

# U.B.A. FACULTAD DE INGENIERÍA

## Departamento de Computación

### Modelos y Simulación 7526 - 9519

#### TRABAJO PRÁCTICO #1

#### *Números al azar y Test estadísticos*

**Curso: 2019 - 1er Cuatrimestre**

**Turno: Miércoles**

GRUPO N° 1	
Integrantes	Padrón
****, *****	*****
Gamarra Silva, Cynthia Marlene	92702
****, *****	*****
<b>Fecha de Entrega:</b>	24-04-2019
<b>Fecha de aprobación:</b>	
<b>Calificación:</b>	
<b>Firma de aprobación:</b>	

**Observaciones:**

# Índice

# 1. Enunciado del trabajo práctico



## Trabajo Práctico 1

Modelos y Simulación - 75.26 – 95.19

### Consideraciones generales

Debe entregarse un informe explicando el procedimiento utilizado para resolver cada ejercicio, detallando las conclusiones que se solicitan en cada punto, e integrando el código fuente utilizado.

## Números al azar

### Ejercicio 1

Utilizando Matlab, Octave o Python implementar un Generador Congruencial Lineal (GCL) de módulo  $2^{32}$ , multiplicador 1013904223, incremento de 1664525 y semilla igual a la parte entera de la suma ponderada (0,15-0,25-0,6) de los números de padrón de los integrantes del grupo, ordenados ascendentemente.

- Informar los primeros 5 números de la secuencia.
- Modificar el GCL para que devuelva números al azar entre 0 y 1, y realizar un histograma sobre 100.000 valores generados.

### Ejercicio 2

Utilizando el generador de números aleatorios con distribución uniforme [0,1] implementado en el ejercicio 1 y utilizando el método de la transformada inversa genere números pseudoaleatorios con distribución exponencial negativa de media 20.

- Realizar un histograma de 100.000 valores obtenidos.
- Calcular la media y varianza de la distribución obtenida y compararlos con los valores teóricos.

### Ejercicio 3

Utilizando el método de Box-Muller genere de números aleatorios con distribución normal standard.

- Realizar un histograma de 100.000 valores obtenidos.
- Calcular la media y varianza de la distribución obtenida y compararlos con los valores teóricos.

### Ejercicio 4

Genere 100.000 números aleatorios con distribución Normal de media 40 y desvío estándar 6 utilizando el algoritmo de Aceptación y Rechazo.

- Realizar un histograma de frecuencias relativas con todos los valores obtenidos.
- Comparar, en el mismo gráfico, el histograma realizado en el punto anterior con la distribución normal brindada por Matlab, Octave o Python.
- Calcular la media y la varianza de la distribución obtenida y compararlos con los valores teóricos.



## Trabajo Práctico 1

Modelos y Simulación - 75.26 – 95.19

### Ejercicio 5

Utilizando el método de la transformada inversa y utilizando el generador de números aleatorios implementado en el ejercicio 1 genere números aleatorios siguiendo la siguiente función de distribución de probabilidad empírica.

Probabilidad	Valor generado
.4	1
.3	2
.12	3
.1	4
0.08	5

Muestre los resultados obtenidos en un histograma.

### Ejercicio 6

Utilizando 2 generadores de números al azar, provistos por el lenguaje elegido para resolver el tp, con distribuciones uniformes en  $[-1,1]$  genere números aleatorios en un círculo de radio 1 centrado en el origen. Muestre el resultado en un gráfico de 2 dimensiones.

## Test estadísticos

### Ejercicio 7

Realizar, sólo gráficamente, un test espectral en 2 y 3 dimensiones al generador congruencial lineal implementado en el ejercicio 1. ¿Cómo se distribuyen espacialmente los puntos obtenidos?

### Ejercicio 8

Realizar un test Chi 2 a la distribución empírica implementada en el Ej 5, analizar el resultado indicando si la distribución puede o no ser aceptada.

### Ejercicio 9

Al generador congruencial lineal implementado en el ejercicio 1 realizarle un gap test para el intervalo  $[0,2 - 0,5]$ , analizar el resultado indicando si pasa el test.

### Ejercicio 10

Aplicar el test de Kolmogorov-Smirnov al generador de números al azar con distribución normal generado en el ejercicio 3, y analizar el resultado del mismo.

Graficar la distribución acumulada real versus la distribución empírica.

## **2. Introducción**

## **3. Diseño e implementación**

## 4. Conclusiones

## Referencias

- [1] Python, Generación de números con distintas distribuciones de probabilidad,  
<https://docs.python.org/3/library/random.html>.

## A. Código fuente

### A.1. Resolución ejercicio 1

```
1  #/usr/bin/env/ python
2  # -*- coding: utf-8 -*-
3
4  import matplotlib.pyplot as plt
5
6  modulo = 2**32
7  multiplicador = 1013904223
8  incremento = 1664525
9  semilla = int(92702 * 0.15 + 93584 * 0.25 + 98757 * 0.26)
10 secuencia = [ semilla ]
11
12 def GCL( valor ):
13     return ( multiplicador * valor + incremento ) % modulo
14
15 def cargarSecuencia(secuencia,inicio, fin):
16     for i in range(inicio,fin):
17         secuencia.append( GCL( secuencia[ i-1 ] ) )
18
19 cargarSecuencia(secuencia,1, 5)
20 print("Primeros 5 numeros de la secuencia: {}".format(secuencia))
21
22 #Para que de números entre 0 y 1, dividido por su módulo
23 #Hipótesis: utilizo como semilla el valor: 0.9
24 secuenciaRango01 = [0.9]
25
26 #Cargo la lista de secuencias
27 cargarSecuencia(secuenciaRango01,1, 100000)
28
29 #divido los valores de la lista de secuencias por su modulo
30 for i in range(0,100000):
31     secuenciaRango01[i]= secuenciaRango01[i]/modulo
32
33 #histograma
34 plt.title('Histograma')
35 plt.xlabel('SecuenciaDeValores')
36 plt.ylabel('Frecuencia')
37 plt.hist(secuenciaRango01, bins =60, alpha=0.5, ec='black')
38 plt.grid(True)
39 plt.show()
40 plt.clf()
```

## A.2. Resolución ejercicio 2

```

1  #/usr/bin/env/ python
2  # -*- coding: utf-8 -*-
3
4  import math
5  import matplotlib.pyplot as plt
6
7  #Datos del ejercicio anterior
8  modulo = 2**32
9  multiplicador = 1013904223
10 incremento = 1664525
11 semilla = int(92702 * 0.15 + 93584 * 0.25 + 98757 * 0.26)
12
13 secuencia = [semilla]
14 #Generador del ejercicio anterior, para este en un rango[0,1] se debe dividir por
    modulo
15 def GCL( valor ):
16     return ( multiplicador * valor + incremento ) % modulo
17
18 #Transformada inversa
19 def transformadaInversa(u):
20     return -(1/20) * math.log(1-u)
21
22 #Creamos la secuencia utilizando el generador GCL
23 for i in range(1,100000):
24     secuencia.append( GCL( secuencia[ i-1 ] ) )
25
26 #Divido los valores de la lista de secuencias por su modulo
27 for i in range(0,100000):
28     secuencia[i]= secuencia[i]/modulo
29
30 #Aplicamos transformada inversa a la secuencia
31 for i in range(0,100000):
32     secuencia[i]= transformadaInversa(secuencia[i])
33
34 #Histograma
35 plt.title('Histograma')
36 plt.xlabel('SecuenciaDeValores')
37 plt.ylabel('Frecuencia')
38 plt.hist(secuencia, bins =60, alpha=0.5, ec='black')
39 plt.grid(True)
40 #plt.show()
41 plt.clf()
42
43 #Calculo de media
44 media = sum(secuencia)/len(secuencia)
45 #Valor simulado de la media
46 print("El valor simulado de la media es {}".format(media))
47 #Valor teorico de la media
48 print("El valor teórico de la media es {}".format(1/20))
49
50 #Calculo de varianza
51 diferenciaDeCuadrados = [(x-media)**2 for x in secuencia]
52 varianza = sum(diferenciaDeCuadrados)/len(secuencia)
53 print("El valor simulado de la varianza es {}".format(varianza))
54 print("El valor simulado de la varianza es {}".format(1/(20)**2))

```



### A.3. Resolución ejercicio 3

```
1  #/usr/bin/env/ python
2  # -*- coding: utf-8 -*-
3
4  from numpy import random, sqrt, log, sin, cos, pi
5  import matplotlib.pyplot as plt
6
7  #Distribución normal
8  u1 = random.uniform(0,1, 100000)
9  u2 = random.uniform(0,1, 100000)
10
11 #Box muller
12 z1 = sqrt(-2*log(u1))*cos(2*pi*u2)
13 z2 = sqrt(-2*log(u1))*sin(2*pi*u2)
14
15 #Histograma
16 plt.hist(z1, bins =60, alpha=0.5, ec='black')
17 plt.hist(z2, bins =60, alpha=0.5, ec='green')
18 plt.grid(True)
19 plt.show()
```

#### A.4. Resolución ejercicio 4

```
1  #/usr/bin/env/ python
2  from numpy import random, sqrt, log, sin, cos, pi
3  import matplotlib.pyplot as plt
4  from scipy.stats import norm
5
6  #Distribución normal estandar x de T, la que queremos generar
7  x = random.normal(40,6, 100000)
8
9  #Distribución normal y de T. función conocida
10 y = random.normal(0,1, 100000)
11
12 valores= x/y
13 t=max(valores)
14 print(t)
15
16
17
18 #Histograma
19 #plt.hist(u1, bins =60, normed=1, alpha=0.5, ec='black')
20 #plt.hist(u2, bins =60, alpha=0.5, ec='green')
21 #plt.grid(True)
22 #plt.show()
```

## A.5. Resolución ejercicio 5

```
1  #/usr/bin/env/ python
2  import math
3  import numpy as np
4  import matplotlib.pyplot as plt
5
6  ## datos y GCL del ejercicio 1
7  modulo = 2**32
8  multiplicador = 1013904223
9  incremento = 1664525
10 semilla = int(92702 * 0.15 + 93584 * 0.25 + 98757 * 0.26)
11 secuencia = [ semilla ]
12
13 def GCL( valor ):
14     return ( multiplicador * valor + incremento ) % modulo
15
16 ## genero 100000 valores
17 for i in range(1,100000):
18     secuencia.append( GCL( secuencia[ i-1 ] ) )
19
20 ## dividido por su modulo para tener valores (0,1)
21 for i in range(1,100000):
22     secuencia[i] = secuencia[i]/modulo
23
24 valoresFuncion = []
25 #La función inversa de la Función de distribución Empírica es:
26 for nro in secuencia:
27     if (nro >= 0 and nro < 0.4):
28         valoresFuncion.append(1)
29     elif (nro >= 0.4 and nro < 0.7):
30         valoresFuncion.append(2)
31     elif (nro >= 0.7 and nro < 0.82):
32         valoresFuncion.append(3)
33     elif (nro >= 0.82 and nro < 0.92):
34         valoresFuncion.append(4)
35     else:
36         valoresFuncion.append(5)
37
38 #histograma
39 plt.title('Histograma')
40 plt.xlabel('Valores de la función')
41 plt.ylabel('Frecuencia')
42 plt.hist(valoresFuncion, bins = 10, alpha=0.5, ec='black')
43 plt.grid(True)
44 plt.show()
45 plt.clf()
```

## A.6. Resolución ejercicio 6

```
1  #/usr/bin/env/ python
2  # -*- coding: utf-8 -*-
3
4  import matplotlib.pyplot as plt
5  import random
6
7  #Generador de números aleatorios que provee PYTHON
8  def aleatorio():
9      return random.uniform(-1,1)
10
11  listaDeValores1=[]
12  listaDeValores2=[]
13
14  #Genero 1000 valores(por ejemplo)
15  for i in range(0,10000):
16      x = aleatorio()
17      y = aleatorio()
18      if ( x**2 + y**2) < 1:
19          listaDeValores1.append(x)
20          listaDeValores2.append(y)
21
22  #Gráfico
23  plt.plot(listaDeValores1,listaDeValores2,'o',markersize=1)
24  plt.show()
```

## A.7. Resolución ejercicio 7

```
1  #/usr/bin/env/ python
2  # -*- coding: utf-8 -*-
3
4  import matplotlib.pyplot as plt
5
6  modulo = 2**32
7  multiplicador = 1013904223
8  incremento = 1664525
9  semilla = int(92702 * 0.15 + 93584 * 0.25 + 98757 * 0.26)
10 secuencia = [ semilla ]
11
12 def GCL( valor ):
13     return ( multiplicador * valor + incremento ) % modulo
14
15 def cargarSecuencia(secuencia,inicio, fin):
16     for i in range(inicio,fin):
17         secuencia.append( GCL( secuencia[ i-1 ] ) )
18
19
20 #Cargo la lista de secuencias
21 cargarSecuencia(secuencia,1, 100000)
22
23 #Gráfico en dos dimensiones
24 plt.specgram(secuencia, NFFT=256, Fs=2, Fc=0,noverlap=128)
25
26 #Gráfico en tres dimensiones
27
28 plt.show()
```

## A.8. Resolución ejercicio 8

```
1  #/usr/bin/env/ python
2  # -*- coding: utf-8 -*-
3
4  import matplotlib.pyplot as plt
5  import numpy as np
6  from scipy import stats
7
8  modulo = 2**32
9  multiplicador = 1013904223
10 incremento = 1664525
11 semilla = int(92702 * 0.15 + 93584 * 0.25 + 98757 * 0.26)
12 secuencia = [ semilla ]
13 #Nivel de significación del 1%
14 alpha = 0.01
15
16 def GCL( valor ):
17     return ( multiplicador * valor + incremento ) % modulo
18
19 def cargarSecuencia(secuencia,inicio, fin):
20     for i in range(inicio,fin):
21         secuencia.append( GCL( secuencia[ i-1 ] ) )
22
23 #Cargo la lista de secuencias
24 cargarSecuencia(secuencia,1, 100000)
25
26 #Aplicamos método de Chi-cuadrado
27 observado = secuencia
28 esperado = np.array([.25, .25, .25, .25])
29 stats.chisquare(observado, esperado)
```

## A.9. Resolución ejercicio 9

```

1
2 #Generador Ej1
3
4 import math
5 import numpy
6
7 modulo = 2**32
8 multiplicador = 1013904223
9 incremento = 1664525
10 semilla = int(92702 * 0.15 + 93584 * 0.25 + 98757 * 0.26)
11 secuencia = [ semilla ]
12
13 def GCL( valor ):
14     return ( multiplicador * valor + incremento ) % modulo
15
16 for i in range(1,5):
17     secuencia.append( GCL( secuencia[ i-1 ] ) )
18
19 secuenciaRango01 = [0.9]
20
21 for i in range(1,100000):
22     secuenciaRango01.append( GCL( secuenciaRango01[i-1]) )
23
24 for i in range(0,100000):
25     secuenciaRango01[i]= secuenciaRango01[i]/modulo
26
27 #Gap test
28 from collections import Counter
29
30 # Intervalo (enunciado)
31 a = 0.2
32 b = 0.5
33
34 # Cuento cada cuantos numeros aparece un numero de este intervalo y lo registro en un
    array
35 # Repito hasta recorrer todos los numeros generados
36
37 gaps = []
38
39 actual_gap = 0
40
41 for i in range(0, len(secuenciaRango01)):
42     numero_generado = secuenciaRango01[i]
43     if a <= numero_generado <= b:
44         gaps.append(actual_gap)
45         actual_gap = 0
46     else:
47         actual_gap += 1
48
49 frecuencias_gaps = Counter(gaps)
50
51 #el maximo gap es 23, separo en bins de 3
52 bins = [(0,3) , (4,7), (8,11), (12,15), (16,19), (20,23)]
53 bins_ocurrencias = {(0,3) : 0, (4,7): 0, (8,11): 0, (12,15): 0, (16,19): 0, (20,23):
    0}
54 # por cada gap en frecuencias_gap, le sumo su resultado al bin correspondiente
55 for gap in frecuencias_gaps:
56     for interval in bins:
57         start = interval[0]
58         finish = interval[1]
59         if start <= gap <= finish:

```

```

60     bins_ocurrencias[interval] += frecuencias_gaps[gap]
61
62 #Testeo que este for ande
63 assert bins_ocurrencias[(0,3)] == frecuencias_gaps[0] + frecuencias_gaps[1] +
    frecuencias_gaps[2] + frecuencias_gaps[3]
64 assert bins_ocurrencias[(4,7)] == frecuencias_gaps[4] + frecuencias_gaps[5] +
    frecuencias_gaps[6] + frecuencias_gaps[7]
65
66 #Ahora calculo las frecuencias relativas de cada bin de gaps
67
68 total = sum(bins_ocurrencias.values())
69 #calculo las frecuencias relativas
70 bins_frecuencias_relativas = {k: v/total for k, v in bins_ocurrencias.items()}
71
72 #calculo las frecuencias relativas acumuladas
73 bins_frecuencias_relativas_acumuladas = {}
74 bins_frecuencias_relativas_acumuladas[(0,3)] = bins_frecuencias_relativas[(0,3)]
75 bins_frecuencias_relativas_acumuladas[(4,7)] = bins_frecuencias_relativas[(4,7)] +
    bins_frecuencias_relativas_acumuladas[(0,3)]
76 bins_frecuencias_relativas_acumuladas[(8,11)] = bins_frecuencias_relativas[(8,11)] +
    bins_frecuencias_relativas_acumuladas[(4,7)]
77 bins_frecuencias_relativas_acumuladas[(12,15)] = bins_frecuencias_relativas[(12,15)]
    + bins_frecuencias_relativas_acumuladas[(8,11)]
78 bins_frecuencias_relativas_acumuladas[(16,19)] = bins_frecuencias_relativas[(16,19)]
    + bins_frecuencias_relativas_acumuladas[(12,15)]
79 bins_frecuencias_relativas_acumuladas[(20,23)] = bins_frecuencias_relativas[(20,23)]
    + bins_frecuencias_relativas_acumuladas[(16,19)]
80
81 #testeo que esto este acumulando bien
82 assert bins_frecuencias_relativas_acumuladas[(20,23)] == 1
83
84 #Calculo FX de cada bin (1 - (0.9)**x+1) siendo x el segundo valor de la tupla (por
    ej para (0,3) es 1 - (0.9)**4)
85 FX_bins = {}
86 for interval in bins:
87     finish = interval[1]
88     FX_bins[interval] = 1 - ((0.9)**(finish + 1))
89
90 #Ahora resto los valores de bins_frecuencias_relativas_acumuladas a FX_bins
91 res = {}
92 for k in FX_bins.keys():
93     res[k] = bins_frecuencias_relativas_acumuladas[k] - FX_bins[k]
94 #Falta seguir los ultimos pasos que hace este chabon: https://www.youtube.com/watch?v=xh-4i0v-0yk
95
96 #Step 4
97 max_value = max(res.values())
98
99 #Step 5 asumo alpha 0.05
100
101 n = 100000
102
103 D = 1.36/math.sqrt(n)
104 if max_value > D:
105     print('La muestra es rechazada por el GAP test')
106 else:
107     print('La hipotesis no es rechazada')

```



## A.10. Resolución ejercicio 10

```

1  #Distribucion generada en el ejercicio 3
2
3  #/usr/bin/env/ python
4  # -*- coding: utf-8 -*-
5  import numpy as np
6  from numpy import random, sqrt, log, sin, cos, pi
7  import matplotlib.pyplot as plt
8  import scipy.stats
9  import statsmodels.api as sm # recommended import according to the docs
10
11 #Distribución uniforme
12 u1 = random.uniform(0,1, 100000)
13 u2 = random.uniform(0,1, 100000)
14
15 #Box muller transformation
16 z1 = sqrt(-2*log(u1))*cos(2*pi*u2)
17 z2 = sqrt(-2*log(u1))*sin(2*pi*u2)
18
19 #Ejercicio 10:
20
21 #Aplico el test a las dos distribuciones generadas
22
23
24 test1 = scipy.stats.kstest(z1, 'norm')
25 test2 = scipy.stats.kstest(z2, 'norm')
26
27 #Hipotesis nula (de igualdad): Si no la rechazamos podemos decir que es igual a una
   normal
28 #Hipotesis alternativa (de diferencias): Si rechazamos la hipotesis nula decimos que
   hay diferencias con la distribucion normal
29 #Con un nivel de significancia del 0,05%
30
31 if test1.pvalue >= 0.05:
32     print('La variable z1 pasa el test de kolmogorov-smirnov para un nivel de
       significancia del 0.05%, por lo tanto no podemos rechazar la hipotesis nula y la
       distribucion de esta variable es igual a la distribucion normal')
33 else:
34     print('La variable z1 no pasa el test de kolmogorov-smirnov y afirmamos que
       tiene diferencias con la distribucion normal')
35 if test2.pvalue >= 0.05:
36     print('La variable z2 pasa el test de kolmogorov-smirnov para un nivel de
       significancia del 0.05%, por lo tanto no podemos rechazar la hipotesis nula y la
       distribucion de esta variable es igual a la distribucion normal')
37 else:
38     print('La variable z2 nopasa el test de kolmogorov-smirnov y afirmamos que
       tiene diferencias con la distribucion normal')
39
40
41 #Grafico de la empirica de z1
42 sample = z1
43 ecdf = sm.distributions.ECDF(sample)
44 x = np.linspace(min(sample), max(sample))
45 y = ecdf(x)
46 plt.step(x, y, label = 'empirical cdf (z1)')
47
48 #Grafico de la empirica de z2
49 sample = z2
50 ecdf = sm.distributions.ECDF(sample)
51 x = np.linspace(min(sample), max(sample))
52 y = ecdf(x)
53 plt.step(x, y, label = 'empirical cdf (z2)')

```

```
54
55 #Grafico la acumulada de la normal
56 x = np.linspace(-5, 5, 5000)
57 mu = 0
58 sigma = 1
59 y_cdf = scipy.stats.norm.cdf(x, mu, sigma) # the normal cdf
60 plt.plot(x, y_cdf, label='normal cdf')
61
62
63 plt.legend()
64 plt.show()
```