes=5 --partition=west --gres= --cpus-per-task=12
2 spark-shell --master=$MASTER_ADDRESS
3 scala> import java.net.InetAddress
4 scala> sc.parallelize( 1 to 5*12, 5*12 ).map( (x) => { Thread.sleep(10); x+" : "
    +InetAddress.getLocalHost().getHostName() } ).collect().foreach( println )
```

Es ist also wie vermutet: die Verteilung ist nicht linear, sondern eher verzahnt, aber eigentlich zufällig.

Eine Lösung dieses Problems ist schwierig, da die Verteilung der Slices von Spark auf die Worker-Knoten opak erfolgt und es auch schwierig ist mit CUDA und vor allem mit Rootbeer herauszufinden welche der verfügbaren Grafikkarten in Benutzung ist. Ein ändern des Compute-Modus in einen Thread- oder Prozess-exklusiven Modus mittels

```
1 nvidia-smi --compute-mode=EXCLUSIVE_PROCESS
```

ist auf Grund fehlender Berechtigungen im Cluster nicht möglich. In diesem Modus würde der Versuch eine schon in Benutzung seiende Grafikkarte anzusprechen in einer "GPU device not available"-Fehlermeldung enden. Womöglich ist es gar nicht möglich dies über Rootbeer abzufangen.

Die Spitzen im CPU-Benchmark lassen sich dadurch jedoch nicht erklären, da sie für sehr Hohe Arbeitslasten kleiner verschwindet klein werden. Es handelt sich also wahrscheinlich eher um

zufällige Initialisierungsoffsets oder Kommunikationslatenzen. Sie sind ungefähr 3 s groß, womit Kommunikationslatenz sehr unwahrscheinlich sind, da `ping taurusi2063` als Beispiel Latenzen im Bereich von 200 μ s misst. Es sei hier angemerkt, dass es in den 343 Testläufen für jeweils CPU und GPU zu zwei Fällen kam, in denen ein Job über das Spark-Web-Interface manuell beendet werden musste, da sie schon mehrere Minuten ohne Fortschritt liefen. Möglicherweise war dies aber auch ein Sympton der GPU-Konflikte pro Knoten.

In Abbildung 5.4 ist für große Arbeitslasten wie zu erwarten ein nahezu konstantes Verhalten über erhöhte Parallelisierung abzulesen. Für kleine Arbeitslasten ist eine schwache monotone Abhängigkeit zu beobachten. Möglicherweise ist dies die Zeit, die eine Reduktion über 32 Knoten länger braucht als z.B. über vier Knoten.

Die Benchmarks wurden für eine Grafikkarte pro Knoten wiederholt. Außerdem wurde leider festgestellt, dass die Benchmarks mit nur 384 Threads pro Grafikkarte ausgeführt wurden. Dies wurde geändert auf eine automatische Bestimmung, die zu ungefähr 20000 Threads führen sollte, womit Pipelining genutzt werden kann, sodass ein Faktor von 30 und mehr an Speedup zu erwarten ist.

6 Zusammenfassung

- Ausblick(Nutzbarkeit, Anwendungsfälle, Deep Learning) - deep learning - Ähnlichkeit (assembling)
- mehr cores

Literaturverzeichnis

- [1] APACHE: Apache Hadoop. <http://hadoop.apache.org/> [Online; accessed 2016-08-08],
- [2] APACHE: Apache MLlib. <http://spark.apache.org/mllib/> [Online; accessed 2016-08-08],
- [3] APACHE: Apache Spark. <http://spark.apache.org/> [Online; accessed 2016-08-08],
- [4] APACHE: GraphX Programming Guide. <http://spark.apache.org/docs/latest/graphx-programming-guide.html#graph-operators> [Online; accessed 2016-08-08],
- [5] APACHE: Spark Programming Guide. <http://spark.apache.org/docs/latest/programming-guide.html> [Online; accessed 2016-08-09],
- [6] CHIERICHETTI, Flavio ; KUMAR, Ravi ; TOMKINS, Andrew: Max-cover in Map-reduce. In: Proceedings of the 19th International Conference on World Wide Web. New York, NY, USA : ACM, 2010 (WWW '10). – ISBN 978-1-60558-799-8, 231-240
- [7] CORPORATION, Intel: Intel Core i3-3220 Prozessor Spezifikationen. http://ark.intel.com/de/products/65693/Intel-Core-i3-3220-Processor-3M-Cache-3_30-GHz [Online; accessed 2016-05-07],
- [8] CORPORATION, Intel: Intel Xeon E5-2680v3 Prozessor Spezifikationen. http://ark.intel.com/products/81908/Intel-Xeon-Processor-E5-2680-v3-30M-Cache-2_50-GHz?wapkw=e5-2680v3 [Online; accessed 2016-05-08],
- [9] CORPORATION, NVIDIA: NVIDIA GeForce GTX 760 Specifications. <http://www.geforce.com/hardware/desktop-gpus/geforce-gtx-760/specifications> [Online; accessed 2016-05-07],
- [10] CORPORATION, NVIDIA: Whitepaper - NVIDIA's Next Generation CUDA Compute Architecture: Kepler TM GK110/210. <http://international.download.nvidia.com/pdf/kepler/NVIDIA-Kepler-GK110-GK210-Architecture-Whitepaper.pdf> [Online; accessed 2016-05-07], 2014
- [11] CORSAIR: Vengeance® - 4GB Single Module DDR3 Memory Kit (CMZ4GX3M1A1600C9) - Tech Specs. <http://www.corsair.com/en/vengeance-4gb-single-module-ddr3-memory-kit-cmz4gx3m1a1600c9> [Online; accessed 2016-05-07],

- [12] DEAN, Jeffrey ; GHEMAWAT, Sanjay: MapReduce: Simplified Data Processing on Large Clusters. In: OSDI 2004, 2004, 137–150
- [13] DEAN, Jeffrey ; GHEMAWAT, Sanjay: MapReduce: Simplified Data Processing on Large Clusters. In: Commun. ACM 51 (2008), Januar, Nr. 1, 107–113. <http://dx.doi.org/10.1145/1327452.1327492>. – DOI 10.1145/1327452.1327492. – ISSN 0001-0782
- [14] GIGA-BYTE TECHNOLOGY Co., Ltd.: NVIDIA GeForce GTX 760 Specifications. <http://www.gigabyte.com/products/product-page.aspx?pid=4663#sp> [Online; accessed 2016-05-08],
- [15] GROUP, Sable R. ; GROUP, Secure Software E.: Soot - A framework for analyzing and transforming Java and Android Applications. <https://sable.github.io/soot/> [Online; accessed 2016-05-09],
- [16] KARAU, Holden ; KONWINSKI, Andy ; WENDELL, Patrick ; ZAHARIA, Matei: Learning Spark: Lightning-Fast Big Data Analytics. 1st. O'Reilly Media, Inc., 2015. – ISBN 1449358624, 9781449358624
- [17] KNESPEL, Maximilian: Codeverzeichnis zum Benchmark von Rootbeer über das Spark-Scala-Interface. <https://github.com/mxmlnkn/scaromare> [Online; accessed 2016-08-09], 2016
- [18] LAM, Patrick ; BODDEN, Eric ; LHOTÁK, Ondrej ; HENDREN, Laurie: The Soot framework for Java program analysis: a retrospective. In: Cetus Users and Compiler Infrastructure Workshop (CETUS 2011), 2011
- [19] MARTI, Othmar: Mittlerer Fehler des Mittelwertes - Vorlesungsskript. wwwex.physik.uni-ulm.de/lehre/fehlerrechnung/node15.html [Online; accessed 2016-05-07],
- [20] METROPOLIS, Nicholas: The beginning of the Monte Carlo Method. In: Los Alamos Science 15 (1987), Nr. 584, 125–130. <http://jackman.stanford.edu/mcmc/metropolis1.pdf>
- [21] METROPOLIS, Nicholas ; ULAM, Stanislaw: The Monte Carlo Method. In: Journal of the American statistical association 44 (1949), Nr. 247, S. 335–341
- [22] PRATT-SZELIGA: Rootbeer GPU Compiler - Java GPU Programming. <https://github.com/pcpratts/rootbeer1> [Online; accessed 2016-05-09],
- [23] PRATT-SZELIGA: Issues with JRE 1.8. <https://github.com/pcpratts/rootbeer1/issues/175#issuecomment-61431951> [Online; accessed 2016-05-08], 2014
- [24] PRATT-SZELIGA, Maximilian K.: Rootbeer GPU Compiler - Java GPU Programming. <https://github.com/pcpratts/rootbeer1> [Online; accessed 2016-05-09],
- [25] PRATT-SZELIGA, Philip C. ; FAWCETT, James W. ; WELCH, Roy D.: Rootbeer: Seamlessly using gpus from java. In: High Performance Computing and Communication & 2012 IEEE

- 9th International Conference on Embedded Software and Systems (HPCC-ICISS), 2012
IEEE 14th International Conference on IEEE, 2012, S. 375–380
- [26] SEO, S. ; YOON, E. J. ; KIM, J. ; JIN, S. ; KIM, J. S. ; MAENG, S.: HAMA: An Efficient Matrix Computation with the MapReduce Framework. In: Cloud Computing Technology and Science (CloudCom), 2010 IEEE Second International Conference on, 2010, S. 721–726
- [27] SMITH, Ryan: NVIDIA Launches Tesla K20 & K20X: GK110 Arrives At Last. <http://www.anandtech.com/show/6446/nvidia-launches-tesla-k20-k20x-gk110-arrives-at-last> [Online; accessed 2016-05-08], 11 2012
- [28] STILLER, Andreas: Neuer Supercomputer an der TU-Dresden wird am Mittwoch eingeweiht. <http://www.heise.de/newsticker/meldung/Neuer-Supercomputer-an-der-TU-Dresden-wird-am-Mittwoch-eingeweiht-2639880.html> [Online; accessed 2016-05-08], 05 2015
- [29] ULF MARKWARDT, Guido J. u. a.: TU Dresden Internetauftritt - Hochleistungsrechner. <https://doc.zih.tu-dresden.de/hpc-wiki/bin/view/Compendium/SystemTaurus> [Online; accessed 2016-05-08], 2013-2016
- [30] VALENTINE, Bob: Introducing Sandy Bridge. <https://www.cesga.es/pt/paginas/descargaDocumento/id/135> [Online; accessed 2014-10-21],
- [31] WEB-TEAM, HPC: TU Dresden Internetauftritt - Zentrale Komponenten. <https://doc.zih.tu-dresden.de/hpc-wiki/bin/view/Compendium/SystemTaurus> [Online; accessed 2016-05-08], 2013-2016
- [32] WENDER, Jan: HRSK-II Nutzerschulung. <https://doc.zih.tu-dresden.de/hpc-wiki/pub/Compendium/SystemTaurus/HRSK-II-Nutzerschulung.pdf> [Online; accessed 2016-05-08], 5 2014

A Standardabweichung des Mittelwertes

Dieses Kapitel richtet sich leicht nach Ref.[19]. Sei $f \equiv (f_i)$ eine Folge von N Stichproben aus einer Zufallsverteilung mit einem Mittelwert μ und μ_N der empirische Mittelwert dieser Folge. Die Differenz $\Delta_N := \mu - \mu_N$ wird nun abgeschätzt mit der Standardabweichung einer Folge von empirischen Mittelwerten $(\mu_{N,k})$ die alle mit (sehr wahrscheinlich) verschiedenen Folgen bzw. Vektoren (f_i) gebildet seien.

Sei nun $\langle \cdot \rangle_N : \mathbb{S} \times \mathbb{R}^N \rightarrow \mathbb{R}^N$, $\langle (f_i)_k \rangle_N := \frac{1}{N} \sum_{i=0}^N f_{ik}$ der empirische Mittelwert und $E(\cdot) : \mathbb{S} \rightarrow$

\mathbb{R} , $E(x_k) := \lim_{N \rightarrow \infty} \frac{1}{N} \sum_{k=0}^N f_k$ der Erwartungswert über eine unendlich Folge aus einem beliebigen statistischen Werten für begrenzte Folgen (f_i) . Hierbei ist \mathbb{S} der Raum der Folgen. Aus der Definition der beiden Mittelwerte wird klar, dass man die Summen und damit die Bildung der Mittelwerte vertauschen kann, sofern ein Grenzwert existiert. Dies wird in Gleichung A.3 angewandt.

$$\sigma_{\mu_N}^2 := E((\mu_N - \mu)^2) := E((\langle f_{ik} \rangle_N - \mu)^2) = E(\langle f_{ik} - \mu \rangle_N^2) \quad (\text{A.1})$$

$$= E\left(\left(\frac{1}{N} \sum_{i=0}^N (f_{ik} - \mu)\right) \left(\frac{1}{N} \sum_{i=0}^N (f_{ik} - \mu)\right)\right) = E\left(\frac{1}{N^2} \sum_{i=0}^N \sum_{j=0}^N (f_{ik} - \mu)(f_{jk} - \mu)\right) \quad (\text{A.2})$$

$$= \frac{1}{N} E\left(\frac{1}{N} \sum_{i=0}^N (f_{ik} - \mu)^2\right) + E\left(\frac{1}{N} \sum_{i=0}^N (f_{ik} - \mu) \frac{1}{N} \sum_{j=0, j \neq i}^N (f_{jk} - \mu)\right) \quad (\text{A.3})$$

$$= \frac{1}{N} E(\sigma_k) + \frac{1}{N} \sum_{i=0}^N \frac{1}{N} \sum_{j=0, j \neq i}^N \left(\underbrace{E(f_{ik})}_{=\mu} - \mu\right) \left(\underbrace{E(f_{jk})}_{=\mu} - \mu\right) = \frac{\sigma}{N} \quad (\text{A.4})$$

Man beachte, dass der Schritt in Gl.A.3-A.4 nur möglich ist, wenn f_i unabhängig von f_j ist, was hier der Fall ist, da der einzige abhängige Fall für $i = j$ aus der SUMme rausgezogen würde, sodass $E(ab) = E(a)E(b)$ anwendbar ist.

Man beachte, dass der zweite Summand nur durch die Mittelung über mehrere komplett verschiedene Versuchsreihen Null wird. Betrachtet man jedoch nur eine Versuchsreihe, dann hat der zweite Summand auch ein Skalierverhalten in Abhängigkeit zu N . Da aber das Vorzeichen wechseln kann, muss man den Betrag betrachten:

$$\frac{1}{N} \sum_{i=0}^N (f_i - \mu) \frac{1}{N} \sum_{j=0, j \neq i}^N (f_j - \mu) = \frac{1}{N} \sum_{i=0}^N \frac{1}{N} \sum_{j=0, j \neq i}^N (f_i f_j - \mu(f_i + f_j) + \mu^2) \quad (\text{A.5})$$

$$\approx \mu_N^2 - 2\mu\mu_N + \mu^2 \stackrel{\mu_N \approx \mu - \sigma_{\mu_N}}{\approx} \mu^2 - 2\sigma_{\mu_N}\mu + \sigma_{\mu_N}^2 - 2\mu^2 + 2\mu\sigma_{\mu_N} + \mu^2 = \sigma_{\mu_N}^2 = \frac{\sigma}{N} \quad (\text{A.6})$$

Schritt A.6 ist stark skizzenhaft und nicht mathematisch korrekt ausgeführt, wird aber gestützt durch empirische Auswertungen, vgl. Abb.A.1. In der Abbildung sieht man, dass sowohl der

erste Summand als auch der zweite invers proportional zu N skaliert. Ein wichtiger Unterschied ist jedoch, dass der erste Summand immer positiv ist, während das Vorzeichen des zweiten Summanden oszilliert, wodurch er über die Mittelung mit $E(\cdot)$ gegen Null geht.

Interessant zu bemerken ist auch, dass der Graph der Standardvarianz des Mittelwertes $\sigma_{\mu_N}^2$ aufgetragen über die Anzahl an einbezogener Stichproben einer Zufallsbewegung ähnelt, anstatt stochastisch zu streuen. Dies wäre nicht der Fall, würde man für alle N komplett neue Stichproben ziehen.

Weiterhin fällt auf, dass beide Summanden einer sehr glatten Geraden mit wenig Streuung folgen, während dies für $\sigma_{\mu_N}^2$ nicht der Fall ist. Dies zeigt, dass es durchaus zu einer Fehlerrückmeldung durch den wegdiskutierten zweiten Summanden kommt. Dies beeinträchtigt jedoch nicht die Fehlerskalierung mit $\mathcal{O}\left(\frac{1}{N}\right)$.

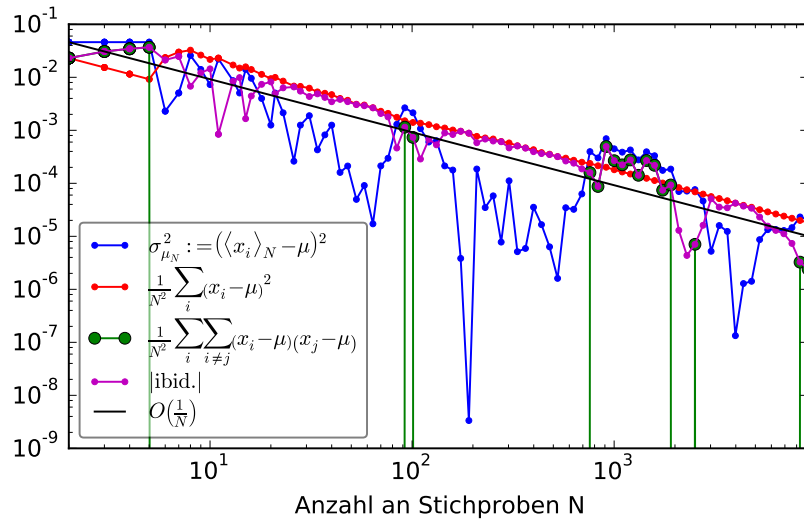


Abbildung A.1: Darstellung der Standardvarianz des Mittelwertes $\sigma_{\mu_N}^2$ und der beiden in der Herleitung A.3 auftretenden Summanden über die Anzahl einbezogener Stichproben. Hierbei ist zu beachten, dass beim Vergleich von den Werten für die Stichprobenanzahl von N_1 und N_2 die ersten $\min(N_1, N_2)$ Stichproben identisch sind.