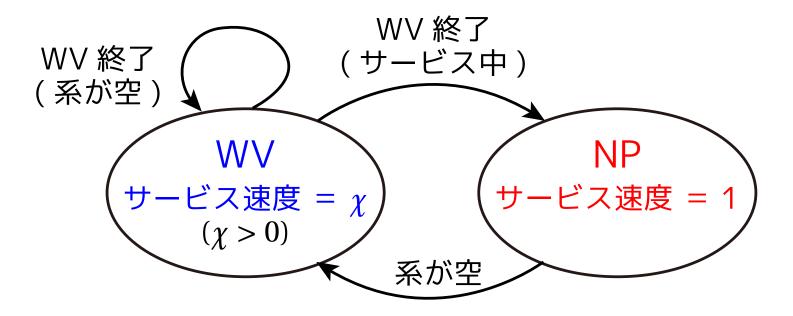
Working Vacation をもつ MAP/G/1 待ち行列の系内仕事量分布

*井上文彰, 滝根 哲哉

大阪大学工学研究科 電気電子情報工学専攻

考察するモデル

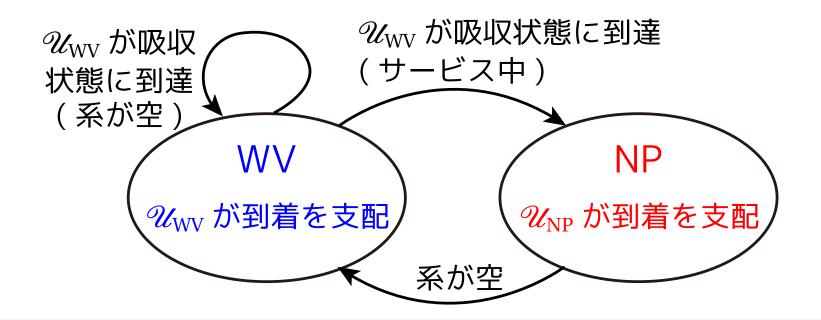
- サーバは χ ($\chi > 0$) と 1 の 2 種類のサービス速度をもつ
 - lacktriangle Working Vacation (WV) : サービス速度が χ である期間
 - ◆ Normal-Service Period (NP): サービス速度が 1 である期間



● 客の到着過程は、WV と NP で異なる 背後マルコフ連鎖に支配される MAP

背後マルコフ連鎖 WWV と WNP

- Www:連続時間有限状態吸収マルコフ連鎖
 - ◆ WV における客の到着過程 と WV の終了 を支配
- WNP: 既約な連続時間有限状態マルコフ連鎖
 - ◆ NP における客の到着過程 を支配



系の背後状態

 $M_{WV} = \{1,2,...,M_{WV}\}: \mathcal{U}_{WV}$ の状態空間から全ての吸収状態を除いて得られる部分状態空間

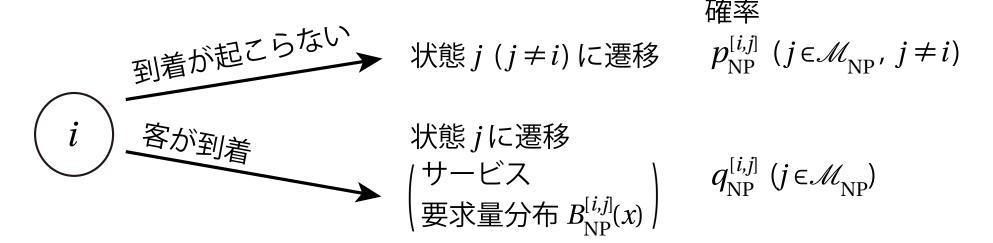
 $\mathcal{M}_{NP} = \{1, 2, ..., M_{NP}\}$: \mathcal{U}_{NP} の状態空間

- ある時刻における系の背後状態を、次の二つ組で定義
 - ◆ その時刻が属する期間 (WV または NP)
 - ◆ その時刻に到着を支配する背後マルコフ連鎖の状態
- ℳ:系の背後状態全体がなす集合

$$\mathcal{M} = \{ (WV, 1), (WV, 2), \dots, (WV, M_{WV}), (NP, 1), (NP, 2), \dots, (NP, M_{NP}) \}$$

NP における背後マルコフ連鎖 WNP

- 状態 i ($i \in \mathcal{M}_{NP}$) に平均 $1/\sigma_{NP}^{[i]}$ の指数分布に従う時間だけ滞在
 - ◆ 状態 *i* での滞在が終了すると下図のように遷移

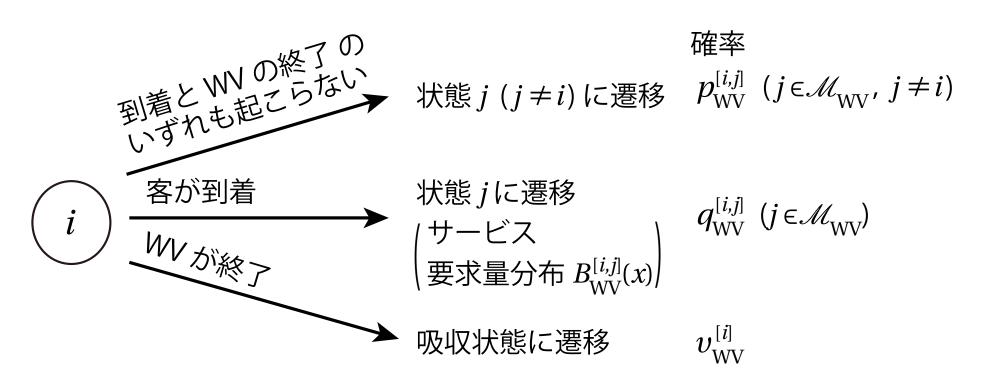


- 系が空になると、NP から WV への遷移が発生
 - $igap M_{\mathrm{NP}} \times M_{\mathrm{WV}}$ の遷移確率行列 $\Psi_{\mathrm{NP,WV}}$ に従って背後状態は遷移

 $[\Psi_{\text{NP,WV}}]_{i,j}: (NP,i)$ であるときに系が空になったという 条件の下で背後状態が (WV,j) に遷移する確率

WV における背後マルコフ連鎖 W_{WV} (1)

- 状態 i ($i \in \mathcal{M}_{WV}$) に平均 $1/\sigma_{WV}^{[i]}$ の指数分布に従う時間だけ滞在
 - ◆ 状態 i での滞在が終了すると下図のように遷移



WV における背後マルコフ連鎖 W_{WV} (2)

状態 i での滞在終了時に吸収状態に到達すると、

- 客がサービス中のとき
 - lacktriangle 確率 $v_{\mathrm{WV,NP}}^{[j|i]}$ $(j \in \mathcal{M}_{\mathrm{NP}})$ で系の背後状態は (NP,j) へ遷移
- 系が空であるとき
 - lacktriangle 確率 $\sum_{j' \in M_{\mathrm{NP}}} v_{\mathrm{WV,NP}}^{[j'|i]} [\Psi_{\mathrm{NP,WV}}]_{j',j} \ (j \in \mathcal{M}_{\mathrm{WV}})$ で

系の背後状態は (WV, j) へ遷移

行列を用いた背後マルコフ連鎖の表現 (1)

• \mathcal{U}_{WV} の挙動を, $M_{WV} \times M_{WV}$ 行列 C_{WV} と $D_{WV}(x)$ (x>0) ならびに $M_{WV} \times M_{NP}$ 行列 $\Upsilon_{WV,NP}$ を用いて表現

$$\left[\boldsymbol{C}_{\text{WV}} \right]_{i,j} = \left\{ \begin{array}{ll} -\sigma_{\text{WV}}^{[i]}, & i=j & \sigma_{\text{WV}}^{[i]}: 状態 \ i \ \text{から遷移する率} \\ \\ \sigma_{\text{WV}}^{[i]} p_{\text{WV}}^{[i,j]}, & i \neq j & \text{客の到着, WV の終了を伴わず } \\ \text{に状態} \ i \ \text{から} \ j \ \text{へ遷移する率} \end{array} \right.$$

サービス要求量が
$$x$$
 以下
$$[\mathbf{D}_{WV}(x)]_{i,j} = \sigma_{WV}^{[i]} q_{WV}^{[i,j]} B_{WV}^{[i,j]}(x)$$
 である客の到着を伴って 状態 i から j へ遷移する率

$$\left[\mathbf{\Upsilon}_{\mathrm{WV,NP}}\right]_{i,j} = \sigma_{\mathrm{WV}}^{[i]} v_{\mathrm{WV}}^{[j|i]} v_{\mathrm{WV,NP}}^{[j|i]}$$
 吸収状態へ到達して WV が終了し 状態 $j \left(j \in \mathcal{M}_{\mathrm{NP}}\right)$ へ遷移する率

行列を用いた背後マルコフ連鎖の表現 (2)

ullet $\mathcal{U}_{\mathrm{NP}}$ の挙動を, $M_{\mathrm{NP}} imes M_{\mathrm{NP}}$ 行列 $oldsymbol{C}_{\mathrm{NP}}$ および $oldsymbol{D}_{\mathrm{NP}}(x)$ (x>0) を用いて表現

サービス要求量が
$$x$$
 以下
$$[\mathbf{D}_{NP}(x)]_{i,j} = \sigma_{NP}^{[i]} q_{NP}^{[i,j]} B_{NP}^{[i,j]}(x)$$
 である客の到着を伴って 状態 i から j へ遷移する率

系の安定性

$$m{D}_{\mathrm{WV}} = \lim_{x \to \infty} m{D}_{\mathrm{WV}}(x), \qquad m{D}_{\mathrm{NP}} = \lim_{x \to \infty} m{D}_{\mathrm{NP}}(x)$$
 $m{D}_{\mathrm{WV}}^*(s) : m{D}_{\mathrm{WV}}(x) \ \mathcal{O} \ \mathsf{LST}, \qquad m{D}_{\mathrm{NP}}^*(s) : m{D}_{\mathrm{NP}}(x) \ \mathcal{O} \ \mathsf{LST}$

- ℳWV に属する各状態は互いに到達可能であると仮定
 - ightharpoonup 過渡的なマルコフ連鎖の生成作用素 $C_{WV} + D_{WV}$ は既約
- $\mathbf{D}_{WV} \neq \mathbf{0}$, $\mathbf{\Upsilon}_{WV,NP} \neq \mathbf{0}$ および $\overline{\boldsymbol{\pi}}_{NP} \int_0^\infty x d\mathbf{D}_{NP}(x) \mathbf{e}_{NP} < 1$ を仮定
 - ◆ π_{NP}: C_{NP} + D_{NP} の不変確率ベクトル
 - ◆ **e**_{NP}:全ての要素が 1 である M_{NP}×1 ベクトル (**e**_{WV} も同様に定義)
- これらの仮定が満たされるとき、系は安定であることが示される

系内仕事量分布の定義

 U_{WV} : 定常状態において WV にあるという条件下での系内仕事量

 $S_{
m WV}$:定常状態において WV にあるという条件下での ${\it W}_{
m WV}$ の状態

 $U_{
m NP}$: 定常状態において NP にあるという条件下での系内仕事量

 $S_{
m NP}$:定常状態において NP にあるという条件下での $w_{
m NP}$ の状態

- $u_{WV}(x)$: WV における系内仕事量分布を表す $1 \times M_{WV}$ ベクトル $[u_{WV}(x)]_j = \Pr(U_{WV} \leq x, S_{WV} = j \mid WV)$
- $oldsymbol{u}_{\mathrm{NP}}(x): \mathsf{NP}\ における系内仕事量分布を表す <math>1 \times M_{\mathrm{NP}}\ ilde{\wedge} \mathsf{OP}$ に $[oldsymbol{u}_{\mathrm{NP}}(x)]_j = \mathrm{Pr}(U_{\mathrm{NP}} \leq x, S_{\mathrm{NP}} = j \mid \mathrm{NP})$
- $u_{WV}^*(s)$: $u_{WV}(x)$ \mathcal{O} LST, $u_{NP}^*(s)$: $u_{NP}(x)$ \mathcal{O} LST
- Pr(WV): サーバが WV にある確率, Pr(NP) = 1 Pr(WV)

発表の概要

- Working Vacation をもつ MAP/G/1 の系内仕事量分布を考察
 - \bullet $u_{WV}^*(s)$, $u_{NP}^*(s)$, および Pr(WV) を導出
- 最初に、このモデルの解析はサービス速度が 常に一定 ($\chi = 1$) である場合の解析に帰着されることを示す

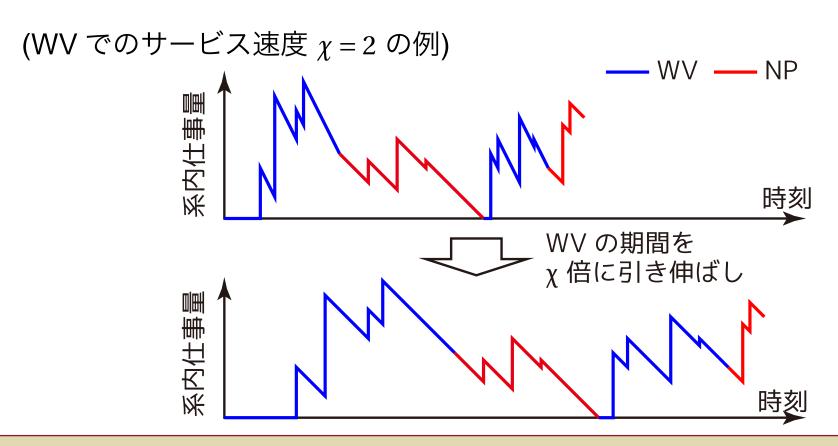
次に、 $\chi = 1$ の場合に対して

- $u_{WV}^*(s)$ を, Disaster が起こる MAP/G/1 に対する解析結果 [井上, 滝根 (2012)] を用いて導出
 - lacktriangle その結果をもとに $oldsymbol{u}_{\mathrm{NP}}^*(s)$ と $\mathrm{Pr}(\mathrm{WV})$ を導出

サービス速度が常に一定であるモデルと、 WVとNPで異なるモデルとの関係

時間軸の引き伸ばし

- ullet WV にある期間の時間軸を χ 倍に引き伸ばした新しいモデル
 - ◆ サービス速度は常に 1
 - lacktriangle \mathcal{U}_{WV} が遷移する速さは元のモデルの $1/\chi$



時間軸の引き伸ばし

- ullet WV にある期間の時間軸を χ 倍に引き伸ばした新しいモデル
 - ◆ サービス速度は常に1
 - lacktriangle \mathcal{U}_{WV} が遷移する速さは元のモデルの $1/\chi$
- ightharpoonup 元のモデルの C_{WV} , $D_{WV}(x)$, $\Upsilon_{WV,NP}$ をそれぞれ
 - $C_{WV}^{new} = C_{WV}/\chi$, $D_{WV}^{new}(x) = D_{WV}(x)/\chi$, $Y_{WV}^{new} = Y_{WV}/\chi$

で置き換え, $\chi^{\text{new}} = 1$ としたモデルに等しい

(new をつけることにより,新しいモデルの量であることを表す)

元のモデルと新しいモデルの関係 [Takine (2005)]

- サーバが WV (あるいは NP) にあるという 条件下における時間平均量は一致
 - ◆ 特に、 $u_{WV}(x) = u_{WV}^{new}(x)$ および $u_{NP}(x) = u_{NP}^{new}(x)$ が成立
- 何らかの事象が発生する時点での事象平均量は一致 (WV が終了する時点など)
- サーバが WV にある確率に関して次式が成立

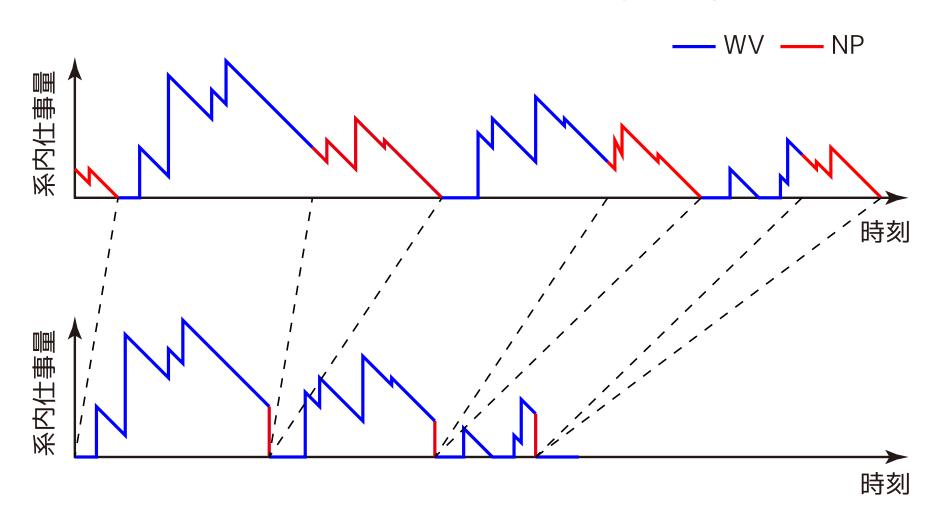
$$Pr(WV) = \frac{Pr(WV^{new})}{Pr(WV^{new}) + \chi Pr(NP^{new})}$$

- ightharpoons 系内仕事量分布の解析は, $\chi=1$ のモデルの解析に帰着される
- ullet 以降では、 $\chi=1$ の場合に限って解析を行う

WVにおける系内仕事量分布

WVにおける系内仕事量過程

Disaster が起こる待ち行列の系内仕事量過程と等価



WVにおける系内仕事量過程

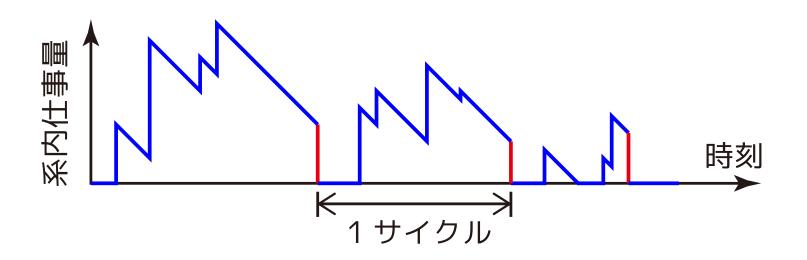
- Disaster が起こる待ち行列の系内仕事量過程と等価
- $oldsymbol{C}_{\mathrm{WV}}, oldsymbol{D}_{\mathrm{WV}}(x), \hat{oldsymbol{\Gamma}}_{\mathrm{WV}}(x)$ によって特徴づけられる
 - ◆ *C*_{WV} : 客の到着と disaster のいずれも 発生しないときの無限小生成作用素
 - ◆ D_{WV}(x): サービス要求量が x 以下の客の 到着が発生するときの遷移率行列
 - $\hat{\Gamma}_{WV}(x) = \Upsilon_{WV,NP} \exp(\mathbf{Q}_{NP} x) \Psi_{NP,WV}$

: 系内仕事量が x であるという条件下において disaster が発生するときの遷移率行列

 $\exp(\mathbf{Q}_{\mathrm{NP}}x)$: NP において系内仕事量が x である時点から,その後初めて系が空になるまでの $\mathscr{U}_{\mathrm{NP}}$ の状態遷移を表す遷移確率行列 \mathbf{Q}_{NP} は数値的に求められる

$\hat{\Gamma}_{\mathrm{WV}}(x)$ の置き換え (1)

- [井上, 滝根 (2012)] では, $\hat{\Gamma}_{WV}(x)$ が x によらず 一定である場合の解析結果が得られている
 - ◆ 以下のようにして、この結果を今のモデルに適用する
- disaster の発生直後から、次の disaster の発生直後 までの時間間隔として定義されるサイクルを考える



$\hat{\Gamma}_{\mathrm{WV}}(x)$ の置き換え (1)

- [井上, 滝根 (2012)] では, $\hat{\Gamma}_{WV}(x)$ が x によらず 一定である場合の解析結果が得られている
 - ◆ 以下のようにして、この結果を今のモデルに適用する
- disaster の発生直後から、次の disaster の発生直後 までの時間間隔として定義されるサイクルを考える
- 一つのサイクルの間の系内仕事量過程の振る舞い
 - ◆ サイクルの開始時点での Www の状態によって完全に定まる
- ➡ η^B_{WV}: Disaster 発生直後 (WV 終了直後) における ω_{WV} の定常状態確率ベクトル

が等しければ、 $\hat{\Gamma}_{WV}(x)$ を置き換えても系内仕事量分布は同じ

$\hat{\Gamma}_{\mathrm{WV}}(x)$ の置き換え (2)

- $m{\eta}_{\mathrm{WV}}^{\mathrm{B}}$: Disaster 発生直後 (WV 終了直後) における $\mathcal{U}_{\mathrm{WV}}$ の定常状態確率ベクトル が等しければ、 $\hat{\Gamma}_{\mathrm{WV}}(x)$ を置き換えても系内仕事量分布は同じ
- Disaster が発生するときの遷移率行列 Γ_{WV} が x によらず $\Gamma_{WV} = \Upsilon_{WV,NP} e_{NP} \eta_{WV}^B$

となる新しい系内仕事量過程を考える

- lacktriangle disaster が発生すると状態がリセットされ, 元のモデルの分布 $oldsymbol{\eta}_{WV}^B$ に従って状態が決め直される
- $u_{WV}(x)$ は C_{WV} , $D_{WV}(x)$, Γ_{WV} で特徴付けられる disaster をもつ MAP/G/1 の系内仕事量分布に等しい

WV における系内仕事量分布の LST $u_{WV}^*(s)$

● 次の二つの式が成り立つ [井上, 滝根 (2012)]

$$u_{WV}^*(s)[sI_{WV} + C_{WV} + D_{WV}^*(s)] = su_{WV}(0) - \pi_{WV}\Gamma_{WV}$$

 $u_{WV}^*(s) = u_{WV}(0)[I_{WV} - R_{WV}^*(s)]^{-1}$

ただし、 I_{WV} は $M_{WV} \times M_{WV}$ の単位行列を表し、

- \bullet π_{WV} : $C_{WV} + D_{WV} + \Gamma_{WV}$ の不変確率ベクトル
- $\mathbf{R}^*(s) = \int_0^\infty \exp(-sx) dx \int_x^\infty d\mathbf{D}(x) \exp(\mathbf{Q}_{WV,N}(y-x))$
- $igoplus Q_{\mathrm{WV,N}}$ は次の漸化式で定義される $oldsymbol{Q}_{\mathrm{WV,N}}^{(n)}$ $(n=0,1,\ldots)$ の極限

$$\mathbf{Q}_{\text{WV,N}}^{(0)} = \mathbf{C}_{\text{WV}}, \quad \mathbf{Q}_{\text{WV,N}}^{(n)} = \mathbf{C}_{\text{WV}} + \int_0^\infty d\mathbf{D}_{\text{WV}}(y) \exp(\mathbf{Q}_{\text{WV,N}}^{(n-1)} y)$$

$$(n = 1, 2, ...)$$

WVにおける系内仕事量分布のLST $u_{WV}^*(s)$

● 次の二つの式が成り立つ [井上, 滝根 (2012)]

$$u_{WV}^*(s)[sI_{WV} + C_{WV} + D_{WV}^*(s)] = su_{WV}(0) - \pi_{WV}\Gamma_{WV}$$

 $u_{WV}^*(s) = u_{WV}(0)[I_{WV} - R_{WV}^*(s)]^{-1}$

ullet $oldsymbol{\pi}_{WV}$ は $oldsymbol{\eta}_{WV}^{B}$ を用いて次式で与えられる

$$\boldsymbol{\pi}_{WV} = \frac{\boldsymbol{\eta}_{WV}^{B} [-(\boldsymbol{C}_{WV} + \boldsymbol{D}_{WV})]^{-1}}{\boldsymbol{\eta}_{WV}^{B} [-(\boldsymbol{C}_{WV} + \boldsymbol{D}_{WV})]^{-1} \boldsymbol{e}_{WV}}$$

- $oldsymbol{u}_{\mathrm{WV}}(0)$ は次式で与えられる $oldsymbol{u}_{\mathrm{WV}}(0) = oldsymbol{\pi}_{\mathrm{WV}}[-(oldsymbol{C}_{\mathrm{WV}}+oldsymbol{D}_{\mathrm{WV}})](-oldsymbol{Q}_{\mathrm{WV,N}})^{-1}$
- lacktriangle あとは, $oldsymbol{\eta}_{\mathrm{WV}}^{\mathrm{B}}$ が求められれば $oldsymbol{u}_{\mathrm{WV}}^{*}(s)$ が得られる

$oldsymbol{\eta}_{\mathrm{WV}}^{\mathrm{B}}$ の導出

 θ : C_{WV} と C_{NP} の対角要素の中で最大の絶対値

• $u_{WV}^{(m)}(\theta)$ (m = 0, 1, ...) を次式で定義する

•
$$\mathbf{u}_{\text{WV}}^{(m)}(\theta) = \int_0^\infty \exp(-\theta x) \frac{(\theta x)^m}{m!} d\mathbf{u}_{\text{WV}}(x)$$

• $\hat{\boldsymbol{\kappa}}_{\mathrm{WV}} = \frac{\boldsymbol{u}_{\mathrm{WV}}^{(0)}(\theta)}{\boldsymbol{u}_{\mathrm{WV}}^{(0)}(\theta)\boldsymbol{e}_{\mathrm{WV}}}$ とすると、次式が成立することが示される

$u_{\mathrm{WV}}^{(0)}(heta)$ の導出

• $u_{WV}^{(m)}(\theta)$ (m=0,1,...) は遷移確率行列 T をもつマルコフ連鎖の定常分布に等しいことが示される

•
$$A_0 = I + \theta^{-1}C + \theta^{-1}D_{WV}^{(0)}(\theta), A_m = \theta^{-1}D_{WV}^{(m)}(\theta), m = 1, 2, ...$$

$$\mathbf{D}_{WV}^{(m)}(\theta) = \int_0^\infty \exp(-\theta x) \frac{(\theta x)^m}{m!} d\mathbf{D}_{WV}(x)$$

$$\bullet \quad \boldsymbol{E}_{m} = \theta^{-1} \boldsymbol{\Upsilon}_{\text{WV,NP}} (\boldsymbol{I}_{\text{NP}} + \theta^{-1} \boldsymbol{Q}_{\text{NP}})^{m} \boldsymbol{\Psi}_{\text{NP,WV}}$$

ullet このことを利用すると, $oldsymbol{u}_{\mathrm{WV}}^{(0)}(heta)$ が求められる

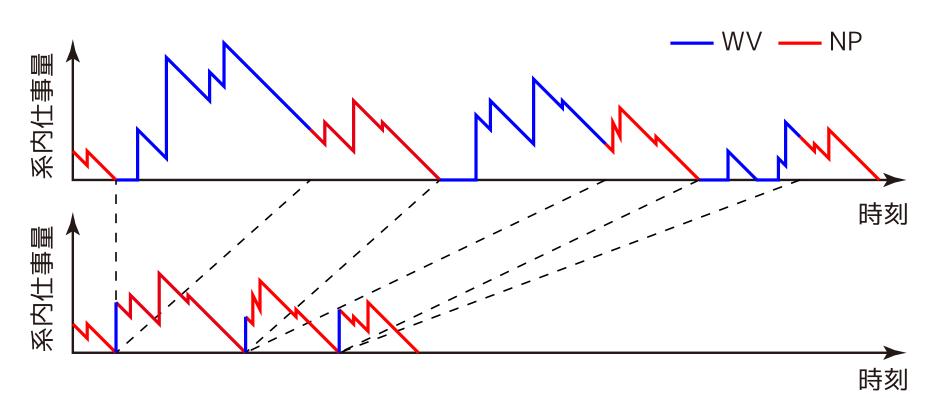
NPにおける系内仕事量分布

NPにおける系内仕事量過程

UND: NP開始時点における系内仕事量

 $S_{ ext{NP}}^{ ext{B}}: \mathsf{NP}$ 開始時点における $\mathscr{U}_{ ext{NP}}$ の状態

ullet 系が空になった瞬間,系内仕事量は $U_{
m NP}^{
m B}$ へ不連続に増加し, $\mathscr{U}_{
m NP}$ の状態は $S_{
m NP}^{
m B}$ に遷移



NPにおける系内仕事量過程

- ullet 系が空になった瞬間,系内仕事量は $U_{
 m NP}^{
 m B}$ へ不連続に増加し, $u_{
 m NP}$ の状態は $S_{
 m NP}^{
 m B}$ に遷移
- $u_{NP}^{B}(x)$: NP 開始時点の系内仕事量分布を表す $1 \times M_{NP}$ ベクトル $[u_{ND}^{B}(x)]_{j} = \Pr(U_{ND}^{B} \leq x, S_{ND}^{B} = j)$
 - $u_{\text{NP,B}}^*(s) : u_{\text{NP}}^{\text{B}}(x) \circlearrowleft \text{LST}$
- 系が空になると状態がリセットされ、 $\mathbf{u}_{NP}^{B}(x)$ に従って次の瞬間の系内仕事量と \mathcal{U}_{NP} の状態が決まる新しい過程を考える
 - ◆ WV のときと同様の議論により, 新しい過程の定常分布は **u**_{NP}(x) に等しい

NPにおける系内仕事量分布のLST $u_{NP}^*(s)$

ullet [Takine (1996)] より, $oldsymbol{u}_{\mathrm{NP}}^*(s)$ は次式で与えられる

$$u_{\text{NP}}^*(s)[sI_{\text{NP}} + C_{\text{NP}} + D_{\text{NP}}^*(s)] = c\eta_{\text{NP}}^{\text{E}}[I_{\text{NP}} - e_{\text{NP}}u_{\text{NP,B}}^*(s)]$$

ただし,

- lacktriangle $oldsymbol{\eta}^{\mathrm{E}}_{\mathrm{NP}}$: NP 終了直前における $\mathscr{U}_{\mathrm{NP}}$ の定常状態確率ベクトル
- ◆ c : NP の平均長の逆数
- ullet $oldsymbol{\eta}^{\mathrm{E}}_{\mathrm{NP}}$ と c は WV における系内仕事量分布 の解析結果を用いて求められる

まとめ

Working Vacation をもつ MAP/G/1 の系内仕事量分布を考察

- 最初に、サービス速度が常に一定 ($\chi = 1$) の場合に限って 解析を行えば十分であることを示し、次に $\chi = 1$ の場合に対して
 - ◆ WV における系内仕事量分布の LST を導出
 - disaster が起こるモデルの結果 [井上, 滝根 (2012)] を利用
 - ◆ NP における系内仕事量分布の LST を導出
 - WV での解析結果と [Takine (1996)] を利用
- サーバが WV にある確率 Pr(WV) は上記の結果をもとに得られる

$$Pr(WV) = \frac{c}{(\boldsymbol{\pi}_{WV} - \boldsymbol{u}_{WV}(0))\boldsymbol{\Upsilon}_{WV,NP}\boldsymbol{e}_{NP} + c}$$