



Performance Modeling of Computer Systems and Networks

Prof. Vittoria de Nitto Personè

Continuous Random Variates: applications

Università degli studi di Roma Tor Vergata
Department of Civil Engineering and Computer Science Engineering

Copyright © Vittoria de Nitto Personè, 2021
<https://creativecommons.org/licenses/by-nc-nd/4.0/>



1

Discrete Simulation
Continuous RV applications

For our application framework, we will look at:

- arrival process model
- service process model

Prof. Vittoria de Nitto Personè

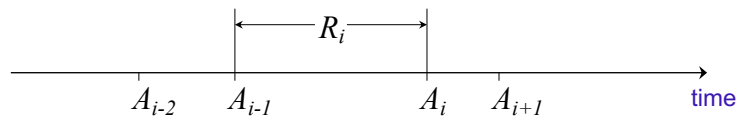
2

2

L'istante di arrivo i-esimo è la somma dei primi 'i' tempi di INTERARRIVO, che sono positivi ovviamente, allora la costruzione dei tempi di ARRIVO è crescente.

Arrival process model

- Model *interarrival* times as RV sequence R_1, R_2, R_3, \dots
- Construct corresponding arrival times A_1, A_2, A_3, \dots defined by
 $A_0 = 0$ and $A_i = A_{i-1} + R_i \quad i=1, 2, \dots$
- by induction, $A_i = R_1 + R_2 + \dots + R_i \quad i=1, 2, \dots$
- since $R_i > 0$, $0 = A_0 < A_1 < A_2 < A_3 < \dots$



Prof. Vittoria de Nitto Personè

3

3

Example

- programs `ssq2` and `ssq3` generate job arrivals in this way, where R_1, R_2, R_3, \dots are *Exponential*($1/\lambda$).
In both programs, the arrival rate is equal to $\lambda = 0.5$ jobs per unit time

```
double GetArrival()
{ static double arrival = START;
  SelectStream(0);
  arrival += Exponential(2.0);
  return (arrival); }
```

Implementazione della slide precedente, ovvero A_i = somma degli interarrivi exp.

Prof. Vittoria de Nitto Personè

4

4

Fino a sis2 modellavamo quantità richiesta in settimana, uniformemente spalmata nella settimana, domanda unitaria. Nella pratica, questi sono limiti, e con sis3 e sis4 abbiamo modellato il caso per togliere questi limiti. Con sis3 siamo passati da generare la quantità di richiesta degli articoli per ogni intervallo di tempo con una distribuzione. In sis3 avevamo domanda media 30, con sis4 abbiamo tolto il vincolo di '1 richiesta = 1 ordine di prodotto', riadattando quindi lambda per far sì che la media tornasse sempre 30. Abbiamo modellato ciò con una geometrica.

Discrete Simulation
Continuous RV applications

Example

- programs *sis3* and *sis4* generate demand instances in this way, with *Exponential*($1/\lambda$) interdemand times.
 - The demand rate corresponds to an average of
 - $\lambda = 30.00$ actual demands per time interval in *sis3*
 - $\lambda = 120.00$ potential demands per time interval in *sis4*

```
double GetDemand(long *amount)
/*
 * generate a demand instance with rate 120
 * and generate the next demand instance (time) with rate 30 per time
 * interval and exactly one unit of demand per demand instance
 */
{
  static double time = START;
  static double time = START;

  SelectStream(0);
  time += Exponential(1.0/120.0); /* demand instance */
  SelectStream(2);
  *amount = Geometric(0.2); /* demand amount */
  return (time);
}
```

Prof. Vittoria de Nitto Personè
5

5

Se ho interarrivi indipendenti e i.d., la sequenza di arrivi A_1, \dots , è un processo stazionario di arrivi di tasso lambda. Anche detti processi di rinnovo o processi omogenei.

Discrete Simulation
Continuous RV applications

Def stationary arrival process

If R_1, R_2, R_3, \dots is an iid sequence of positive interarrival times with $E[R_i] = 1/\lambda > 0$, then the corresponding sequence of arrival times A_1, A_2, A_3, \dots is a *stationary arrival process* with rate λ

- also known as
 - Renewal processes*
 - Homogeneous arrival processes*
- arrival rate λ has units "arrivals per unit time" tempo = 1/frequenza
 - If average interarrival time is 0.1 minutes,
 - then the arrival rate is 10 arrivals per minute
- stationary arrival processes are "convenient fiction"
 - important theoretically
 - good approximation
 - understand for nonstationary
- If the arrival rate λ varies with time, the arrival process is *nonstationary*

Prof. Vittoria de Nitto Personè
6

6

Nella realtà, è difficile dire che la 'media' non cambi nel tempo, basti pensare al problema delle fasce orarie.

Se il tasso lambda cambia nel tempo, il processo di arrivo NON E' STAZIONARIO.

3

Si parte dallo stazionario per poter capire il 'non' stazionario. Se nel progetto avessi un nonstazionario, posso dividere in fasce orarie, associando una media ciascuna.

Senza troppe informazioni su arrivi, spesso si assume $\text{Exp}(1/\lambda)$, se prendiamo λ come tasso, nel parametro c'è la media.

stationary Poisson arrival process

- As in `ssq2`, `ssq3`, `sis3`, `sis4`, with lack of information it is usually most appropriate to assume that the interarrival times are *Exponential*($1/\lambda$)
- If R_1, R_2, R_3, \dots is an iid sequence of *Exponential*($1/\lambda$) interarrival times, the corresponding sequence A_1, A_2, A_3, \dots of arrival times is a stationary *Poisson* arrival process with rate λ . Equivalently, for $i=1, 2, 3, \dots$, the arrival time A_i is an *Erlang*($i, 1/\lambda$) random variable

$$A_i = R_1 + R_2 + \dots + R_i$$

Algorithm 1

Given $\lambda > 0$ and $t > 0$, this algorithm generates a *realization* of a stationary Poisson arrival process with rate λ over $(0, t)$

```
a0 = 0.0;          /* a convention */
n = 0;
while(an < t) {
    an+1 = an + Exponential(1 / λ);
    n++;
}
return a1, a2, a3, . . . , an;
```

Per convenzione il tempo inizia ad istante 0, metto poi gli arrivi $n = 0$, genero tutti i tempi di interarrivo dall'esponenziale, poi conto gli arrivi, questa è realizzazione del processo stocastico di arrivo di Poisson.

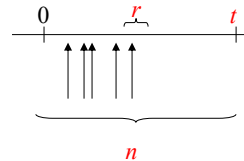
Prendo intervallo di tempo da '0' a 't', al suo interno ci metto un certo numero di arrivi 'n', e un sottointervallo posto in modo random rispetto all'intervallo (0,t).

Random Arrivals

We now demonstrate the interrelation between Uniform, Exponential and Poisson random variables.

Consider:

- $t > 0$, defines a fixed time interval $(0, t)$
- n represents the number of arrivals in the interval $(0, t)$
- $r > 0$, is the length of a small subinterval located at random interior to $(0, t)$



Correspondingly:

- $\lambda = n / t$ is the arrival rate
- $p = r / t$ is the probability that a particular arrival will be in the subinterval
- $np = nr / t = \lambda r$ is the expected number of arrivals in the subinterval

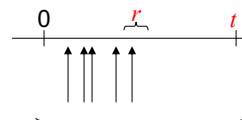
$\lambda \cdot r = \text{tasso} \cdot \text{finestra temporale}$

Prof. Vittoria de Nitto Personè

9

9

random arrivals \rightarrow Poisson



Theorem 1

Let:

- A_1, A_2, A_3, \dots be an iid sequence of Uniform(0, t) random variables ("unsorted" arrivals).

- the discrete random variable X be the number of A_i that fall in a fixed subinterval of length $r = pt$ interior to $(0, t)$

If n is large and r / t small, X is indistinguishable from a Poisson(λr) random variable with $\lambda = n / t$

media attesa
come parametro

Prof. Vittoria de Nitto Personè

10

10

Conclusions on random arrivals

- if *many* arrivals occur at random with a rate of λ , the number of arrivals X that will occur in an interval of length r is $Poisson(\lambda r)$

- The probability of x arrivals in an interval with length r is

$$Pr(X = x) = \frac{e^{-\lambda r} (\lambda r)^x}{x!} \quad x = 0, 1, 2, \dots$$

- The probability of no arrivals is: $Pr(X = 0) = e^{-\lambda r}$
- The probability of at least one arrival is:

$$Pr(X > 0) = 1 - Pr(X = 0) = 1 - e^{-\lambda r}$$

For a fixed λ , the probability of at least one arrival increases with increasing interval length r

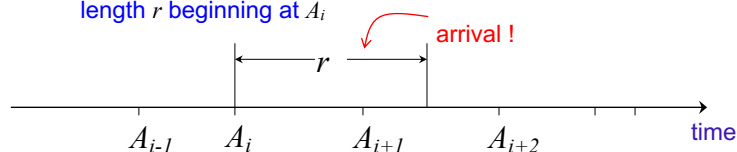
Prof. Vittoria de Nitto Personè

11

11

Random Arrivals → Exponential Interarrivals

- R interarrivo • If R represents the time between consecutive arrivals, the possible values of R are $r > 0$. R è un qualsiasi intervallo maggiore di 0
- Consider arrival time A_i selected at random and an interval of length r beginning at A_i



- $R = A_{i+1} - A_i$ will be less than r iff there is at least one arrival in this interval
- the cdf of R is

$$Pr(R \leq r) = Pr(\text{at least one arrival in } r) = 1 - e^{-\lambda r}$$
- R is an Exponential($1/\lambda$) random variable

Prof. Vittoria de Nitto Personè

12

12

Dagli arrivi random discende l'interarrivo esponenziale.

in 'r' vedo quanti arrivi cadono, nella figura cade solo A_{i+1} , A_i è fuori dal range

MIA OSSERVAZIONE: la cdf di R , così espressa, sarebbe una $Exp()$. Tuttavia sotto viene detto che si tratta di una $exp(1/\lambda)$. Perché? Cercando su wikipedia, si scopre che la funzione di distribuzione della esponenziale può essere anche scritta con un parametro $\beta = 1/\lambda$. Nella formula si mette $\beta = 1/\lambda$, e la cumulativa è $1 - e^{-(r/\beta)}$, con β che divide r , che sostituendo ritorna esattamente quella nella slide. Questa nuova forma ci ritorna una $exp(\beta) = exp(1/\lambda)$, ovvero quello che cercavamo. Sul quaderno c'è.

Theorem 2

If arrivals occur at random with rate λ , the corresponding interarrival times form an iid sequence of $\text{Exponential}(1/\lambda)$ RVs.

This result justifies the use of *Exponential* interarrival times in programs ssq2, ssq3, sis3, sis4

- If we know only that arrivals occur at random with a constant rate λ , the function `GetArrival` in `ssq2` and `ssq3` is appropriate
- If we know only that demand instances occur at random with a constant rate λ , the function `GetDemand` in `sis3` and `sis4` is appropriate

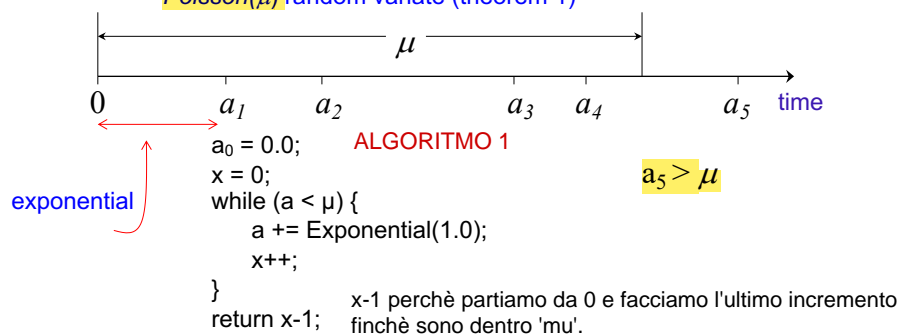
13

Supponiamo $\lambda = 1$

Generating Poisson random variates

Observation:

- If arrivals occur at random with rate $\lambda=1$
- the number of arrivals X in an interval of length μ will be a $\text{Poisson}(\mu)$ random variate (theorem 1)



14

Summary of Poisson arrival processes

Given a fixed time interval $(0, t)$, there are two ways of generating a realization of a stationary Poisson arrival process with rate λ

come generare la Poisson:

1. Generate the number of arrivals: $n = \text{Poisson}(\lambda t)$
Generate a $\text{Uniform}(0, t)$ random variate sample of size n and sort to form $0 < a_1 < a_2 < a_3 < \dots < a_n$
 2. ^{slide sopra} use algorithm 1 with $\text{Exponential}(1/\lambda t)$
genero tempi interarrivo esponenziali, e poi genero processo Poisson
- Statistically, the two approaches are equivalent
 - The first approach is computationally more expensive, especially for large n
 - The second approach is always preferred

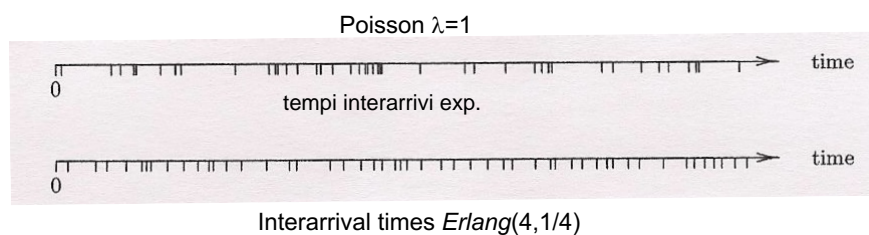
Prof. Vittoria de Nitto Personè

15

15

Summary of Poisson arrival processes

- The *mode* of the exponential distribution is 0
→ A stationary Poisson arrival process exhibits "clustering"



nel primo caso ho alcuni arrivi raggruppati, sotto è più 'uniforme'.

The stationary Poisson arrival process generalizes to

- a stationary arrival process when exponential interarrival times are replaced by any continuous RV with positive support
- a nonstationary Poisson arrival process when λ varies over time

Prof. Vittoria de Nitto Personè

16

16

Per le continue, abbiamo visto come esempi di applicazione il caso degli arrivi: arrivi random, tempi interarrivi exp, numero arrivi poissoniani.

Processi di servizio

Qui le considerazioni sono molto più varie. Il processo dei servizi presenta situazioni variegata, esistono linee guida.

Discrete Simulation
Continuous RV applications

For our application framework, we will look at:

- arrival process model
- service process model

Prof. Vittoria de Nitto Personè 17

17

Discrete Simulation
Continuous RV applications

Service Process Models

differently from the case of arrival processes, there are no well-defined “default”, only application-dependent guidelines:

- *Uniform(a, b)* service times are usually inappropriate since they rarely “cut off” at a maximum value *b*
- Service times are positive, so they cannot be *Normal(μ, σ)* unless truncated to positive values
- Positive probability models “with tails”, such as the *Lognormal(a, b)* distribution, are candidates
anche Pareto!
- If service times are the sum of *n* iid *Exponential(b)* sub-task times, then the *Erlang(n, b)* model is appropriate

- jobs UNIX
- web file size
- Internet topology
- IP packet flow
- ...

Non esiste regola generale, negli arrivi stavo tranquillo con l'Esponenziale per la maggior parte dei casi. Sui servizi devo capire bene cosa sia adatto.

Prof. Vittoria de Nitto Personè 18

18

La Normale prende anche valori negativi, o non la uso o la tronco.

Program ssq4

(ssq3 aveva Uniform)

- *ssq4* is based on program *ssq3*, but with a more realistic *Erlang*(5, 0.3) service time model $5 \cdot 0.3 = 1.5$, come *ssq3*
The corresponding service rate is $2/3$
- As in program *ssq3*, *ssq4* uses *Exponential*(2) random variate interarrivals.
The corresponding arrival rate is $1/2$ frequenza è 0.5

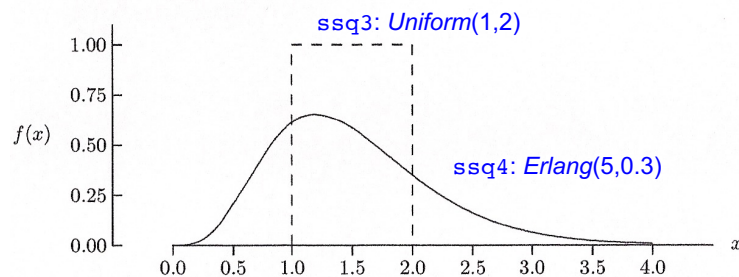
Prof. Vittoria de Nitto Personè

19

19

Example

- For both *ssq3* and *ssq4*, the arrival rate is $\lambda=0.5$ and the service rate is $\nu=2/3 \approx 0.667$
- The distribution of service times for two programs is very different **a parità di media**



first conjecture how the steady-state statistics will differ for these two programs and then investigate the correctness of your conjecture via discrete-event simulation

Prof. Vittoria de Nitto Personè

20

20

Che differenza di prestazioni si ha tra Uniform ed Erlang?

Example

- suppose using a *Normal*(1.5,2.0) random variable to model service times
- Truncate distribution so that
 - Service times are non-negative ($a=0$) sia Uniform che Erlang
 - Service times are less than 4 ($b=4$) hanno tempi tra 0 e 4.

come troncature? conosco i punti.

```
α = cdfNormal(1.5, 2.0, a); /* a is 0.0 */
β = 1.0 - cdfNormal(1.5, 2.0, b); /* b is 4.0 */
```

- the result: $\alpha = 0.2266$ and $\beta = 0.1056$ uso le cumulative per calcolare le 'probabilità' date i punti 0 e 4, definendo le due probabilità di coda

NB

the *truncated Normal*(1.5,2.0) random variable has a mean of 1.85 (not 1.5) and a standard deviation of 1.07 (not 2.0)

Why is the mean increased?????

Prof. Vittoria de Nitto Personè

21

21

E' ovvio perchè ho tolto dei 'pezzi', quindi tutto è più concentrato verso il 'centro'.

Come posso generare queste variabili variare troncate?
cioè per modellare questa distribuzione troncata?

Constrained Inversion

Noi usiamo l'inversione vincolata, ovvero: calcolate alfa e beta, parto dalla probabilità in quel range. Genero $0 < u < 1$ per costruire la variata, la metto già nell'insieme troncato.

once α and β are determined, the corresponding truncated random variate can be generated by using constrained inversion

```
u = Uniform(α, 1.0 - β);
return F-1(u);
```

Exercise:

- generate n truncated random variates;
- compute sample mean and standard deviation (by Welford)
- verify for which n the statistics converge to the theoretical values (quelli scritti nella slide precedente)

Prof. Vittoria de Nitto Personè

22

22

Example (cont.)

- The idf capability in `rvms` can be used to generate the *truncated* $Normal(1.5, 2.0)$ RV

$\alpha = 0.2266274$;

$\beta = 0.1056498$;

$u = \text{Uniform}(\alpha, 1.0 - \beta)$;

`return idfNormal(1.5, 2.0, u);`

genero valore tra alfa e 1-beta,
questo u generato è $u = 0.7090$, l'inversa
della normale ritorna $x = 2.601$

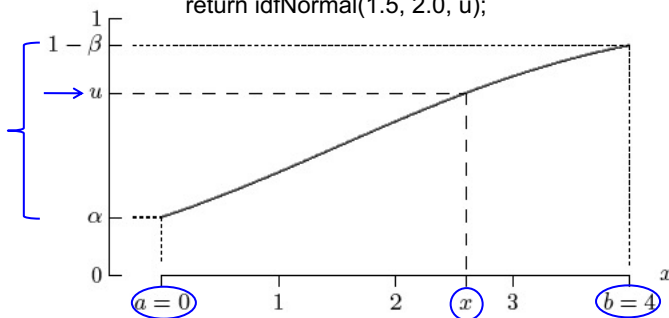


Figure shows $u=0.7090$ and $x=2.601$

Prof. Vittoria de Nitto Personè

23

23

Exercises

- Exercise 7.3.1

Prof. Vittoria de Nitto Personè

24

24