SPRAWOZDANIE

IDENTYFIKACJA I MODELOWANIE STATYSTYCZNE

Modelowanie i identyfikacja

Marcin Bober, 249426

Prowadzący:
Mgr inż. Maciej Filiński

17 marca 2022

Spis treści

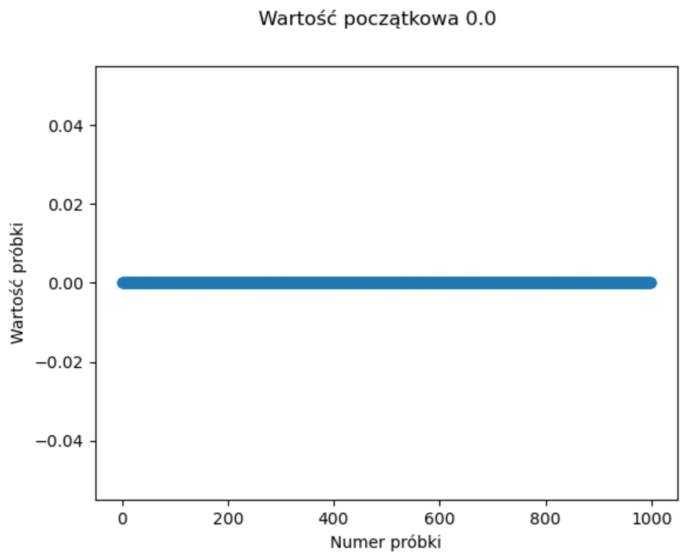
1 Generator liczb pseudolosowych

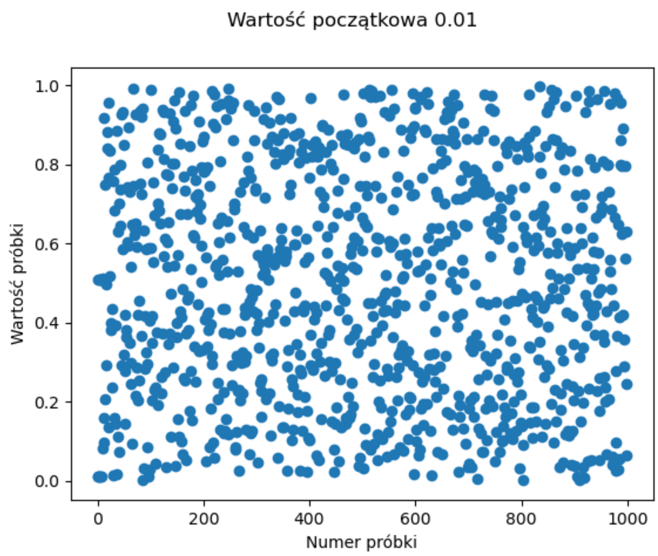
1.1 Opis

Zadanie polega na implementacji generatora liczb pseudolosowych z rozkładu jednostajnego oraz analizie wyników uzyskanych z jego udziałem. Generator oparty jest na przekształceniu piłokształtnym o równaniu $X_{n+1} = X_n \cdot z - [X_n \cdot z]$

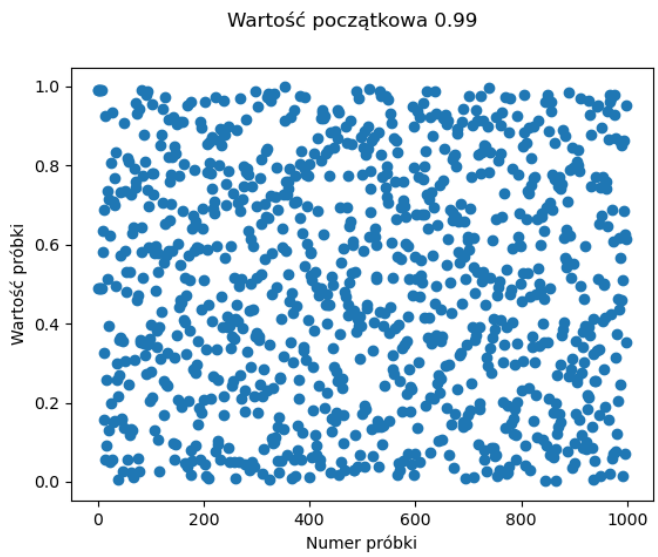
1.2 Wpływ wartości początkowej X na własności generatora

Wartość Z ustawiona została na wartość 51. Wykorzystano 1000 próbek.

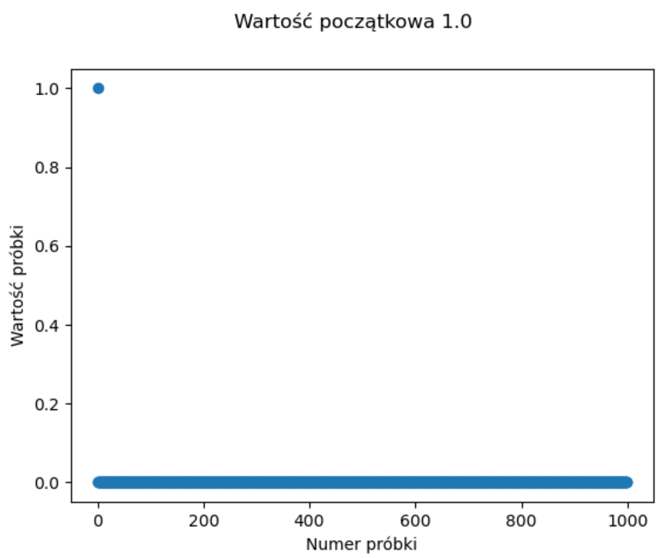




Wartość początkowa 0.1
Wartość próbki
Numer próbki



Wartość początkowa 0.99
Wartość próbki
Numer próbki

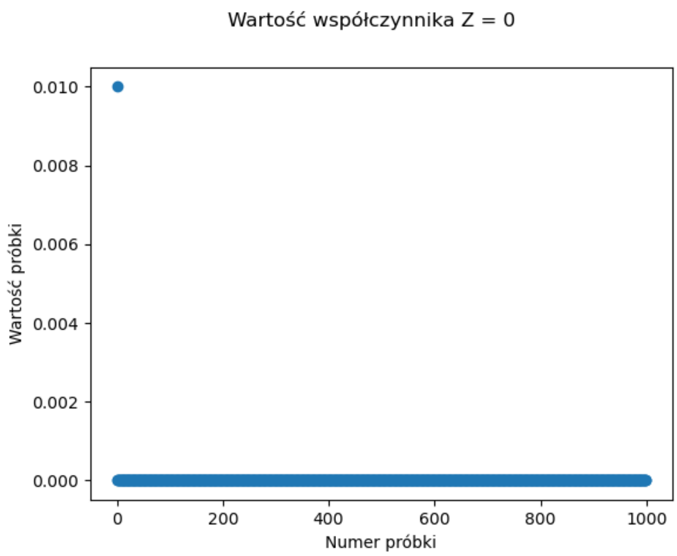


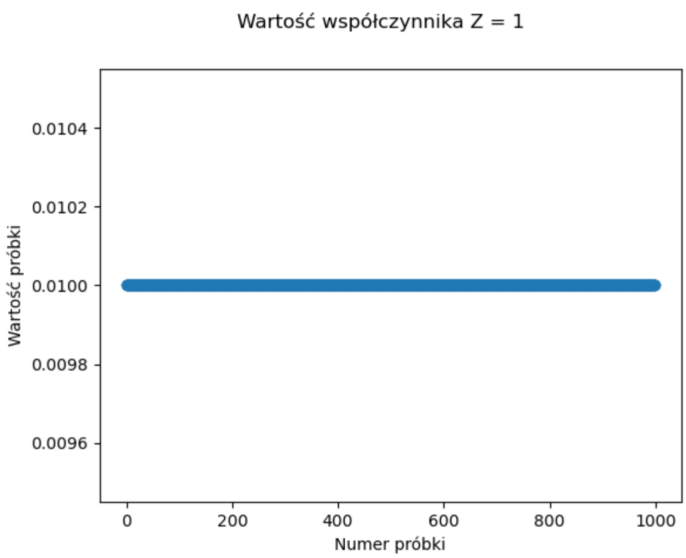
Wartość początkowa 1.0
Wartość próbki
Numer próbki

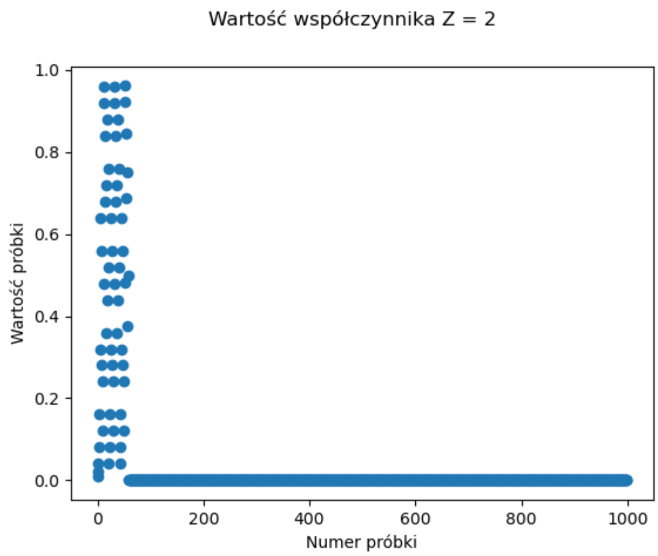
- Ustawienie wartości początkowej równej zero powoduje że wszystkie wygenerowane próbki są zerowe. (Patrz wykres 1.2) Dzieje się tak ponieważ algorytm opiera się o obliczenie iloczynu liczb, których jednym ze składników jest zero.
- Wybór liczby całkowitej spowoduje że pierwsza próbka jest równa tej wartości, a wszystkie kolejne są zerowe (Patrz wykres 1.2). Wynika to z faktu że obliczana jest reszta z dzielenia wartości przez jeden, która w taki wypadku zawsze równa jest zero.
- Zalecanym zakresem wyboru wartości początkowej jest przedział zawierający liczby większe od zera, z pominięciem liczb całkowitych.

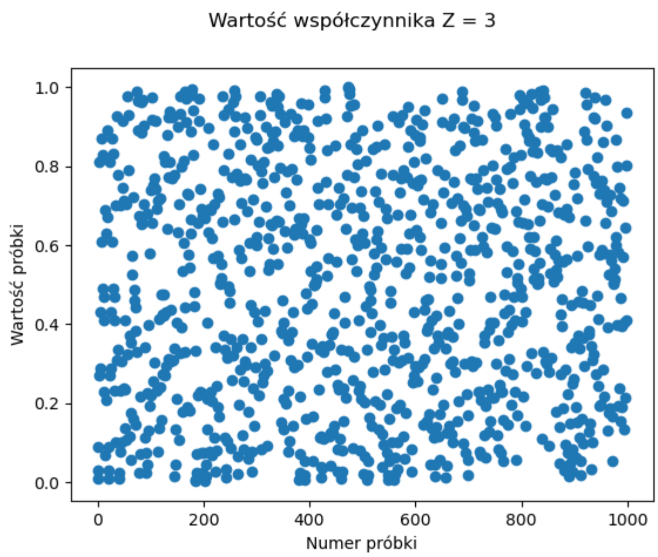
1.3 Wpływ parametru Z na własności generatora

Wartość X_0 ustawiona została na wartość 0,01. Wykorzystano 1000 próbek.









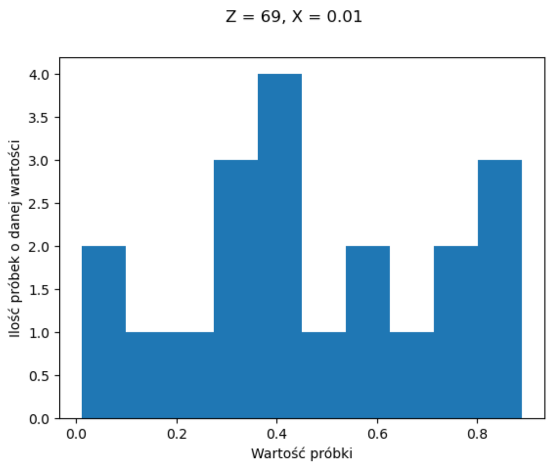
- Dla zerowego współczynnika Z pierwsza próbka uzyskuje wartość początkowa, a kolejne są zerami. Wynika to z mnożenia tych wyników przez współczynnik Z czyli zero.
- Gdy wartość Z jest równa jedności, wszystkie otrzymane wyniki są identyczne z wartością startową.
- W przypadku wykorzystania liczb parzystych, uzyskiwane wyniki szybko trafiają na wartość zero, która powoduje zatrzymanie generowania kolejnych wartości losowych.
- Najlepsze wyniki otrzymywane są dla współczynnika Z będącego dużą liczbą pierwszą.

X_0	Z	okres generatora
0,1	1	1
0,1	2	4
0,1	3	4
0,1	4	2
0,1	5	1
0,1	6	1
0,1	7	4
0,1	8	4

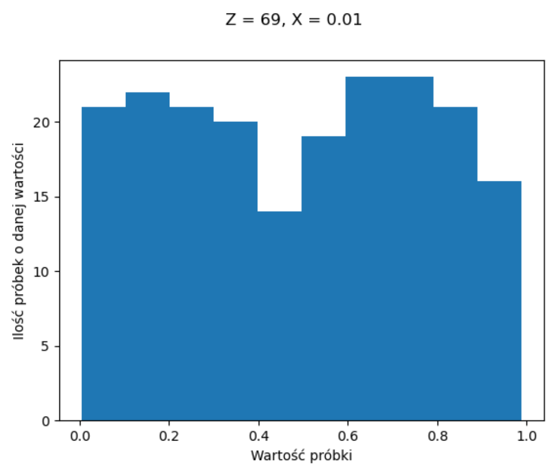
Tabela 1: Okres generatora w zależności od wartości Z

1.4 Okres generatora dla wybranych wartości Z

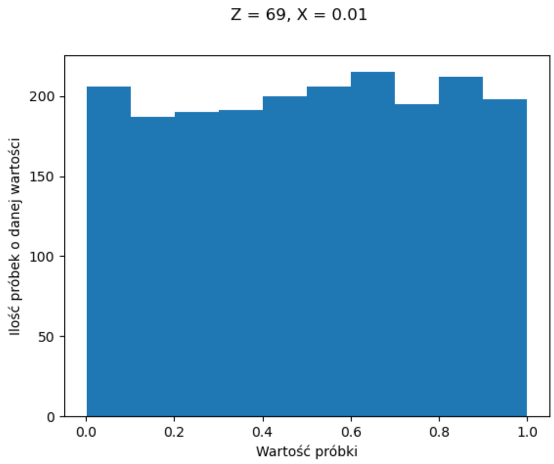
1.5 Podobieństwo histogramu ciągu wygenerowaych liczb, a gęstość rozkładu jednostajnego



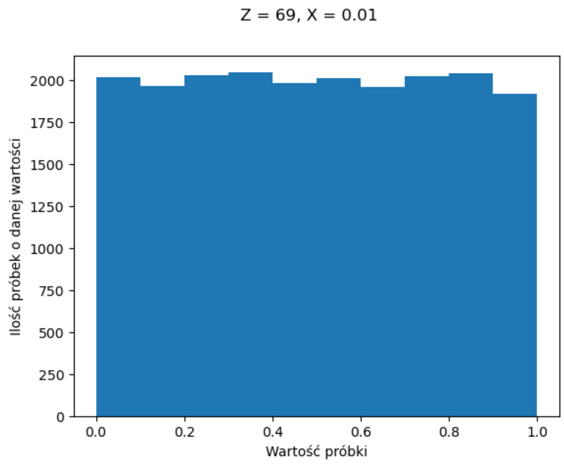
Rysunek 1: Ilość wygenerowanych próbek - 20



Rysunek 2: Ilość wygenerowanych próbek - 200



Rysunek 3: Ilość wygenerowanych próbek - 2000



Rysunek 4: Ilość wygenerowanych próbek - 20000

- Im więcej wygenerowaych próbek tym mocniej histogram upodabnia się do gęstości prawdopodobieństwa rozkładu jednostajnego.

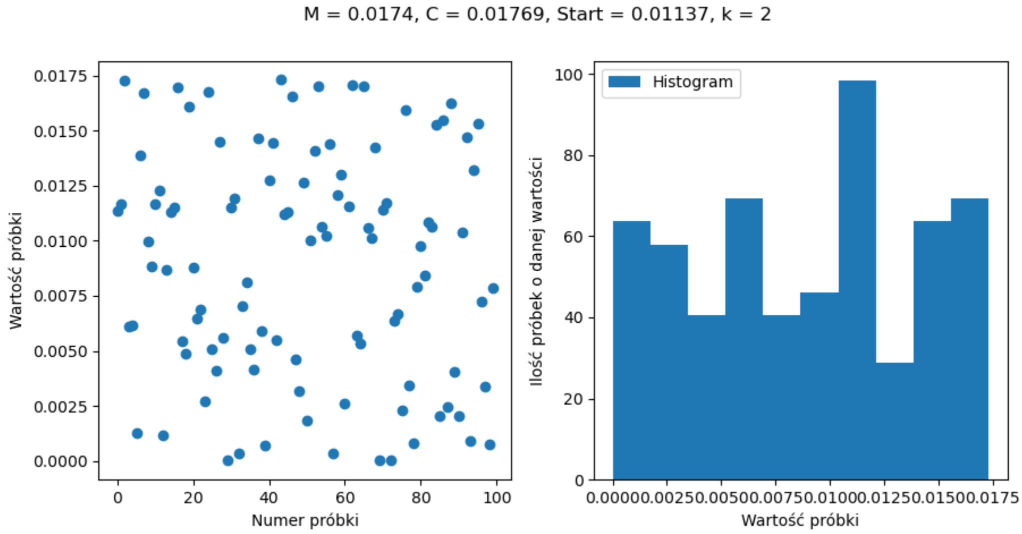
2 Generator dany równaniem

2.1 Opis

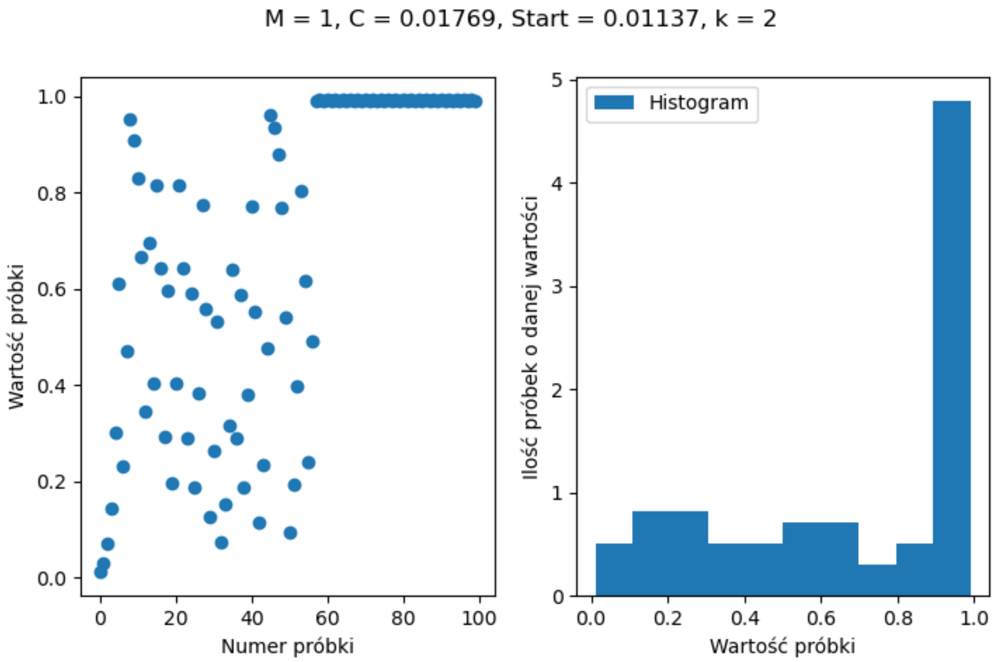
Zadanie polega na implementacji generatora liczb pseudolosowych oraz analizie wyników uzyskanych z jego udziałem. Generator oparty jest na równaniu:
$X_{n+1} = (a_0 X_n + a_1 X_{n-1} + \ldots + a_k X_{n-k} + C) \bmod m$

2.2 Zależność od współczynnika m

Współczynnik m odpowiada za zakres generowanych wartości.



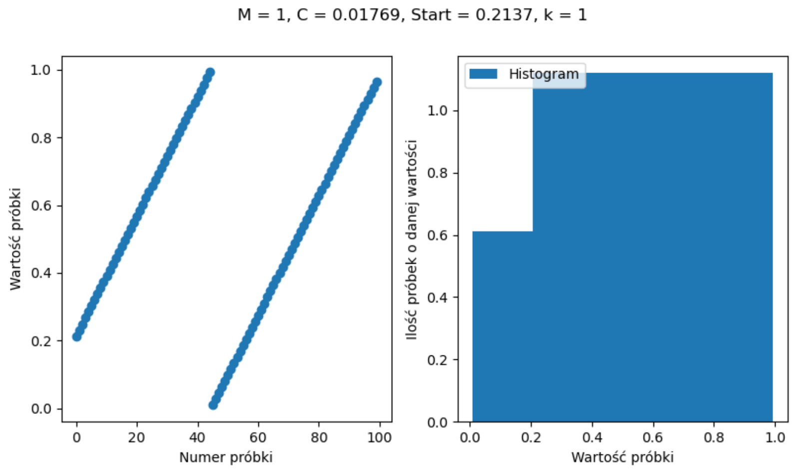
Rysunek 5: Zakres generowania liczb [0, 0.0174]



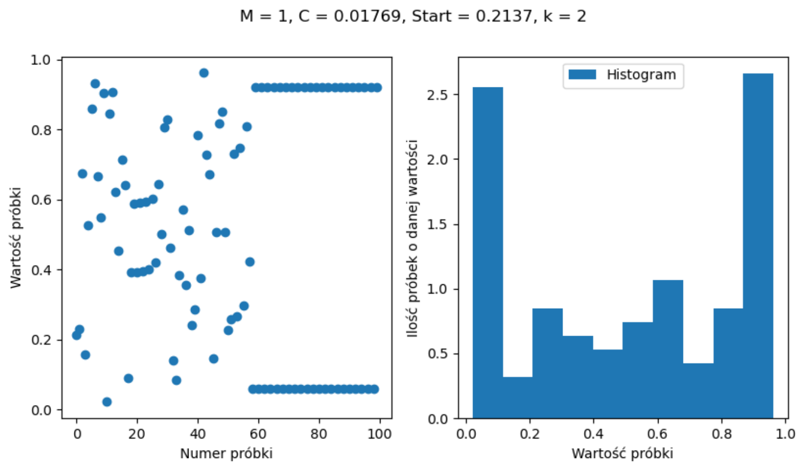
Rysunek 6: Zakres generowania liczb [0, 1]

2.3 Zależność od współczynnika k

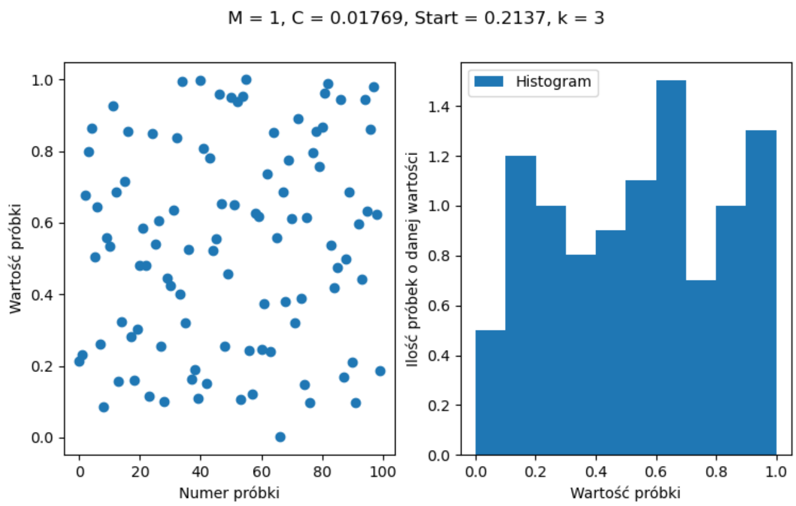
Współczynnik k odpowiada za ilość poprzednich próbek używanych podczas generowania nowych wartości.



Rysunek 7: Współczynnik k=1



Rysunek 8: Współczynnik k=2



Rysunek 9: Współczynnik k=3

- Współczynnik m odpowiada za zakres generowanych wartości. Wybór liczby całkowitej może spowodować zatrzymanie generatora.
- Ustawienie współczynnika k na wartość równą jeden uniemożliwia generowanie wartości losowych.
- Im większa wartość współczynnika k tym lepsze wyniki generatora.

3 Metoda odwracania dystrybuanty

3.1 Opis

Metoda odwracania dystrybuanty polega na odwróceniu funkcji dystrybuanty. Do uzyskania funkcji dystrybuanty posłużymy się całkowaniem funkcji opisującej gęstość prawdopodobieństwa analizowanego rozkładu.

3.2 Rozkład numer 1

Równanie funkcji rozkładu gęstość prawdopodobieństwa:

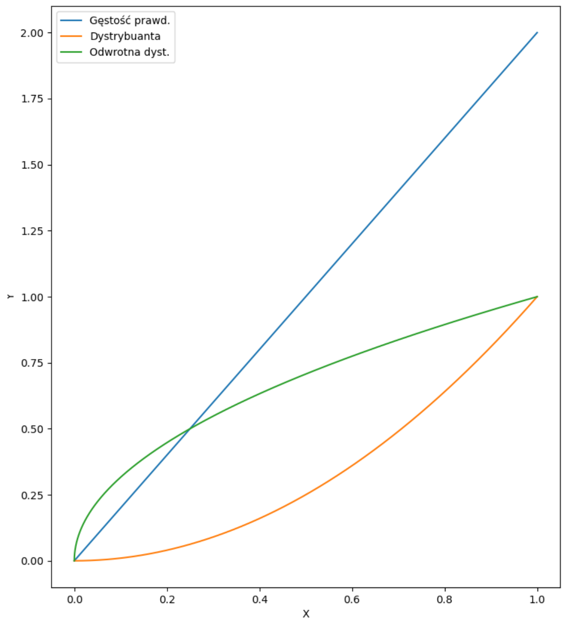
$$f(x) = \begin{cases} 2x \quad dla \quad x \in [0,1] \\ 0 \quad dla \quad x \in (-\infty, 0) \cup (1, \infty) \end{cases} \tag{1}$$

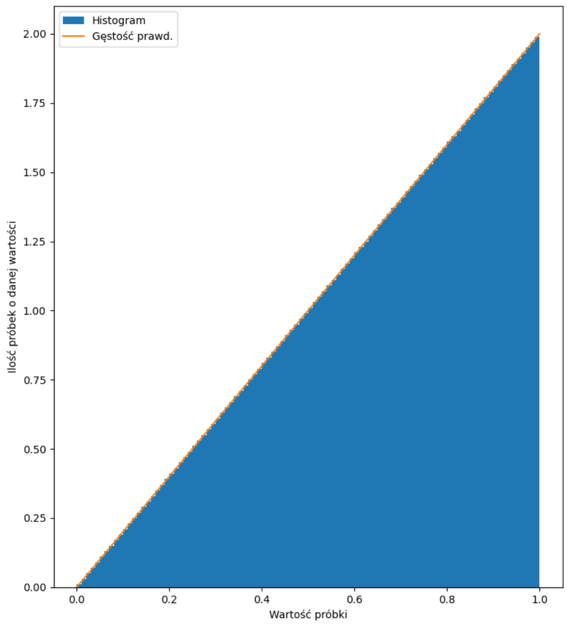
Dystrybuanta:

$$F(x) = \begin{cases} 0 \quad dla \quad x \in (-\infty, 0) \\ x^2 \quad dla \quad x \in [0,1] \\ 1 \quad dla \quad x \in (1, \infty) \end{cases} \tag{2}$$

Odwrotna dystrybuanta:

$$F^{-1}(y) = \sqrt{y}. \tag{3}$$





3.3 Rozkład numer 2

Równanie funkcji rozkładu gęstość prawdopodobieństwa:

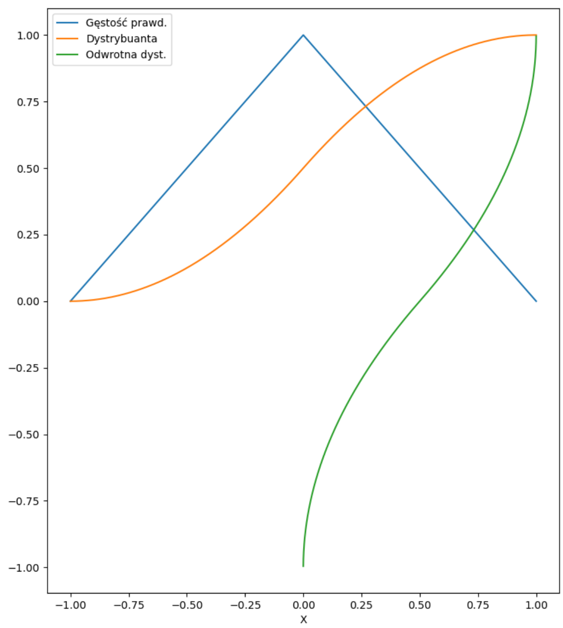
$$f(x) = \begin{cases} x+1 \quad dla \quad x \in (-1,0) \\ -x+1 \quad dla \quad x \in [0,1) \\ 0 \quad dla \quad x \notin (-1,1) \end{cases} \tag{4}$$

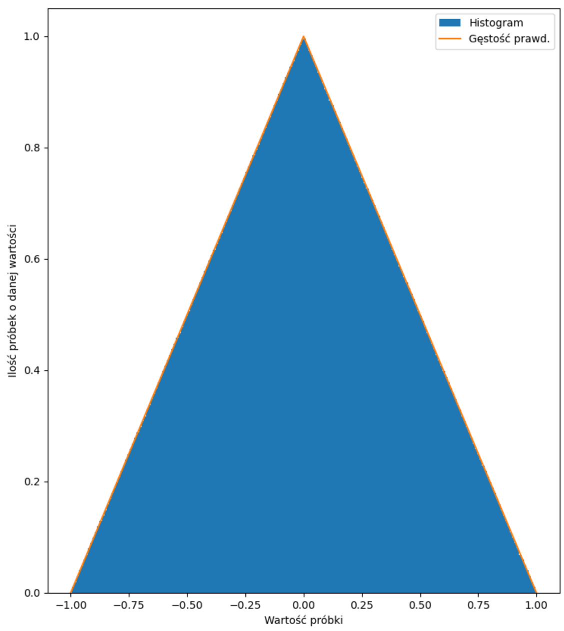
Dystrybuanta:

$$F(x) = \begin{cases} \frac{1}{2} - \frac{x^2}{2} + x \quad dla \quad x \in [0,1) \\ \frac{1}{2} + \frac{x^2}{2} + x \quad dla \quad x \in (-1,0) \\ 0 \quad dla \quad x \in (-\infty,-1] \\ 1 \quad dla \quad x \in [1,\infty) \end{cases} \tag{5}$$

Odwrotna dystrybuanta:

$$F^{-1}(y) = \begin{cases} \sqrt{2y} - 1 \quad dla \quad x \in [0,\frac{1}{2}] \\ 1 - \sqrt{2-2y} \quad dla \quad x \in (\frac{1}{2},1] \end{cases} \tag{6}$$





3.4 Rozkład wykładniczy

Równanie funkcji rozkładu gęstość prawdopodobieństwa:

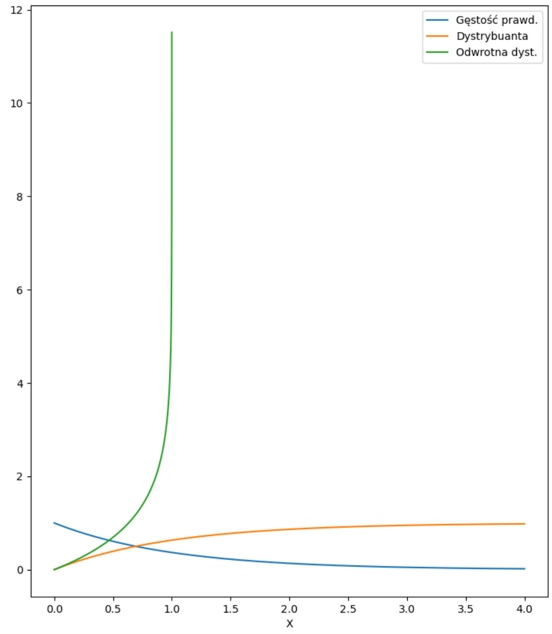
$$f(x) = e^{-x} \quad dla \quad x \in [0,\infty) \tag{7}$$

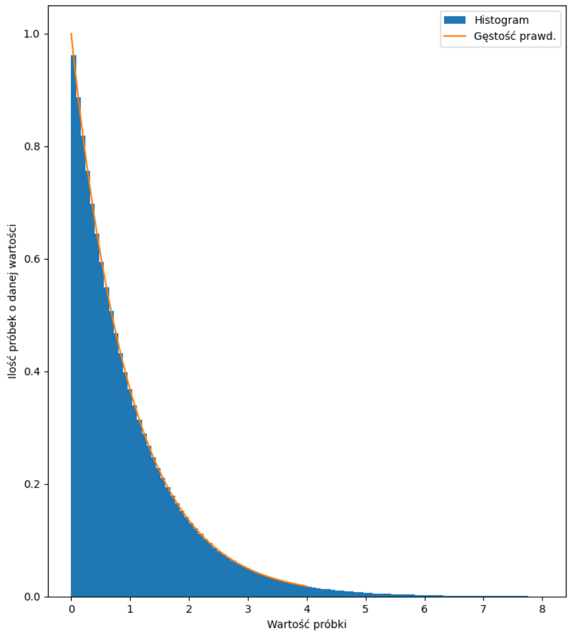
Dystrybuanta:

$$F(x) = 1 - e^{-x} \quad dla \quad x \in [0,\infty) \tag{8}$$

Odwrotna dystrybuanta:

$$F^{-1}(y) = -ln(1-y) \quad dla \quad x \in [0,\infty) \tag{9}$$





3.5 Rozkład Laplace'a

Równanie funkcji rozkładu gęstość prawdopodobieństwa:

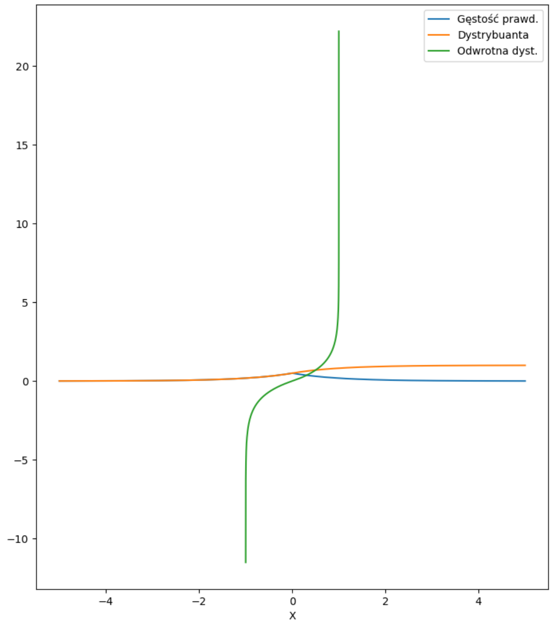
$$F(x) = \frac{1}{2}e^{-|x|} \tag{10}$$

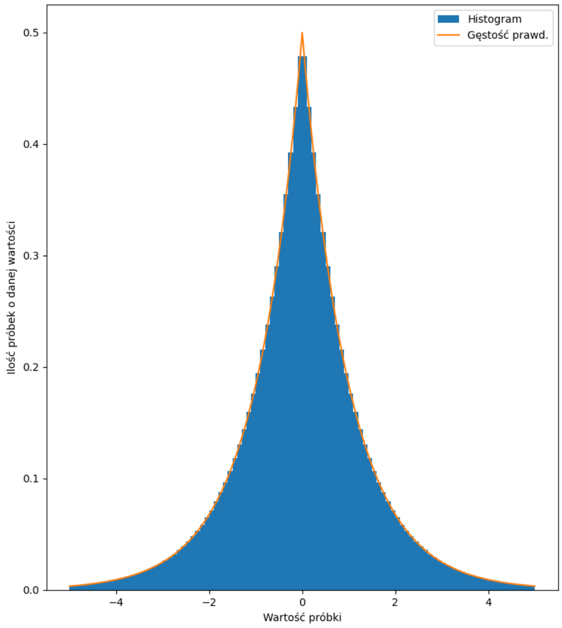
Dystrybuanta:

$$F^{-1}(y) = \begin{cases} \frac{1}{2} + \frac{1}{2}(1 - e^{-x}) & dla \quad x \in [0, \infty) \\ \frac{1}{2} - \frac{1}{2}(1 - e^{-x}) & dla \quad x \in (-\infty, 0) \end{cases} \tag{11}$$

Odwrotna dystrybuanta:

$$F^{-1}(y) = \begin{cases} -ln(1 - y) \quad dla \quad x \in [0, \infty) \\ ln(1 + y) \quad dla \quad x \in (-\infty, 0) \end{cases} \tag{12}$$





4 Podsumowanie