

```
1  """
2  Montecarlo para integrales.
3  (c) Carlos M. martinez, marzo-abril 2022
4  """
5
6  import random
7  import math
8  import tabulate
9  import time
10 from scipy.stats import norm
11 import functools
12 from cm2c.fing.mmc.utils import sortearPuntoRN
13 from pathos.multiprocessing import ProcessPool as Pool
14
15 _VERSION = "Integracion MMC v0.1.2 - Carlos Martinez abril 2022"
16
17 def version():
18     return _VERSION
19 # end def
20
21 def integracionMonteCarlo(Phi, dim, n):
22     """
23     Integracion por Montecarlo.
24     Phi: funcion a integrar
25     n: tamaño de la muestra (cantidad de iteraciones)
26     dim: dimensionalidad del problema
27     delta: intervalo de confianza
28
29     Resultado: (estimacion valor integral, estimacion varianza)
30     """
31     S = 0
32     T = 0
33     for j in range(1, n+1):
34         # sortear X({j} con distribución uniforme en R(n)
35         Xj = sortearPuntoRN(dim)
36         # print(Xj, Phi(Xj))
37         if j>1:
38             T = T + (1-1/j)*(Phi(Xj)-S/(j-1))**2
39         S = S + Phi(Xj)
40     # end for
41     estimZ = S / n
42     estimSigma2 = T / (n-1)
43     estimVar = estimSigma2 / n
44
45     return (estimZ, estimVar, S, T)
46 ## end def
47
48 ## intervalo de confianza aproximación normal
49 def intConfianzaAproxNormal(estimZ, estimV, n, delta):
50     """
51     Intervalo de confianza para la integración de Monte Carlo, según el criterio
52     de la aproximación normal.
53
54     estimZ : valor estimado de la integraal
55     estimV : valor estimado de la varianza
56     n : cantidad de iteraciones
57     delta : amplitud del intervalo de confianza
```

```

58     """
59
60     D = norm.ppf(1-delta/2)*math.sqrt(estimV)
61
62     I0 = estimZ - D
63
64     I1 = estimZ + D
65
66     return (I0, I1)
67 # end def
68
69
70 # Version paralelizada de Montecarlo
71 def integracionMonteCarloParalelo(Phi, dim, n, hilos):
72     """
73     version paralelizada del montecarlo
74     N: numero de muestras
75     Phi: funcion que implementa el volumen
76     hilos: cantidad de hilos en el pool de tareas
77     """
78
79     args1 = []
80     args2 = []
81     args3 = []
82     for x in range(0,hilos):
83         args3.append( math.ceil(n/hilos) )
84         args2.append(dim)
85         args1.append(Phi)
86
87     p = Pool(hilos)
88     resultados = p.map(integracionMonteCarlo, args1, args2, args3 )
89     #print(resultados)
90
91     # unir los resultados para producir el resultado final
92     Stotal = 0
93     Ntotal = 0
94     Ttotal = 0
95     for i in range(0, hilos):
96         Stotal = Stotal + resultados[i][2]
97         Ttotal = Ttotal + resultados[i][3]
98         Ntotal = Ntotal + math.ceil(n/hilos)
99     #
100     VolR = Stotal / Ntotal
101     VarVorR = (Stotal/Ntotal)*(1-Stotal/Ntotal)/(Ntotal-1)
102
103     estimZ = Stotal / Ntotal
104     estimSigma2 = Ttotal / (Ntotal-1)
105     estimVar = estimSigma2 / Ntotal
106
107     return (estimZ, estimVar, Stotal, Ttotal)
108 # end def integral montecarlo paralelo
109
110 if __name__ == "__main__":
111     print("Es una biblioteca, no es para correr directamente")

```