

Appunti Simulazione

Formulario

Anno Accademico 2021-2022

 $Last\ Update:\ January\ 21,\ 2023$

Contents

Typing Monkeys

1	Dist	tribuzioni	5									
	1.1	Stimare la Distribuzione	5									
	1.2	Calcolare la Probabilità di una Distribuzione	6									
		1.2.1 Esponenziale	6									
		1.2.1.1 Senza Intervalli	6									
		1.2.1.2 Con Intervalli	6									
		1.2.2 Poisson	6									
		1.2.3 Geometrica	6									
2	God	odness of Fit	7									
	2.1	Test χ^2	7									
		2.1.1 Dati senza Intervalli	7									
		2.1.2 Dati con Intervalli	8									
	2.2	Test Kolmogorov	9									
		2.2.1 Dati Senza Intervalli	10									
		2.2.2 Dati Con Intervalli	10									
	2.3	Informazioni utili su Formule	11									
			11									
		$2.3.1.1$ $cumsum \dots \dots \dots \dots \dots \dots \dots$	11									
	2.4											
		2.4.1 Tabella di Riferimento Test χ^2	12									
			13									
3	Sist	emi a Coda Singola	14									
	3.1	Come Riconoscere un Modello di Coda	14									
	3.2	Parametri Fondamentali	15									
	3.3	Come Calcolare i Parametri Base										
	3.4	Condizione di Stazionarietà										
	3.5		16									
	3.6	Capire come gestire la variazione della distribuzione e del suo	16									

2

3.7	M/M/1	16
	3.7.1 Parametri	16
3.8	M/M/m	17
	3.8.1 Parametri	17
3.9	$M/M/\infty$	18
	3.9.1 Parametri	18
3.10	M/M/1/K (dimensione coda finita)	19
3.11	M/M/1//M (dimensione popolazione finita)	19
3.12	M/G/1	19
	3.12.1 Parametri	19
3.13	M/D/1	20
	3.13.1 Parametri	20

"Oi, con quanto sentimento defeco sul tuo naso, così che ti coli sul mento."

Wolfgang Amadeus Mozart

Chapter 1

Distribuzioni

1.1 Stimare la Distribuzione

Per stimare una distribuzione avendo solo i dati iniziali del problema effettua le seguenti operazioni:

N.B. nel caso di Intervalli, categoria, va sostituito con Punto Medio Intervallo,

- 1. $n = \sum f_i$: assicurati di aver calcolato la somma totale delle osservazioni
- 2. Calcola la **Media**:
 - (a) Aggiungi $Colonna\ Totale:$ categoria, * f_i
 - (b) Calcola la media effettiva con: $media = \frac{\sum totale}{n}$
- 3. Calcola la **Varianza** σ^2 :
 - (a) Aggiungi $Colonna\ ris:\ ({\rm categoria}_i-{\rm media})^2*f_i$
 - (b) Calcola la varianza effettiva con: $\sigma^2 = \frac{\sum_{\text{ris}}}{n-1}$
- 4. Calcola la **Deviazione Standard** σ :

(a)
$$\sigma = \sqrt{\sigma^2}$$

5. Calcola $V = \frac{\sigma}{\text{media}}$

Una volta completati tutti i calcoli controlla se il coefficiente V è vicino ad 1 e:

- se lo è allora utilizza l'Esponenziale,
- se non lo è è Poissoniana ma per avere una verifica, controlla che la media e la varianza siano uguali.

Note:

Si può avere una prima idea del tipo di distribuzione anche osservando le frequenze per categoria:

- Se le frequenze hanno valori alti per le prime categorie e poi decrescono, probabilmente è esponenziale negativa.
- Se le frequenze hanno valori bassi per le prime categorie e poi crescono, probabilmente è esponenziale...
- Se le frequenze hanno valori alti nelle categorie centrali e bassi verso le categorie agli estremi, probabilmente è Poissoniana
- Nel caso in cui sia geometrica solitamente viene esplicitato.

1.2 Calcolare la Probabilità di una Distribuzione

1.2.1 Esponenziale

1.2.1.1 Senza Intervalli

$$p(i) = \frac{e^{\frac{-\text{categoria}_i}{\text{media}}}}{\text{media}}$$

1.2.1.2 Con Intervalli

$$p(i) = 1 - e^{\frac{-\text{categoria}_i}{\text{media}}}$$

1.2.2 Poisson

$$p(i) = \frac{e^{-\text{media}} * \text{media}^{\text{categoria}_i}}{\text{categoria}_i!}$$

1.2.3 Geometrica

$$p(i) = \rho * (1 - \rho)^{\operatorname{categoria}_i}$$

Chapter 2

Goodness of Fit

2.1 Test χ^2

Devi utilizzare questa sezione solo se il numero delle **osservazioni totale** n > 30.

2.1.1 Dati senza Intervalli

Devi utilizzare questa sezione solo quando hai dei dati **Senza Intervalli**, devi anche fare attenzione che il **numero di osservazioni** n > 30!!

Operazioni da effettuare:

- 1. Riportare i dati in una tabella in Calc:
 - Colonna 1: categorie
 - Colonna 2: f_i
- 2. Raggruppare le categorie se $\exists categoria < 5$:
 - Parti dall'ultimo a salire (dal basso verso l'alto delle categorie)
 - Raggruppale tutte nell'ultima categoria che le faccia diventare maggiori di 5 sommando le frequenze.
 - Esempio:

			-						- 1	
	А	В	С	D	Е	4	Α	В	С	D
1	VALORI	frequenze	f(i) raggrup	opate		1	VALORI	frequenze	f(i) raggrup	pate
2	0	59	59			2	0			
3	1	26	26			3	1	26		
4	2	24	24			4	2	24	24	
5	3	18	18			5	3	18		
6	4	12	12			6	4	12		
7	5	5	5			7	- 4	12		
8	6	4	12			/	5	3	9	
9	7	3				8	6	1	L	
10	9	3				9	7	1		
11	11	2				10	9	1		
12		_				11	11	1		

3. Calcolare:

- (a) $n = \sum (f_i)$
- (b) $f(i) = f_i/n$: non serve
- (c) Capire la distribuzione se non è data (vedi 1.1)
- (d) p(i): dipende dalla distribuzione (vedi 1.2)
- (e) $F_i = n * p(i)$: numero di intervalli unitari teorici con i arrivi
- (f) $G_i = \frac{(f_i F_i)^2}{F_i}$
- (g) $V = \sum G_i$: sommare tutti i valori di G
- (h) df = Numero Categorie 1 Numero Parametri Distribuzione

Una volta terminati i calcoli devi guardare la riga nella tabella del χ^2 (AG-GIUNGERE REF) con lo stesso valore di df: devi controllare che il valore V ricada negli intervalli che non superino il P_{95} .

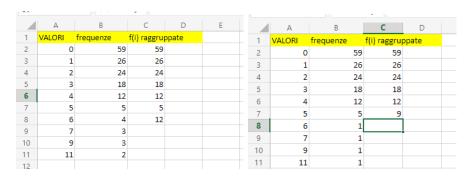
2.1.2 Dati con Intervalli

Devi utilizzare questa sezione solo quando hai dei dati divisi in **Intervalli**, devi anche fare attenzione che il **numero di osservazioni** n > 30!!

Calcoli da effettuare:

- 1. Riportare i dati in una tabella in Calc:
 - Colonna 1: categorie, probabilmente devi aggiungerle tu, parti da 0 in poi
 - Colonna 2: intervallo, del tipo $x_1 x_2$. Fai sempre attenzione che $x_2 \ge x_1$!!! In caso li inverti.
 - Colonna 3: frequenza f_i

- 2. Aggiungere Colonna x_1 (intervallo più piccolo)
- 3. Aggiungere $Colonna x_2$ (intervallo più grande)
- 4. Aggiungere Colonna Punto Medio Intervalli tra x_2 e x_1 con $\frac{x_1+x_2}{2}$
- 5. Calcolare:
 - (a) capire la distribuzione se non è data (vedi 1.1)
 - (b) $f(i) = f_i/n$: non serve
 - (c) $p(i) = p(x_2) p(x_1) = \text{calcolare secondo la distribuzione (vedi 1.2)}$
 - (d) $F_i = n * p(i)$: numero di intervalli unitari teorici con i arrivi
 - (e) $G_i = \frac{(f_i F_i)^2}{F_i}$
 - (f) $V = \sum G_i$: sommare tutti i valori di G
 - (g) df = Numero Categorie 1 Numero Parametri Distribuzione
- 6. Raggruppare le categorie se $\exists categoria < 5$:
 - Parti dall'ultimo a salire (dal basso verso l'alto delle categorie)
 - Raggruppale tutte nell'ultima categoria che le faccia diventare maggiori di 5 sommando le frequenze.
 - Esempio:



Una volta terminati i calcoli devi guardare la riga nella tabella del χ^2 (AG-GIUNGERE REF) con lo stesso valore di df: devi controllare che il valore V ricada negli intervalli che non superino il P_{95} .

2.2 Test Kolmogorov

Devi utilizzare questa sezione solo se il numero delle **osservazioni totale** n < 30.

2.2.1 Dati Senza Intervalli

Devi utilizzare questa sezione solo quando hai dei dati **Senza Intervalli**, devi anche fare attenzione che il **numero di osservazioni totali** n < 30!!

Operazioni da effettuare:

- 1. Riportare i dati in una tabella in Calc:
 - Colonna categorie
 - Colonna frequenze f_i
- 2. Calcolare:
 - (a) $f(i) = f_i/n$: frequenze osservate
 - (b) Individuare la distribuzione di probabilità adatta (vedi 1.1)
 - (c) p(i): probabilità teorica (vedi 1.2)
 - (d) $d_i = cumsum(f(i))$: somma cumulativa delle f(i)
 - (e) $D_i = cumsum(p(i))$: somma cumulativa delle p(i)
 - (f) $D = |d_i D_i|$: la differenza assoluta
 - (g) $D_{max} = \max(D)$: il massimo valore tra le differenze assolute D

Una volta completati tutti i calcoli, cercare nella tabella di *Kolmogorov-Smirnov* la riga corrispondente al valore delle osservazioni totali n: se il valore D_{max} è sotto il $D_{0.10}$ la distribuzione è accettata, altrimenti no.

2.2.2 Dati Con Intervalli

Devi utilizzare questa sezione solo quando hai dei dati **Senza Intervalli**, devi anche fare attenzione che il **numero di osservazioni totali** n < 30!!

N.B.: non abbiamo trovato esercizi con cui testare questa sezione!

Operazioni da effettuare:

- 1. Riportare i dati in una tabella in Calc:
 - Colonna categorie: probabilmente devi aggiungerle tu, parti da 0 in poi
 - Colonna intervallo: del tipo $x_1 x_2$. Fai sempre attenzione che $x_2 \ge x_1$!!! In caso li inverti.

- Colonna frequenze f_i
- 2. Aggiungere Colonna x_1 (estremo più piccolo dell'intervallo)
- 3. Aggiungere $Colonna\ x_2$ (estremo più grande dell'intervallo)
- 4. Calcolare:
 - (a) $f(i) = f_i/n$: frequenze osservate
 - (b) Individuare la distribuzione di probabilità adatta (vedi 1.1)
 - (c) $p(i) = p(x_2) p(x_1)$: probabilità teorica per ogni intervallo (vedi 1.2)
 - (d) $d_i = cumsum(f(i))$: somma cumulativa delle f(i)
 - (e) $D_i = cumsum(p(i))$: somma cumulativa delle p(i)
 - (f) $D = |d_i D_i|$: la differenza assoluta
 - (g) $D_{max} = \max(D)$: il massimo valore tra le differenze assolute D

Una volta completati tutti i calcoli, cercare nella tabella di Kolmogorov-Smirnov la riga corrispondente al valore delle osservazioni totali n: se il valore D_{max} è sotto il $D_{0,10}$ la distribuzione è accettata, altrimenti no.

2.3 Informazioni utili su Formule

2.3.1 Komorov

2.3.1.1 cumsum

Per calcolare *cumsum* (somma cumulativa) va eseguito il seguente procedimento:

- La prima cella resta uguale alla prima cella della colonna di riferimento (es. f(i) o p(i))
- Dalla seconda cella in poi si blocca la prima cella della somma cumulativa (quella calcolata al punto precedente) e si somma fino alla cella i di riferimento (vedi Figura 2.1)

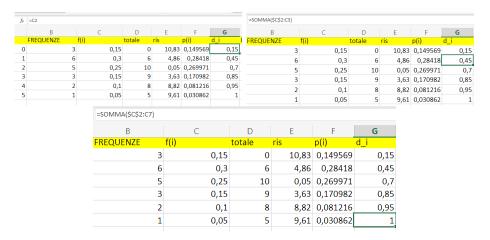


Figure 2.1: Esempio di calcolo della funzione cumsum

2.4 Tabelle di Riferimento

2.4.1 Tabella di Riferimento Test χ^2

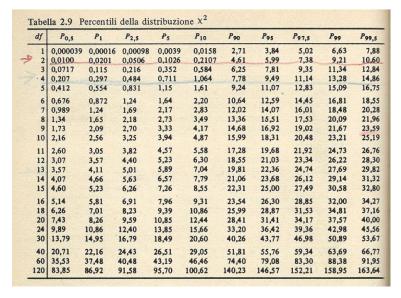


Figure 2.2: Tabella di Riferimento per Test χ^2

2.4.2 Tabella di Riferimento Test Kolmogorov

n	$D_{0,10}$	$D_{0,05}$	$D_{0,01}$	
	0,950	0,975	0,995	
1	0,776	0,842	0,929	
2	0,642	0,708	0,828	
3	0,564	0,624	0,733	
4	0,510	0,565	0,669	
5	0,310	0,521	0,618	
6		0,486	0,577	
7	0,438	0,457	0,543	
8	0,388	0,432	0,514	
9	0,368	0,410	0,490	
10	0,352	0,391	0,468	
11	0,332	0,375	0,450	
12	0,335	0,361	0,433	
13	0,323	0,349	0,418	
14	0,314	0,338	0,404	
15	0,304	0,328	0,392	
16		0,318	0,381	
17	0,286	0,309	0,371	
18	0,278	0,301	0,363	
19	0,272 0,264	0,294	0,356	
20		0,27	0,32	
25	0,24	0,24	0,29	
30	0,22	0,23	0,27	
35	0,21			
Oltre	1,22	1,36	1,63	
35	\sqrt{n}	\sqrt{n}	\sqrt{n}	

Figure 2.3: Tabella di Riferimento per Test Kolmogorov

Chapter 3

Sistemi a Coda Singola

3.1 Come Riconoscere un Modello di Coda

Un modello di coda secondo la notazione di Kendall è così rappresentato:

dove:

- A: indica la distribuzione del tempo di inter-arrivo
- b: indica la distribuzione del tempo di servizio T_s
- c: indica il numero di serventi
- n: indica la dimensione della coda
- p: indica la dimensione della popolazione
- Z: indica la disciplina di servizio

Tale notazione si semplifica in A/b/c nel caso in cui la dimensione della popolazione e della coda sono infinite e la disciplina di servizio segue la logica FIFO ($n = p = \infty$ e Z = FIFO).

Per quanto riguarda i possibili valori di A, b e c:

- A e b: può assumere i valori D (distribuzione deterministica o costante), M (distribuzione esponenziale negativa), G (distribuzione generale), H_h (distribuzione iperesponenziale), E_k (l'Erlangiana a k stadi)
- c: 1 o m, dove 1 indica un singolo servente e m indica che ci sono serventi multipli. Non importa inizialmente specificare quanto è m, ma per le formule successive il valore va sostituito con il numero esatto di serventi.

Consigli

Solitamente negli esercizi è sottinteso che la dimensione della popolazione e della coda sono infinite (non lo sono soltanto nel caso in cui viene specificato diversamente), lo stesso vale per la gestione del servizio che è sempre FIFO (salvo casi estremi che devono essere specificati).

Per quanto riguarda le distribuzioni degli interarrivi e del servizio: essi sono sempre specificati e nei soli casi in cui non viene esplicitato il tipo di distribuzione (che ovviamente può essere diverso per interarrivo e servizio) si considera la distribuzione generale G.

Nei pochi casi in cui la distribuzione è deterministica è sempre specificato, ad esempio viene detto che il tempo è costante.

3.2 Parametri Fondamentali

- Δ : Tempo di Inter-arrivo (il tempo che intercorre tra un arrivo e il successivo)
- w: Numero di utenti in coda
- t_w : Tempo di Attesa in Coda
- s: Numero di Utenti in Servizio
- t_s : Tempo di Servizio
- q: Numero di Utenti nel Sistema
- t_q : Tempo di Risposta

N.B.

- Tutti i **Tempi** vanno espressi in **minuti**,
- tutti i valori precedenti sono **interi** e **maggiori o uguali** a 0,
- $0 \le s \le c$.
- stare bene a tenti a se la chiede in ore o minuti :pig:

3.3 Come Calcolare i Parametri Base

- Tempo Medio di Servizio $T_s = \frac{1}{\mu}$
- Tempo medio di Inter-arrivi $\mu = \frac{1}{T_s}$
- Tasso medio di Arrivi $\lambda = \Delta^{-1}$
- Intensità del Traffico $\rho = \frac{\lambda}{\mu}$

3.4 Condizione di Stazionarietà

$$\rho \leq 1$$

Controllare bene (STARE BENE A TENTI) che la condizione di Stazionarietà sia verificata altrimenti l'esercizio non si può continuare.

3.5 Formule

3.6 Capire come gestire la variazione della distribuzione e del suo modello di coda

$3.7 \quad M/M/1$

Sistema aperto denotato da un singolo servente:

- Distribuzione del Tempo di Inter-arrivo Esponenziale con parametro λ
- Tempo di Servizio Esponenziale di parametro μ

3.7.1 Parametri

- Numero di Utenti Medio: $N = \frac{\rho}{1-\rho} = \lambda R$
- Numero Medio di Utenti in Coda: $W = N \rho = \frac{\rho^2}{1-\rho}$
- Tempo Medio di Risposta: $R = \frac{\frac{1}{\mu}}{1-\rho} = T_s + T_w = \frac{N}{\lambda}$
- Tempo di Attesa Medio in Coda: $T_w = \frac{\frac{\rho}{\mu}}{1-\rho} = R T_s$

- Probabilità di Osservare almeno k utenti in un Sistema in condizione di Stazionarietà: = ρ^k
- Probabilità di avere 0 utenti nel sistema: $\pi_0 = 1 \rho$
- Probabilità di avere kutenti nel sistema: $\pi_k = \rho^k \pi_0 = \rho^k (1-\rho)$

3.8 M/M/m

Sistema aperto dotato di m serventi:

- Distribuzione del Tempo di Arrivo Poissoniano con parametro λ
- Distribuzione del Tempo di Servizio Esponenziale con parametro μ

3.8.1 Parametri

- Numero di Servienti: m
- Tempo Medio di Servizio: T_s (vedi 3.3)
- Tasso Medio di Arrivi λ (vedi 3.3)
- Tempo Medio di Inter-Arrivo: μ (vedi 3.3)
- Intensità del Traffico: $\rho = \frac{\lambda}{m\mu}$
- Probabilità di avere 0 utenti nel sistema:

$$\pi_0 = \left[\sum_{k=0}^{m-1} \left(\frac{(m\rho)^k}{k!} \right) + \frac{(m\rho)^m}{m!} \frac{1}{1-\rho} \right]^{-1}$$

• Probabilità di avere k utenti nel sistema:

$$\clubsuit$$
 se $1 \le k \le m$

$$\pi_k = \frac{(m\rho)^k}{k!} \pi_0$$

$$n$$
 se $k > m$

$$\pi_k = \frac{m^m \rho^k}{m!} \pi_0$$

• Numero Medio di Serventi Occupati:

$$E[s] = \sum_{k=0}^{m-1} (k\pi_k) + \frac{m\pi_m}{1-\rho} = m\rho = \frac{\lambda}{\mu}$$

- Numero di Utenti Medio: $N = m\rho + \pi_m \frac{\rho}{(1-\rho)^2}$
- Numero di Utenti Medio in Coda: $W=\pi_m \frac{\rho}{(1-\rho)^2}$
- Tempo Medio di Risposta: $R = \frac{N}{\lambda} = \frac{m\rho + W}{\lambda}$
- Tempo di Attesa in Coda:

$$T_w = \frac{\pi_m}{m\mu(1-\rho)^2}$$

- Tempo di Utilizzo (tempo in cui si sta bene a tenti): $U=1-\pi_0=\rho$
- Tempo di Non Utilizzo: $\hat{U} = 1 U$
- Probabilità che un Utente in Arrivo trovi tutti i serventi occupati:

$$Prob_{coda} = \sum_{k=m}^{+\infty} \pi_k = \pi_0 \frac{(m\rho)^m}{m!} \frac{1}{1-\rho}$$

• Probabilità che un Utente in Arrivo Non trovi una coda:

$$Pro\hat{b}_{coda} = 1 - Prob_{coda}$$

3.9 $M/M/\infty$

Sistema aperto con infiniti servienti:

- Distribuzione del Tempo di Arrivo Poissoniano di parametro λ
- Distribuzione del Tempo di Servizio Esponenziale di parametro μ

3.9.1 Parametri

- Intensità del Traffico: ρ (vedi 3.3)
- Probabilità di avere k utenti, che coincide (in questo caso specifico) con la Probabilità di avere k serventi occupati:

$$\pi_k = \frac{\rho^k}{k!} e^{-\rho}$$

 $con k \ge 0$

- Numero Medio di Utenti: $N = \rho$
- Tempo Medio di Risposta, che coincide con il Tempo Medio di Servizio:

$$R = T_s = \frac{1}{\mu}$$

- 3.10 M/M/1/K (dimensione coda finita)
- 3.11 M/M/1//M (dimensione popolazione finita)

3.12 M/G/1

Sistema aperto con un singolo servente:

- Distribuzione del Tempo di Inter-Arrivo Esponenziale con parametro λ
- Distribuzione del Tempo di Servizio degli Utenti Indipendente con Distribuzione Generale

3.12.1 Parametri

- Per quelli di base vedere 3.3
- Numero Medio di Utenti (formula di Khintchine-Pollaczk **Q**):

$$N = \rho + \frac{\rho^2 (1 + C_B^2)}{2(1 - \rho)}$$

dove:

- $-C_B = \sigma \mu$ (Coefficiente di Variazione)
- $-\ \sigma = \sqrt{\text{Varianza}} \ (\text{Deviazione Standard})$
- Tempo Medio di Risposta di un lavoro: $R = \frac{N}{\lambda}$
- Tempo Medio di Attesa in Coda: $W = \lambda T_w = N \rho$
- Tempo di Attesa in Coda: $T_w = \frac{N-\rho}{\lambda}$

N.B.

• Se $\rho = 1$ e quindi il sistema è **congestionato**, allora gli indici medi N, W, R, T_w tendono a crescere senza limite.

3.13 M/D/1

Versione di M/G/1 con Distribuzione del Tempo di Servizio Deterministico:

- Distribuzione del Tempo di Inter-Arrivo Esponenziale con parametro λ
- Distribuzione del Tempo di Servizio degli Utenti Indipendente con Distribuzione Deterministica

3.13.1 Parametri

• Valore Medio degli Utenti nel Sistema:

$$N = \rho + \frac{\rho^2}{2(1-\rho)}$$

• Numero di Utenti Medio in Attesa:

$$W = \frac{\rho^2}{2(1-\rho)}$$

N.B.

- Tutti i parametri che non sono stati elencati sono calcolati come scritto in 3.12
- Se $\rho = 1$ e quindi il sistema è **congestionato**, allora gli indici medi N, W, R, T_w tendono a crescere senza limite.