

Métodos Computacionales Quiz Tarea 4 - Métodos de Monte Carlo 28-07-2017



La solución a este quiz debe subirse por SICUA. Los dos archivos código fuente deben subirse en un único archivo .zip con el nombre QUIZNombreApellido_hw4.zip, por ejemplo yo debería subir el zip QUIZVeronicaArias_hw4.zip. Este archivo debe descomprimirse en un directorio de nombre QUIZNombreApellido_hw4 que sólo debe contener el código en python Param.py y el makefile QuizT4.mk (2 puntos). Recuerden que este trabajo es individual y que no pueden usar ningún tipo de ayuda externa (internet, celulares, etc).

1. (14 puntos points) Estimación Bayesiana de parámetros

En este ejercicio debe encontrar los parámetros que permiten un mejor ajuste de su modelo $(y_{mod} = m \cdot x_{obs} + b)$ a los datos obs_data.dat.

Escriba un script llamado Param.py que debe:

- Leer los datos.
- Usar el algoritmo de Metropolis-Hastings para determinar los parámetros m y b del modelo.
- Imprimir en la terminal "los parámetro encontrados son m= XX y b=YY", donde XX y YY son el resultado encontrado.
- Hacer una gráfica para cada parámetro donde se vea la convergencia del método.
- Guardar las graficas anteriores (sin mostrarlas) en Param_m.pdf y Param_b.pdf.
- Haga una gráfica final de los datos y su modelo con los parámetro óptimos. Guardela (sin mostrarla) en Modelo.pdf
- 2. (4 puntos points) El archivo QuizT4.mk debe:
 - Incluir todas las dependencias y reglas necesarias para generar y/o actualizar las gráficas anteriores.

Ayuda:

La función de verosimilitud ("likelihood function") es:

$$L = e^{-\frac{1}{2}\chi^2} \tag{1}$$

donde

$$\chi^2 = \sum_{i=0}^{N} \frac{(y_{obs} - y_{mod})^2}{\sigma_i^2} \tag{2}$$

tome $\sigma_i = 1$.