QCon 全球软件开发大会
INTERNATIONAL SOFTWARE DEVELOPMENT CONFERENCE

BEIJING 2017

智能运维里的时间序列

异常检测•根源分析•预测

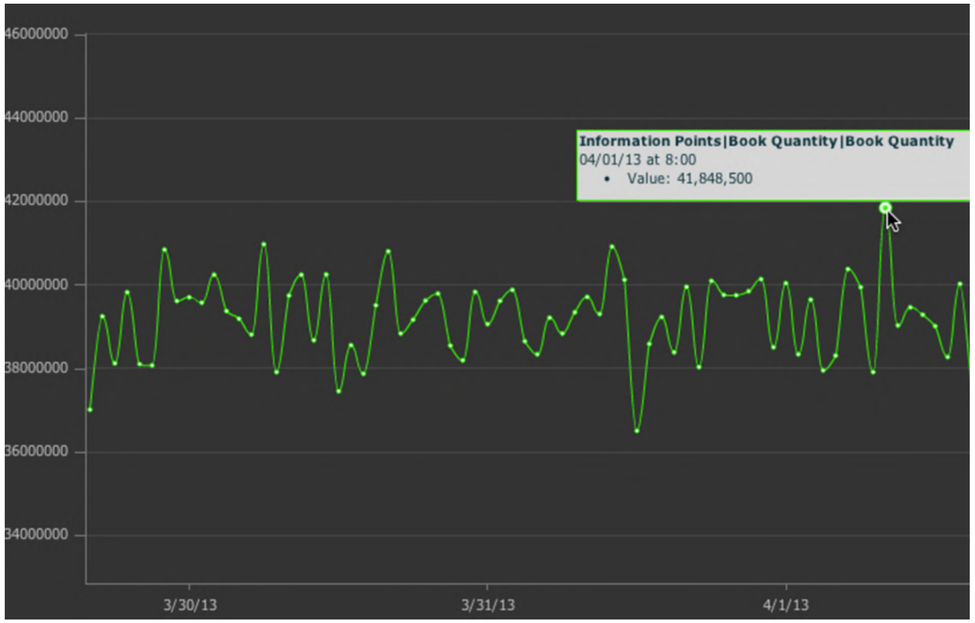
赵宇辰 / 销售易技术VP

主办方 Geekbang 极客邦科技 InfoQ

智能运维里的时间序列

- **性能监控里的时间序列**
- 传统方法
- AI + 时间序列
  - 异常检测
  - 根源分析
- 总结

性能监控里的时间序列



常见的时间序列 / metrics：

- Block Time (ms), Average Block Time (ms)
- Calls, Number of Calls
- Calls/min, Calls per Minute
- CPU Used (ms), JVM CPU Burnt (ms/min)
- Errors/min, Errors per Minute
- Response Time (ms), Average Response Time (ms), Avg. Time per Call
- Slow Transactions, Number of Slow Calls
- Stalled Transactions, Stall Count
- Wait Time (ms), Average Wait time (ms)

性能监控里的时间序列

常见的时间序列类型：

- Backends / 后端
- End User Monitoring / 用户UE
- Mobile / 手机
- Service End Points / 服务端
- Overall Application Performance / 全局
- Business Transaction Performance / 业务相关
- Application Infrastructure Performance / 基础设施
- Errors / 错误

性能监控里的时间序列

常见的时间序列计算：

- 原始数值（observation）
- 最小值 / 最大值（min / max）
- 总和（sum）
- 平均值（avg）
- 数量（count）
- 百分比（%）
- 百分位数（percentile）

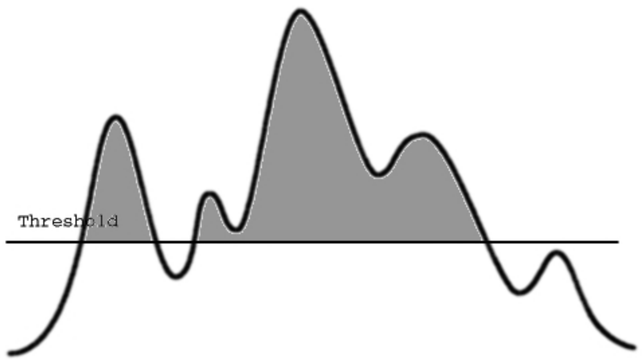
智能运维里的时间序列

- 性能监控里的时间序列
- **传统方法**
- AI + 时间序列
  - 异常检测
  - 根源分析
- 总结

传统方法

方法一：固定阈值

- 如果value > 阈值X，发出警报
- 如果value < 阈值Y，发出警报



传统方法

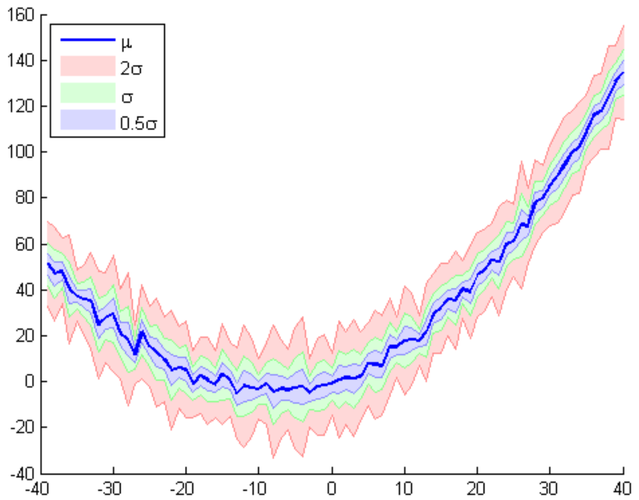
方法二：动态阈值

- 计算

（1）平均值 μ

（2）方差 σ

- 正常取值区间：μ ± 2σ
- 如果value在区间外，发出警报



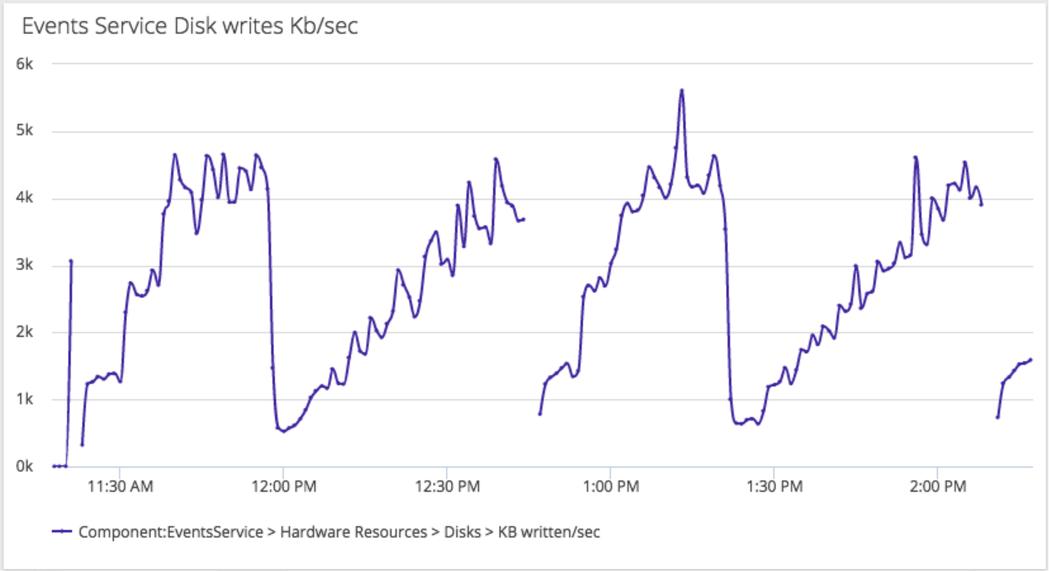
传统方法往往效果不好

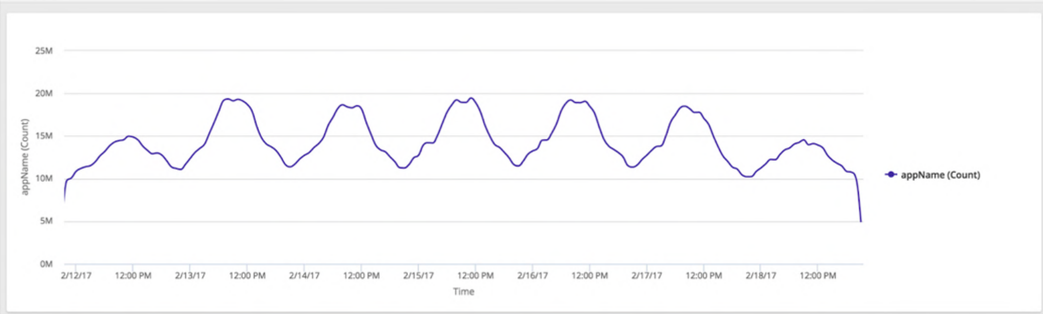
原因1:
忽视周期性（seasonality）

周期性的时间序列

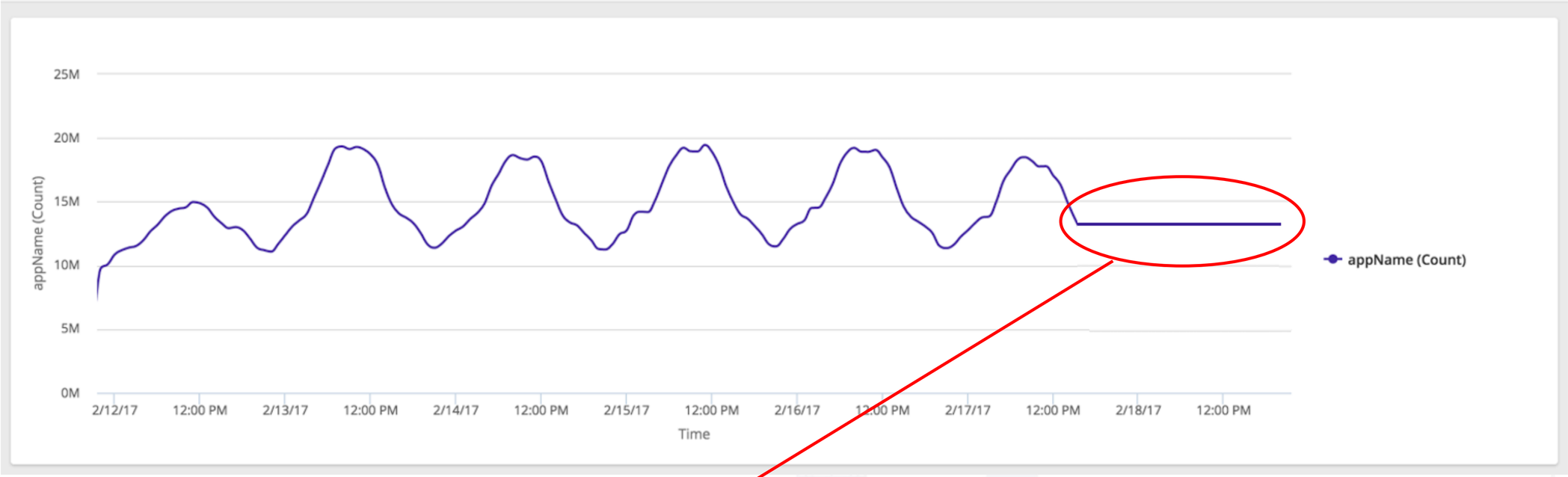
例子：

- 每两小时的定时任务（cron job）
- 每两周升级计划





周期性的时间序列



在平均值附近，传统方法不会发出警报，

但是否真的没有异常？

原因2:
忽视趋势（trend）

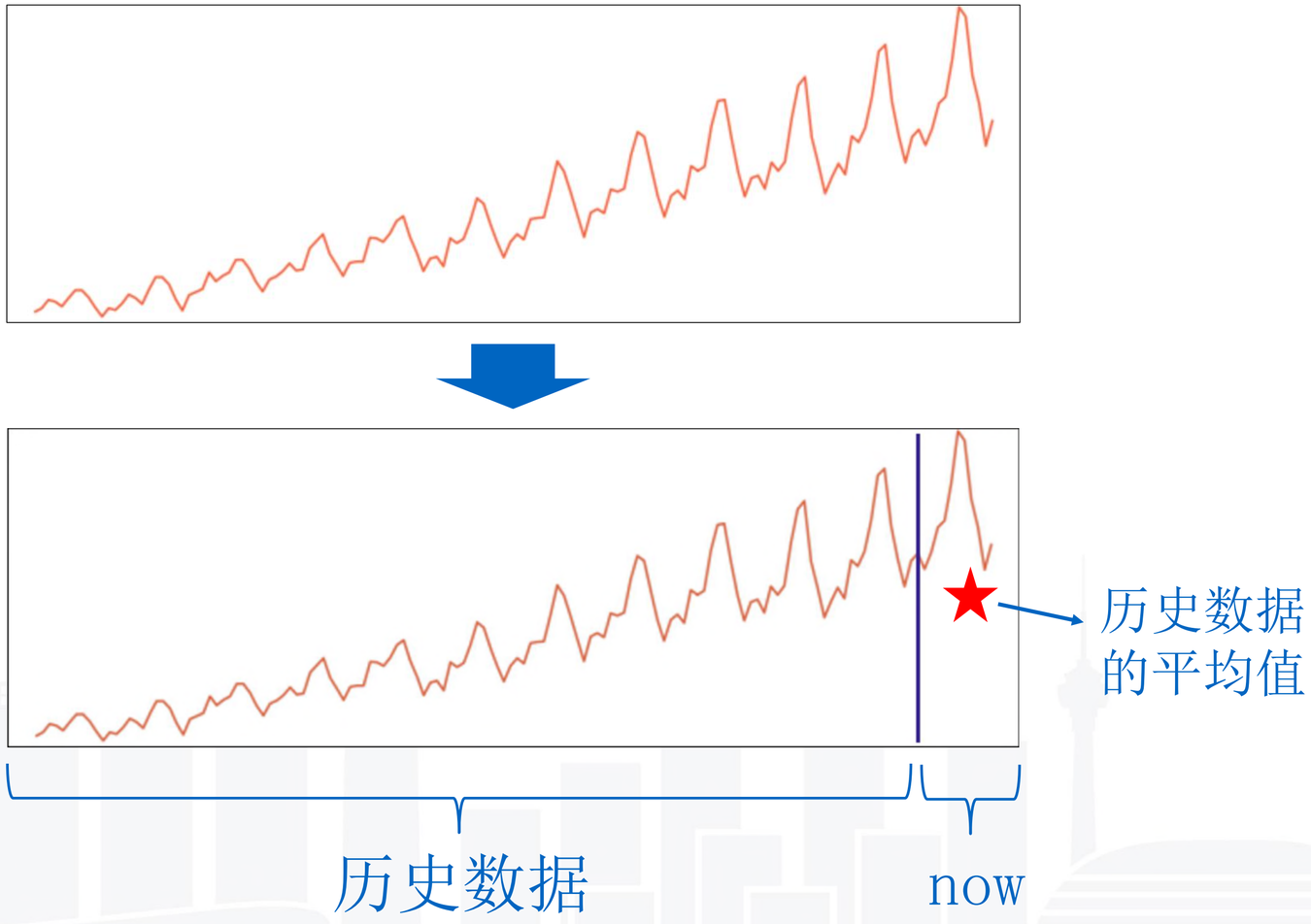
时间序列里的趋势

时间序列里往往包含趋势：

- 增长的趋势
- 降低的趋势

传统方法（固定阈值 / 历史平均值）

- 用过去的数据作为标准
- 造成误判（false positive）



原因3:
数据是不完美的

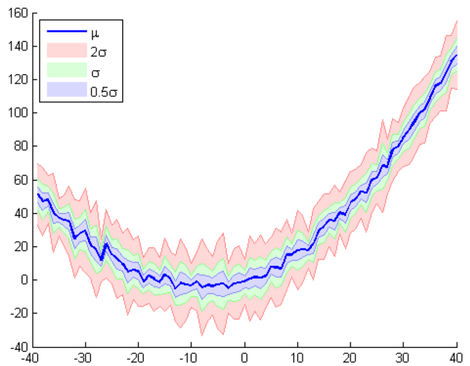
理论看上去很美

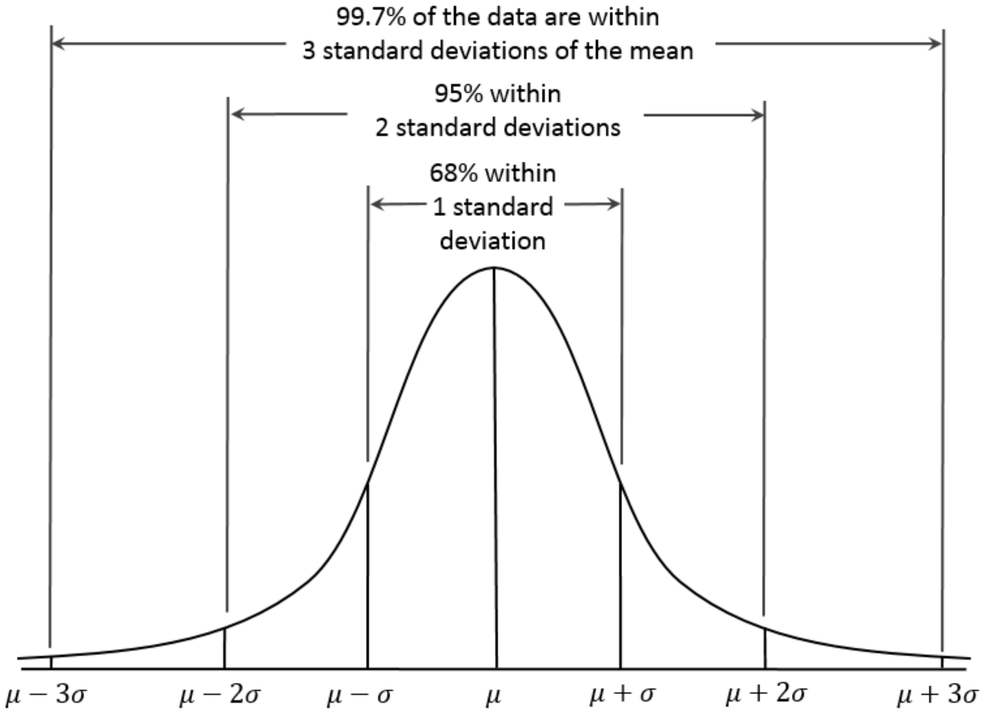
- 计算

（1）平均值 μ

（2）方差 σ

- 正常取值区间：μ ± 2σ
- 如果value在区间外，发出警报





基于normal distribution的假设

即便数据符合normal distribution…

假设每个metric每一分钟有一个值（比如errors per min, avg latency per min等）

- 每天有：1 x 60 x 24 = 1,440 数据点
- 假设我们用μ ± 3σ区间
- 根据normal distribution定义，99.7% 的数据在该范围内
- 1,440 x 99.7% = 1435.68个数据点被认为正常
- 系统认为1,440-1435.68 = 4.32个数据点为异常

这意味着：

- 即使完全正常，每天每个metric会收到4.32个错误警报提醒（false alarms）！

原因4:
数据孤岛

数据孤岛

- 每个metric被单独考虑
- 系统里有成千上万个metric
- 彼此相互联系 / 关联
- 能否把所有的metrics联合起来一起考虑？

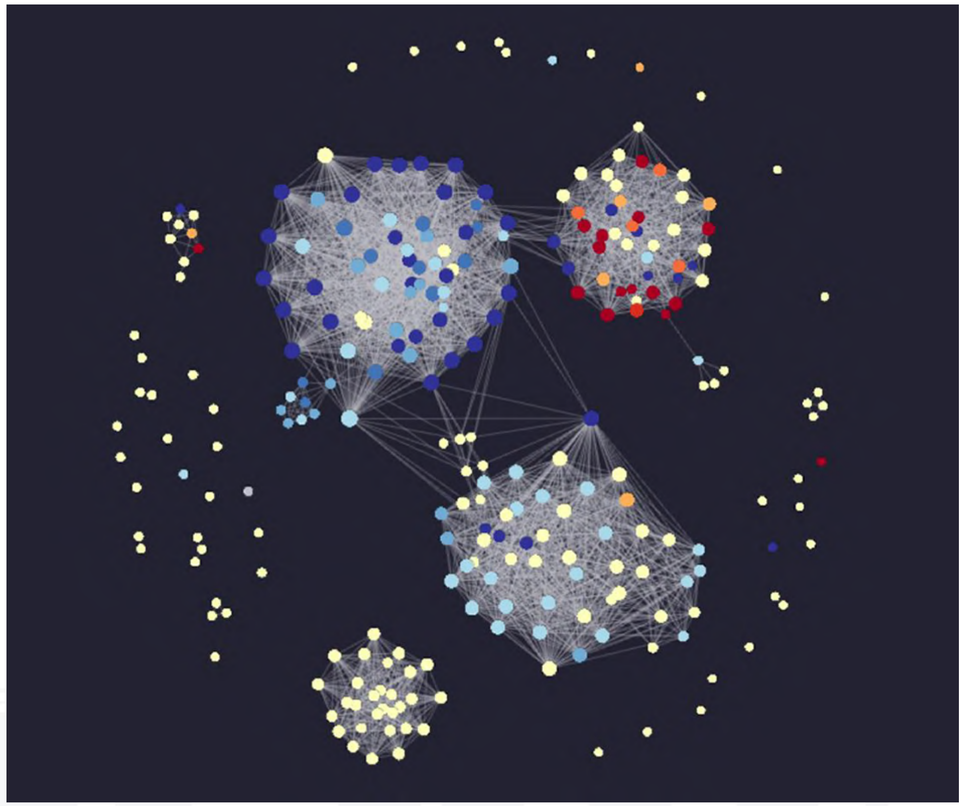


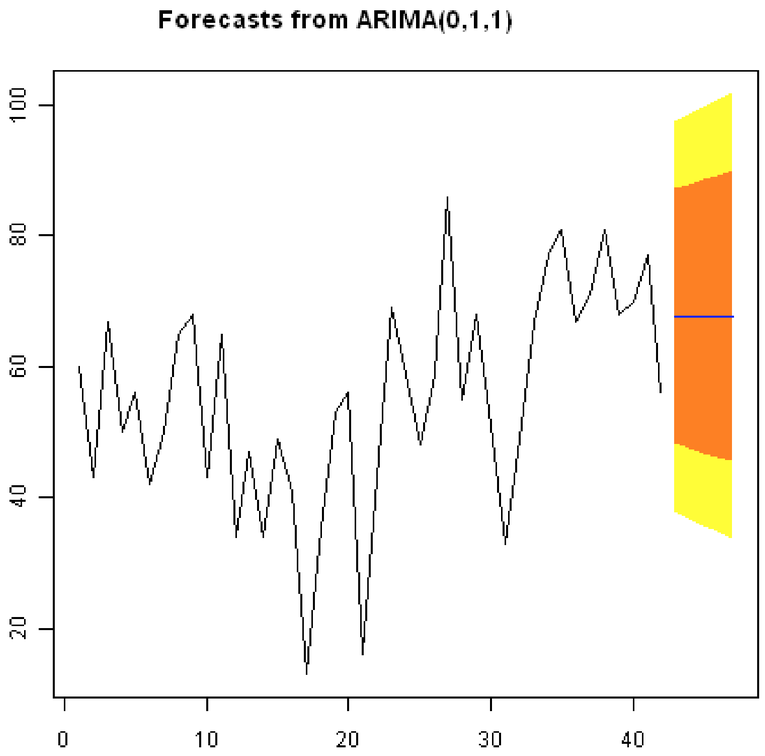
Photo Credit: Argos @ Uber

智能运维里的时间序列

- 性能监控里的时间序列
- 传统方法
- AI + 时间序列
  - 异常检测
  - 根源分析
- 总结

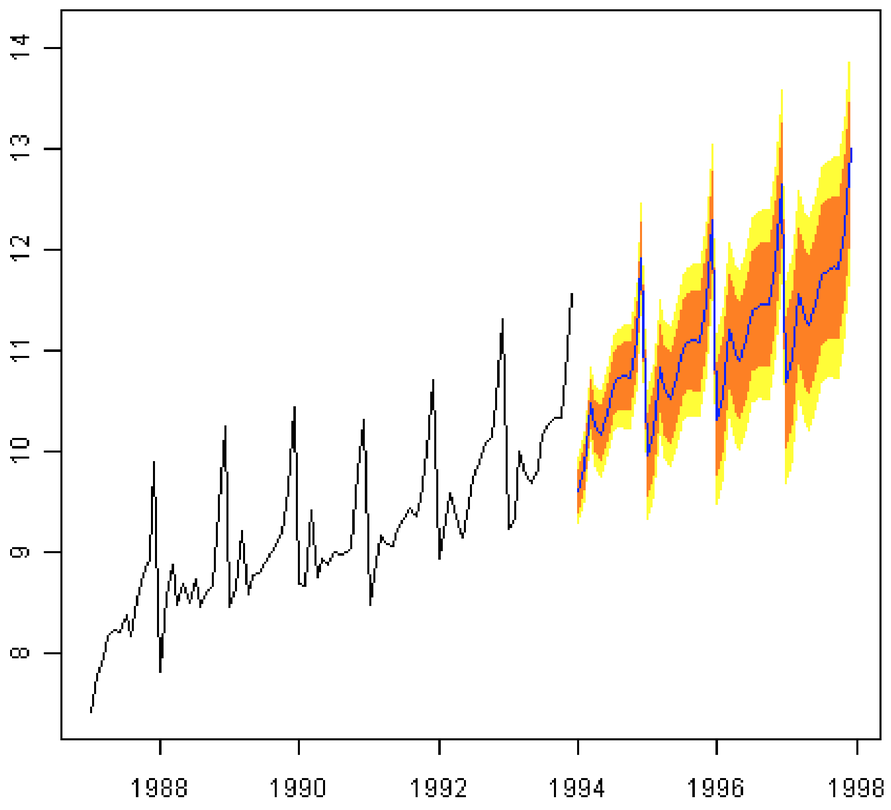
Moving Average Based

- 对历史值赋予不同权重
- Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA)
- 几乎所有的time series包里都有实现
- 缺点：
  - 需手动设置参数
  - assumption较为简单



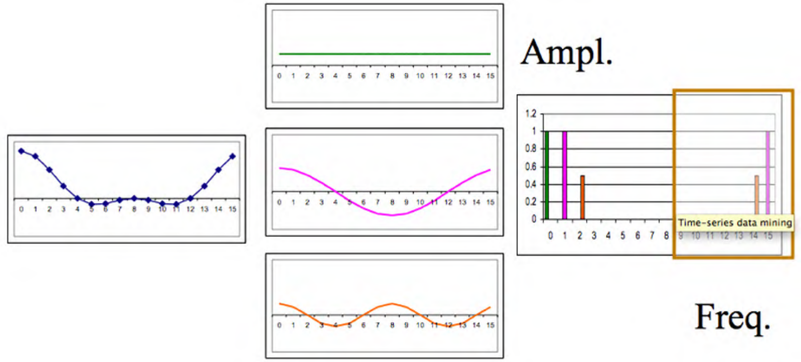
Exponential Smoothing Based

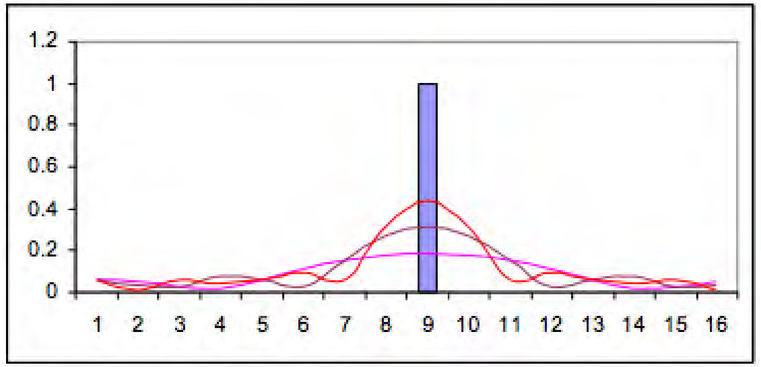
- Double exponential (Holt-Linear):
  - 能追踪level和trend
- Triple exponential:
  - 能追踪level和trend
  - 还能追踪seasonality
- 缺点：
  - 需手动设置参数



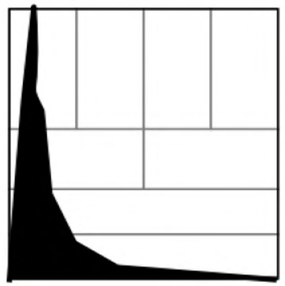
分解（decomposition） Based

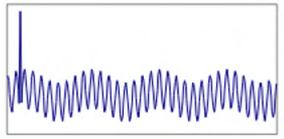
- DFT (Discrete Fourier Transform) / 傅立叶分解
  - 对周期性数据效果较好
  - 对spike model能力较弱



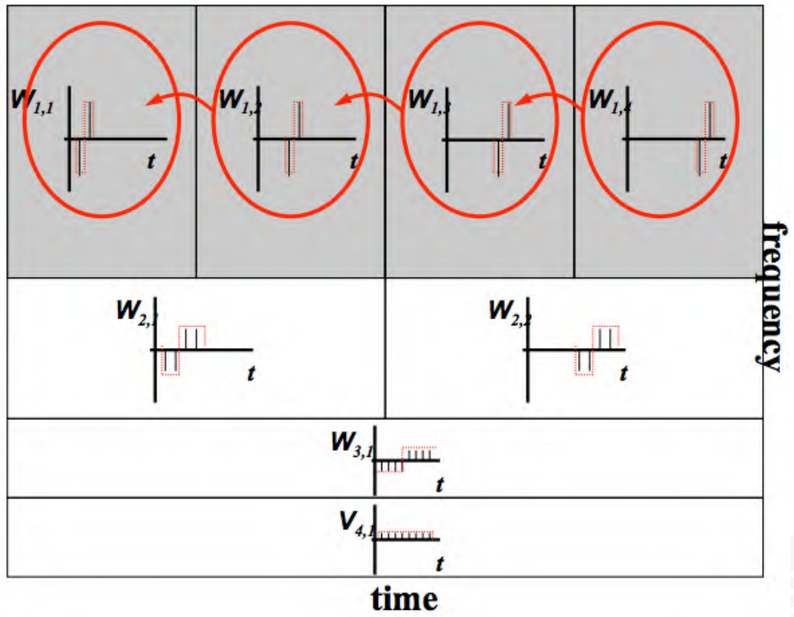


分解（decomposition） Based





- DWT (Discrete Wavelet Transform) / 小波分解
  - 速度快，压缩能力强
  - 对spike等异常非常有效
- 在分解后的模块（比如小波分解后的components）上再进行auto regression

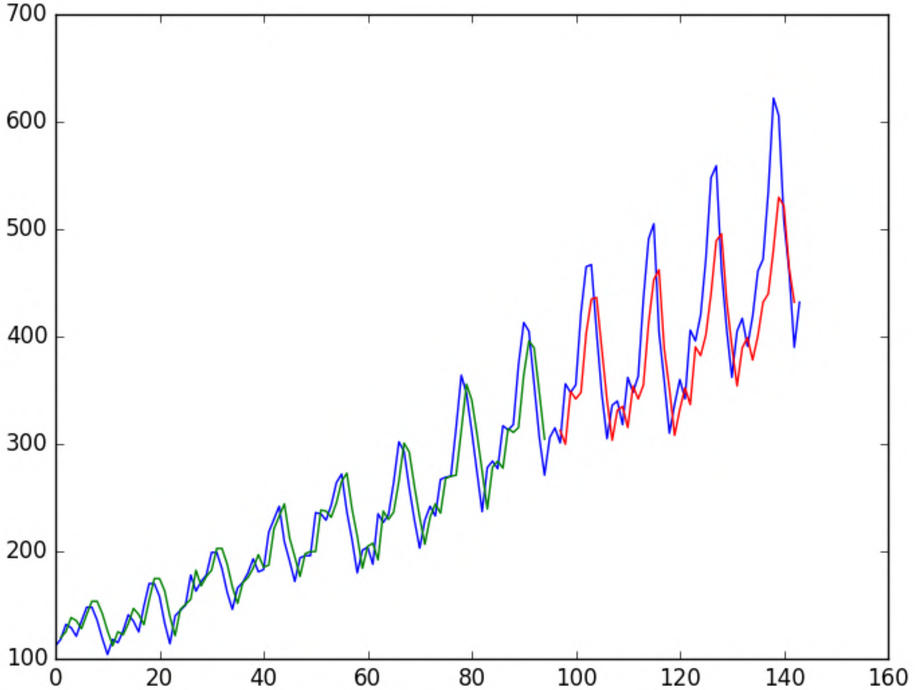


深度学习（Deep Learning） Based

- Feedforward Neural Network
- Recurrent Neural Network (e.g., LSTM)
- Convolutional Neural Network

LSTM 例子:

- 1 input
- a hidden layer with 4 LSTM neurons
- an output layer

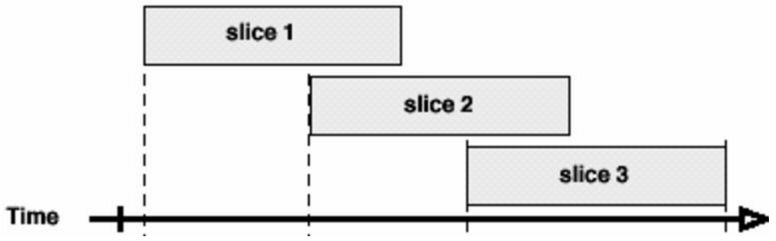


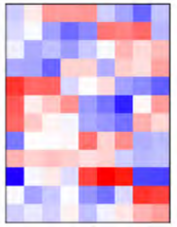
矩阵（Matrix） Based

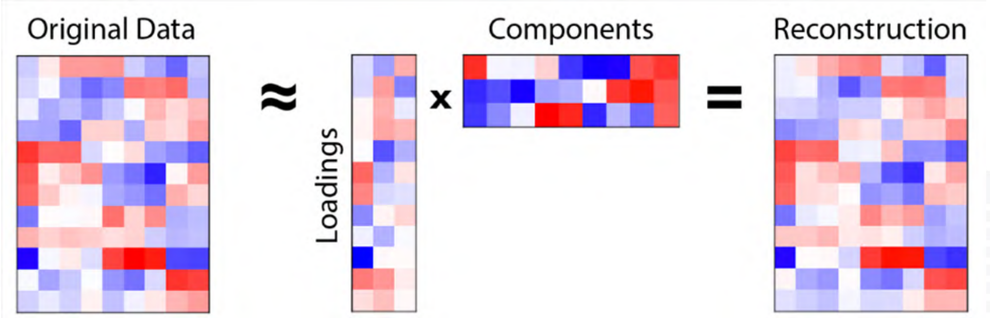
用sliding window构建矩阵，假设矩阵为low rank

分解矩阵后重建，差异大的地方为异常

- Principle Component Analysis
- SVD
- Robust PCA
- Auto-Encoder Neural Network
- Convolutional Auto-Encoder Neural Network







业界应用

- Twitter: **Seasonal Hybrid ESD (S-H-ESD)**

https://blog.twitter.com/2015/introducing-practical-and-robust-anomaly-detection-in-a-time-series

- Netflix: **Robust PCA**

http://techblog.netflix.com/2015/02/rad-outlier-detection-on-big-data.html

- Numenta: **neural network**

http://numenta.com/press/2015/11/10/numenta-anomaly-benchmark-nab-evaluates-anomaly-detection-techniques/

- Anodot: **online machine learning algorithm**

http://www.anodot.com/

- Linkedin: **exponential smoothing**

https://github.com/linkedin/luminol

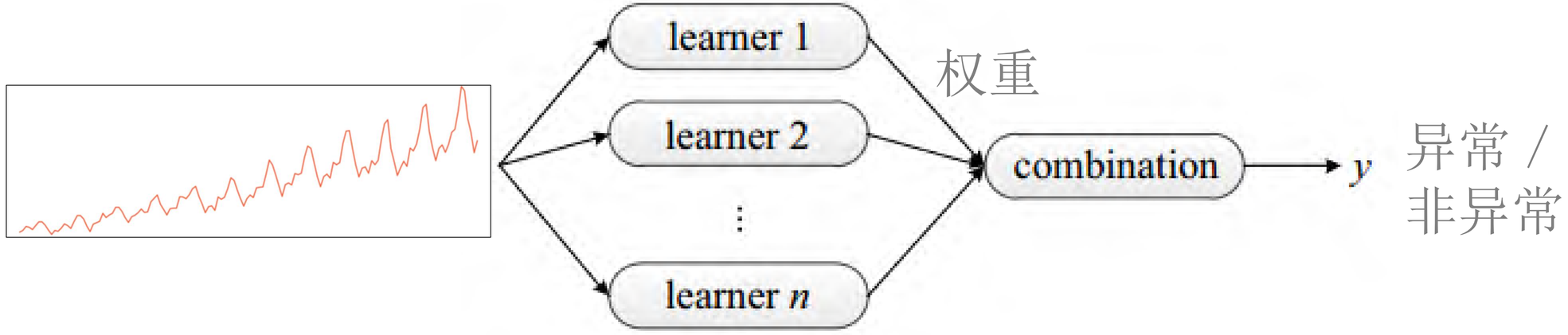
- Uber: **multivariate non-linear model**

https://eng.uber.com/argos/

Credit: Yi Hong @ AppDynamics

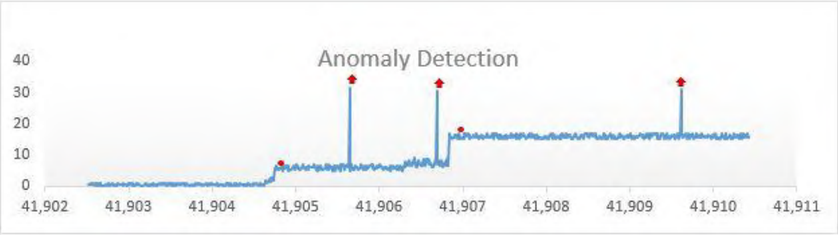
这么多方法，选哪个呢？

自动模型选取：Ensemble Learning



- 多个模型同时预测
- 根据历史数据调整不同模型权重
- 无需人工选取 / 调整
- 自动得到一个共同决策

- 异常检测
  - 产生警报


Anomaly Detection
40
30
20
10
0
41,902
41,903
41,904
41,905
41,906
41,907
41,908
41,909
41,910
41,911

!
ALERT

WHAT'S YOUR
NEXT STEP?

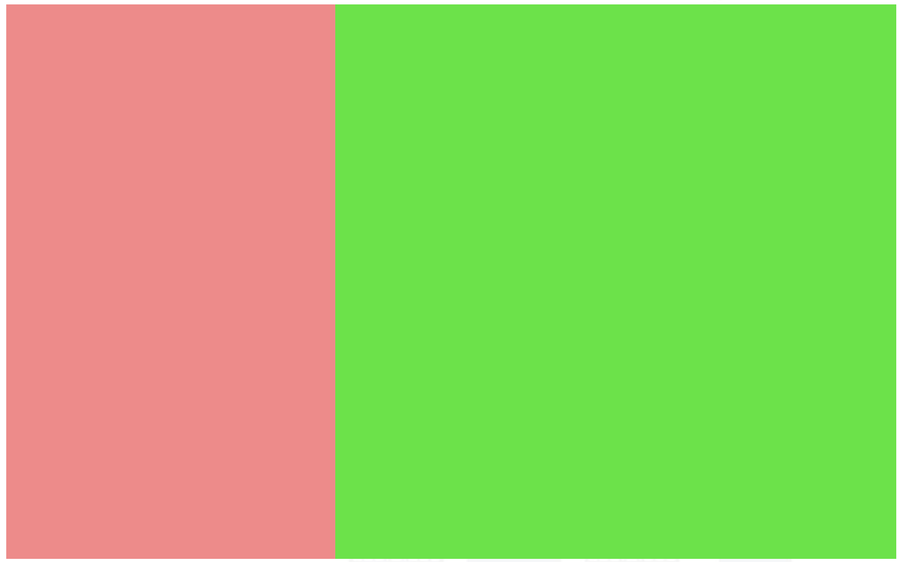
智能运维里的时间序列

- 性能监控里的时间序列
- 传统方法
- AI + 时间序列
  - 异常检测
  - **根源分析**
- 总结

所有metrics集合

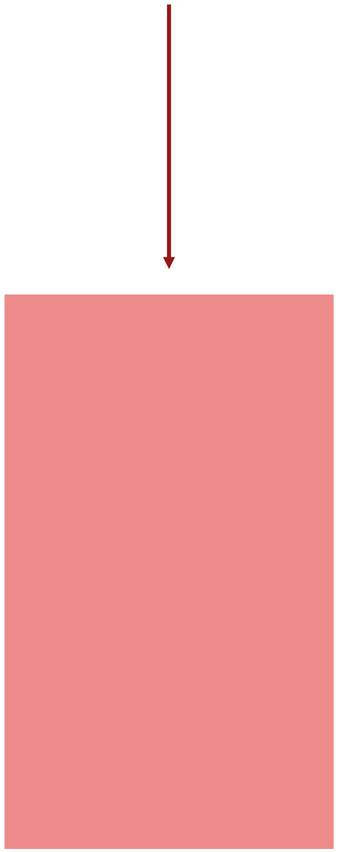
异常的metrics

正常的metrics



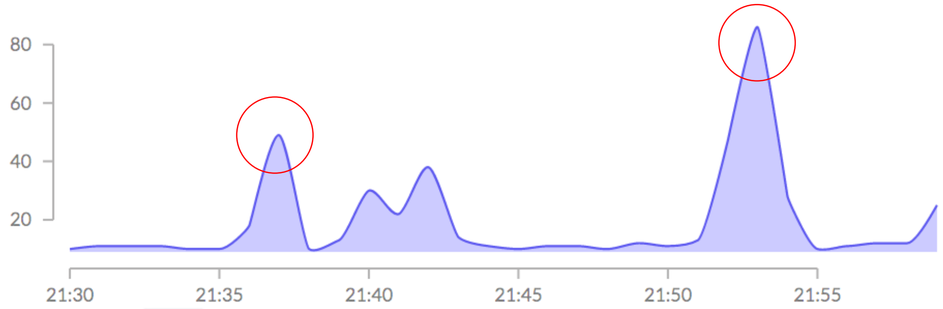
基于相关性的RCA

异常的metrics

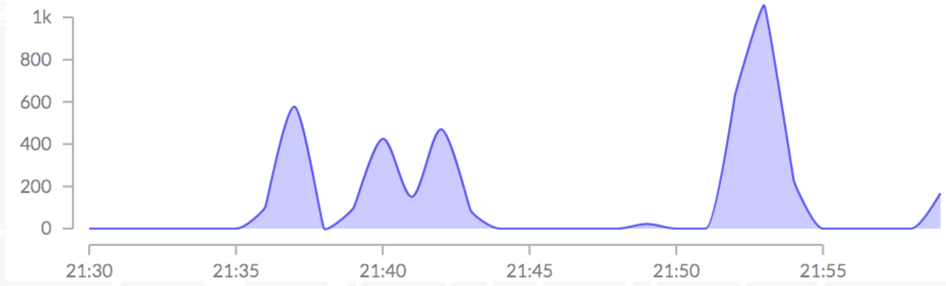


- 从异常的metrics里找到最相关的metric
- 算法：Pearson correlation
- 生产环境例子：

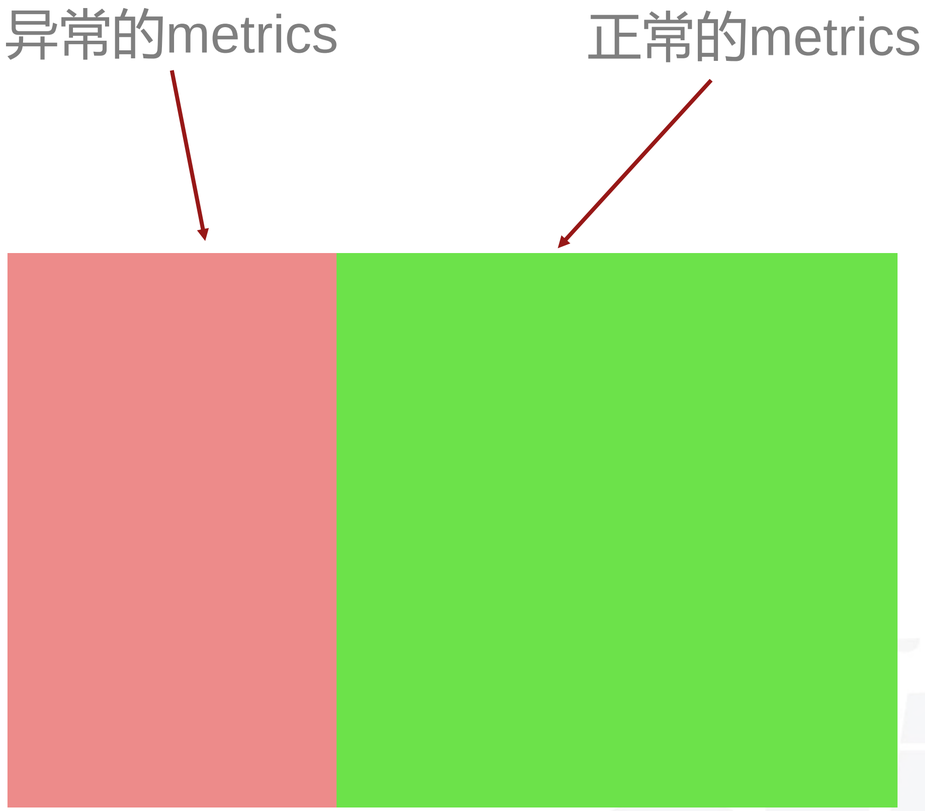
警报metric：
Overall Response Time



最相关的metric（相关度0.9876）：
es_data-02|QueryPhase|Slow Calls



基于决策树的RCA



- 将异常 / 正常metrics分成labeled data
- 算法：decision tree（或其他classifier）
- 总结出异常metrics的规律
- 生产环境例子：

  生成的Rules：

  - EsIndexCluster=prd28-7 && node=indexer_insert_001_prd28
  - Application=prd28-analytics && EsIndexCluster=prd28-2 && transactionName=InsertEventIndexingStage
  - EsIndexCluster=prd28-1 && tier=indexer_prd28

  RCA：

  - ES Cluster = prd28, stage = insert, tier = indexer

AI + 性能监控

异常检测

被动式
（reactive）

根源分析

实时
（real time）

预测

前瞻性
（proactive）

智能运维里的时间序列 - 总结

- 性能监控里的时间序列
- 传统方法
  - 固定阈值
  - 基于平均值的动态阈值
- 为什么传统方法不work？
  - 忽视周期性
  - 忽视趋势
  - 数据不完美
  - 数据孤岛
- AI + 时间序列
  - 异常检测
    - Moving average based
    - Exponential Smoothing Based
    - 分解（decomposition） Based
    - 深度学习（Deep Learning） Based
    - 矩阵（Matrix） Based
    - 自动模型选取：Ensemble Learning
  - 根源分析
    - 基于相关性的RCA
    - 基于决策树的RCA
  - 预测

关注QCon微信公众号，
获得更多干货！

We're HIRING

销售易

让销售更容易

Thanks!

INTERNATIONAL SOFTWARE DEVELOPMENT CONFERENCE

主办方 Geekbang 极客邦科技 InfoQ