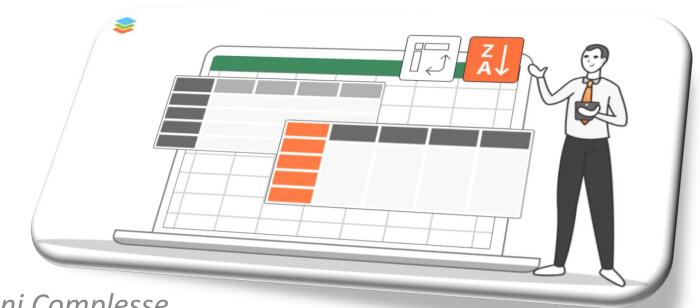
Analisi Dati con Excel

Giovanni Della Lunga

giovanni. della lunga@gmail.com

La prima regola di ogni tecnologia è che l'automazione applicata ad un'operazione efficiente ne aumenterà l'efficienza. La seconda è che l'automazione applicata ad un'operazione inefficiente ne aumenterà l'inefficienza.

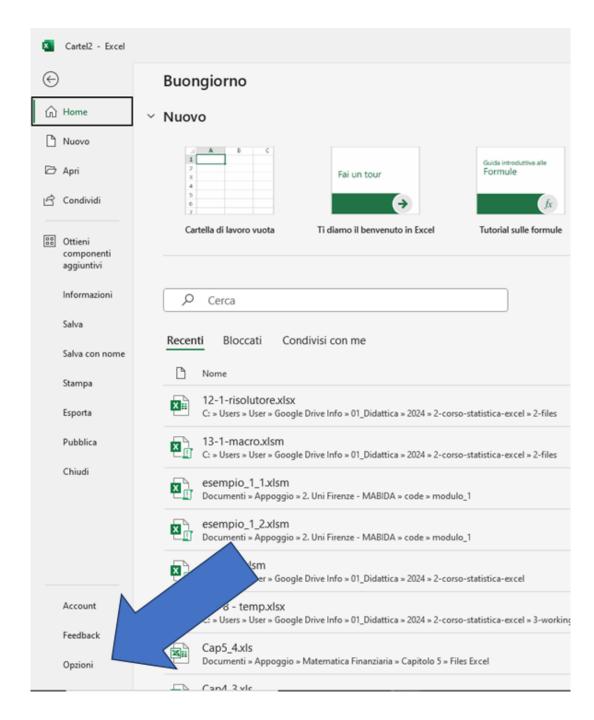
Bill Gates



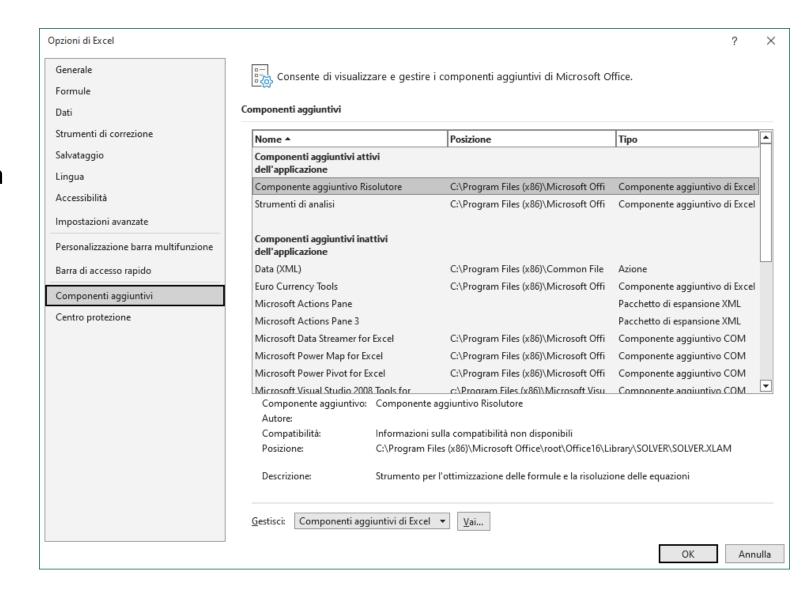
Risoluzione Numerica di Equazioni Complesse

- il Risolutore, Solver in inglese, è una sorta di "ricerca obiettivo" potenziata, infatti permette di impostare dei problemi, definire dei vincoli e ricercare la soluzione ottimale al problema.
- Grazie al Risolutore è possibile:
 - modificare il valore di più celle;
 - impostare condizioni per i valori che devono assumere le celle da modificare;
 - ottenere più soluzioni.

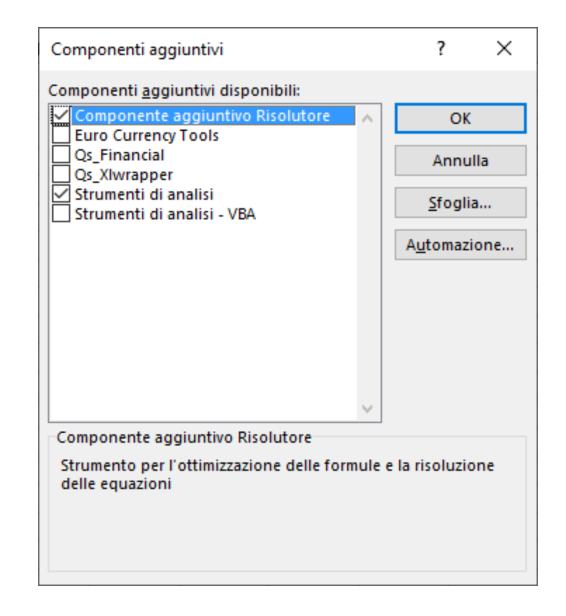
- » Prima di poter usare il Risolutore, occorre attivarlo o, meglio, occorre attivare il Componente aggiuntivo Risolutore, che aggiunge questa funzionalità a Excel.
- Per attivare un componente aggiuntivo, portatevi al Backstage (scheda File) e premete il pulsante Opzioni/Options.
- » Visualizzerete la finestra
 Opzioni. Portatevi alla sezione
 Componenti aggiuntivi/Add-ins

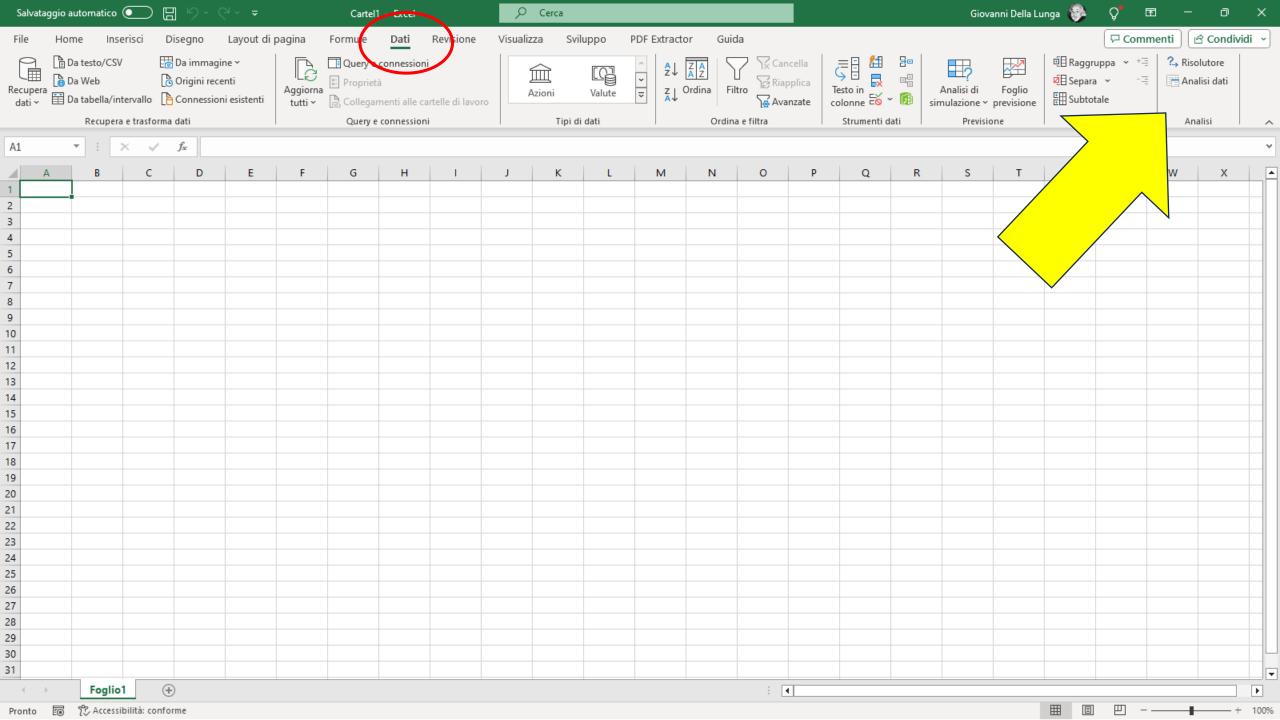


- » Prima di poter usare il Risolutore, occorre attivarlo o, meglio, occorre attivare il Componente aggiuntivo Risolutore, che aggiunge questa funzionalità a Excel.
- Per attivare un componente aggiuntivo, portatevi al Backstage (scheda File) e premete il pulsante Opzioni/Options.
- » Visualizzerete la finestra
 Opzioni. Portatevi alla sezione
 Componenti aggiuntivi/Add-ins

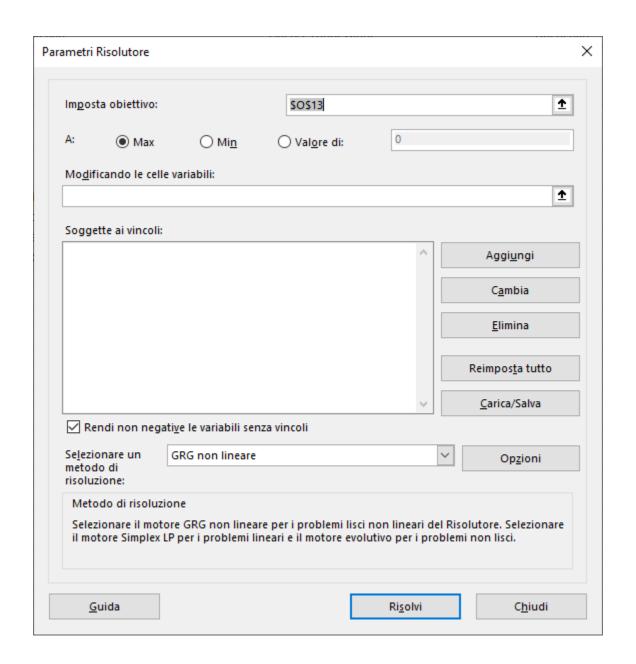


- Prima di poter usare il Risolutore, occorre attivarlo o, meglio, occorre attivare il Componente aggiuntivo Risolutore, che aggiunge questa funzionalità a Excel.
- Per attivare un componente aggiuntivo, portatevi al Backstage (scheda File) e premete il pulsante Opzioni/Options.
- » Visualizzerete la finestra
 Opzioni. Portatevi alla sezione
 Componenti aggiuntivi/Add-ins





- » Compiuta quest'operazione nel menu Strumenti comparirà la voce Risolutore.
- » A questo punto siete in grado di utilizzare il Risolutore la cui finestra di dialogo è riportata in figura



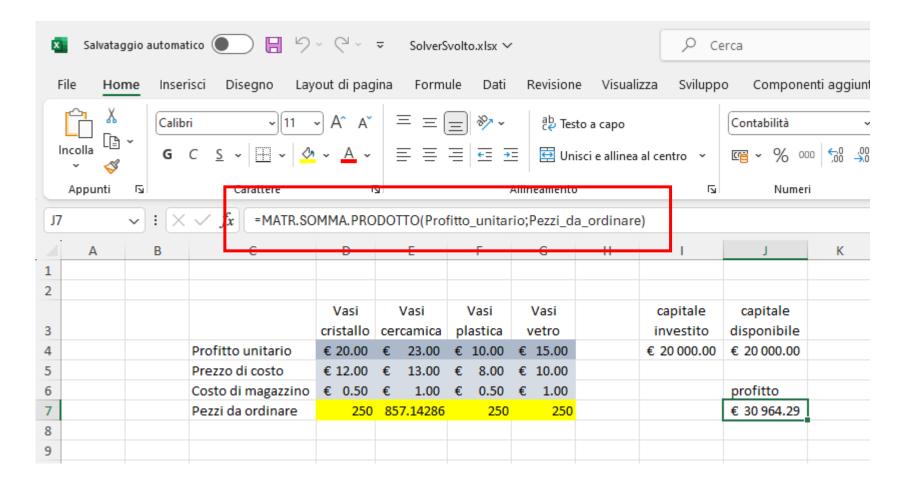
- » Immaginiamo di voler assortire il magazzino di un negozio di vasi.
- » Abbiamo tipi di vasi diversi con costi e ricavi diversi.
- » Dobbiamo decidere quanti pezzi conviene comprare di ciascun tipo di vaso, restando nel budget di € 20.000 che abbiamo a disposizione.

Α	В	С	D	Е	F	G	Н	1	J	K
			Vasi	Vasi	Vasi	Vasi			capitale	
			cristallo	cercamica	plastica	vetro			disponibile	
		Profitto unitario	€ 20.00	€ 23.00	€ 10.00	€ 15.00			€ 20 000.00	
		Prezzo di costo	€ 12.00	€ 13.00	€ 8.00	€ 10.00				
		Costo di magazzino	€ 0.50	€ 1.00	€ 0.50	€ 1.00				
		Pezzi da ordinare								

» Fatto questo, possiamo impostare le formule che ci permettono di calcolare il profitto e il capitale investito, dato che dovremo controllare che quest'ultimo rimanga inferiore al capitale disponibile...

Α	В	С	D		E		F		G	Н	1	J	K
			Vasi	V	asi	١	/asi		Vasi			capitale	
			cristallo	cerca	amica	pla	astica	١	/etro			disponibile	
		Profitto unitario	€ 20.00	€ :	23.00	€	10.00	€	15.00			€ 20 000.00	
		Prezzo di costo	€ 12.00	€ :	13.00	€	8.00	€	10.00				
		Costo di magazzino	€ 0.50	€	1.00	€	0.50	€	1.00				
		Pezzi da ordinare											

- » Il **profitto** (J7) sarà il prodotto del profitto unitario per ogni tipo di vaso, moltiplicato per i pezzi ordinati di quel tipo.
- » Bisognerà, poi, sommare tra loro i profitti ottenuti per ogni tipo di vaso.

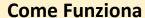


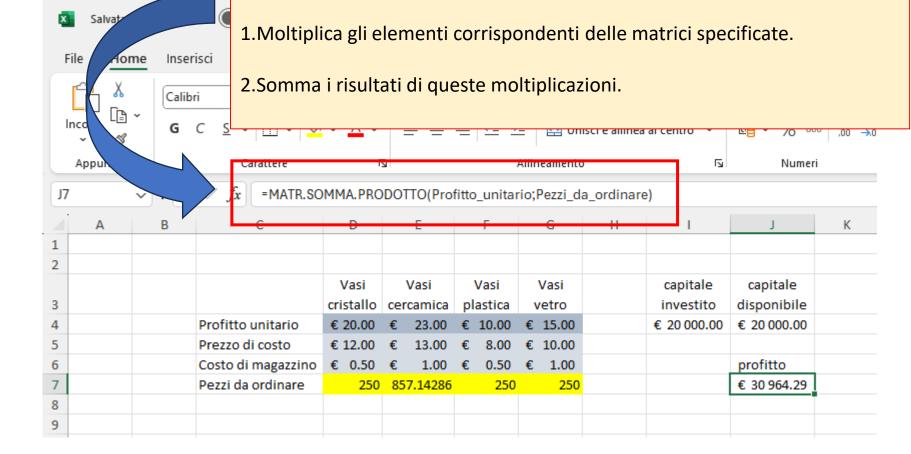
» Il profitto (J7) sarà il prodotto quel tipo.

» Bisognerà, poi, sommare tra le

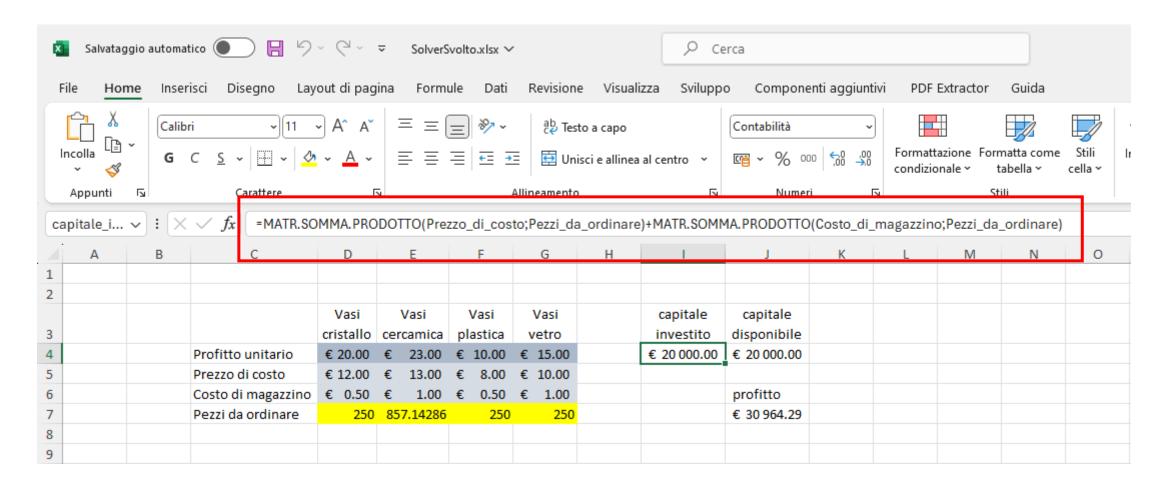
La funzione MATR.SOMMA.PRODOTTO in Excel esegue il prodotto degli elementi corrispondenti in una o più matrici (intervalli di celle) e restituisce la somma di questi prodotti. È particolarmente utile per calcoli che coinvolgono matrici e vettori, come il calcolo di somme ponderate o prodotti scalari.

hati di

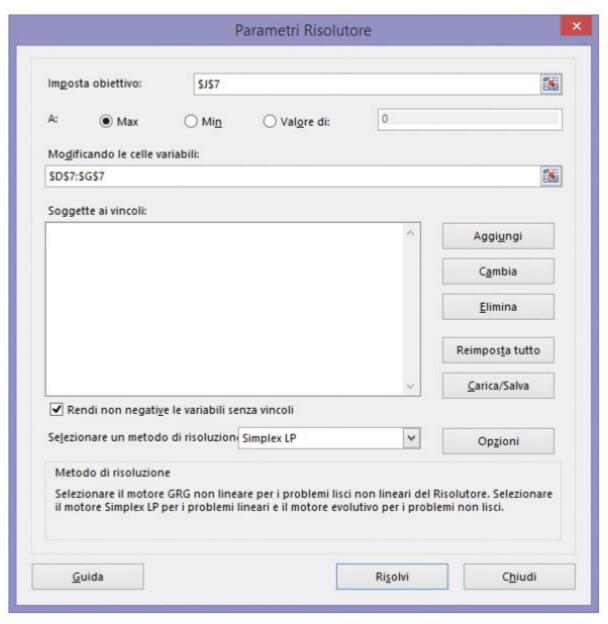




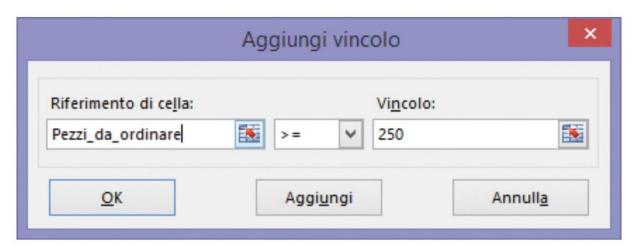
» Il **capitale investito** (I4) può essere calcolato sommando quanto investito per acquistare i vasi (Pezzi_da_ordinare * Prezzo_di_costo) a quanto speso per immagazzinare i vasi stessi (Costo_di_magazzino * Prezzo_di_costo).



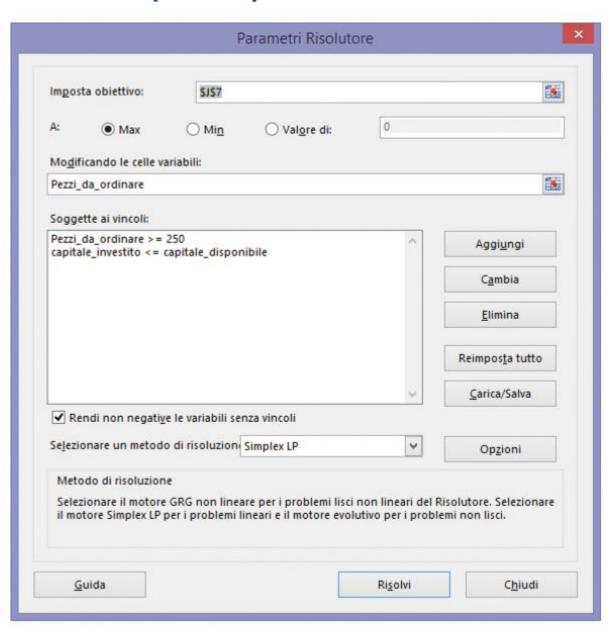
- » Dopo aver predisposto questa formula, siamo pronti per avviare il Risolutore dalla scheda Dati, gruppo Analisi, pulsante Risolutore (Data > Analysis > Solver).
- » Noi vogliamo massimizzare il profitto (J7), rispettando i seguenti vincoli:
 - il capitale investito è <= al capitale disponibile;
 - i pezzi da ordinare devono essere numeri positivi;
 - i pezzi da ordinare devo essere numeri interi;
 - vogliamo ordinare almeno 250 pezzi di ogni tipo di vaso, in modo da mantenere vario il nostro assortimento.



- » A questo punto, siamo pronti a impostare i vincoli. Tralasciamo per il momento il vincolo sui valori interi.
- » Dato che abbiamo già chiesto dei valori positivi per le variabili senza vincoli, ci rimangono solo due vincoli da impostare e, cioè, che il capitale investito sia minore o uguale a quello disponibile e che si ordinino almeno 250 pezzi di ogni tipo di vaso.



» Premete il pulsante Aggiungi/Add posto accanto all'area dei vincoli. Quindi, nella nuova finestra, potete facilmente indicare che 14 deve essere minore o uguale a J4.



							Il foglio "Esempio 1" del file Excel utilizza la funzione di ricerca obiettivo per determinare il numero di oggetti
							da vendere per raggiungere un determinato obiettivo di profitto.
			Ricerca (Obiettivo			Ecco una descrizione del problema risolto:
Assui	nzioni			Income State	ement		1. **Dati di Base**:
Unità Vendute		25000		Entrate		€ 125 000.00	- **Unità Vendute (D4)**: 25,000
Prezzo per Unità		€ 5.00		Costo Merce Venduta (COGs)		-€ 68 750.00	- **Prezzo per Unità (D5) **: 5.00
Costo per Unità		€ 2.75		Profitto Lordo		€ 56 250.00	- **Costo Merce Venduta (D6)**: 2.75 per unità
Spese Amministrative		€ 10 000.00		Spese Amministrative		-€ 10 000.00	- **Spese Amministrative (D8) **: 10,000
Tasse		21.00%		EBT (Earning Before Tax)		€ 46 250.00	- **Tasso di Tasse (D10)**: 21%
				Tasse		-€ 9 712.50	
				Profitto (Perdita) Netto		€ 36 537.50	2. **Calcoli**:
							- **Entrate (D4 * D5) **: 125,000
Tar	rget						- **Costo Merce Venduta (D4 * D6)**: -68,750
Net Income		€ 100 000.00					- **Profitto Lordo (Entrate - Costo Merce Venduta) **: 56,250
							- **EBT (Profitto Lordo - Spese Amministrative) **: 46,250
							- **Tasse (EBT * Tasso di Tasse) **: -9,712.50
							- **Profitto Netto (EBT - Tasse) **: 36,537.50
							3. **Obiettivo**:
							- **Profitto Obiettivo (D14)**: 100,000
				1			4. **Ricerca Obiettivo**:
							- Si utilizza la funzione di ricerca obiettivo per modificare il numero di unità vendute (D4)
							al fine di raggiungere un profitto netto di 100,000.
							In pratica, la funzione "Ricerca Obiettivo" modifica il valore nella cella D4 (Unità Vendute)
							fino a trovare un numero tale che, attraverso i calcoli descritti sopra, porti il Profitto Netto (D12) a 100,000.

Limiti della Funzione Ricerca Obiettivo

- **1. Monovariabile**: La funzione "Ricerca Obiettivo" può modificare solo una variabile alla volta per raggiungere un determinato obiettivo. Questo la rende meno efficace per problemi complessi che coinvolgono più variabili.
- **2. Non Linearità**: Funziona meglio con problemi lineari. Per problemi non lineari, la funzione potrebbe non trovare la soluzione ottimale.
- **3. Dipendenza dalla Convergenza**: La funzione può fallire se il modello non converge, ossia se non riesce a trovare una soluzione entro un numero ragionevole di iterazioni.
- **4. Soluzioni Locali**: Può trovare soluzioni locali che non sono necessariamente le soluzioni globali ottimali.
- **5. Intervalli Limitati**: Può richiedere un intervallo iniziale per la variabile che deve essere sufficientemente vicino alla soluzione reale per convergere correttamente.

Vantaggi nell'Utilizzare il Risolutore di Excel

- **1. Multivariabile**: Il Risolutore può gestire problemi che coinvolgono più variabili simultaneamente, rendendolo più adatto per modelli complessi.
- **2. Ottimizzazione Non Lineare**: È in grado di risolvere problemi di ottimizzazione non lineare, utilizzando metodi avanzati come la programmazione quadratica e algoritmi evolutivi.
- **3. Restrizioni e Vincoli**: Il Risolutore permette di definire vincoli su variabili, come limiti superiori e inferiori, uguaglianze e disuguaglianze, rendendo la soluzione più robusta e realistica.
- **4. Diversi Algoritmi di Soluzione**: Offre una gamma di algoritmi di soluzione (Simplex LP, GRG Nonlinear, Evolutionary), che possono essere selezionati in base alla natura del problema.
- **5. Flessibilità**: Consente l'analisi di scenari complessi e può fornire analisi di sensibilità e di rischio, utili per prendere decisioni informate.

Esempio di Utilizzo del Risolutore

Immaginiamo di voler massimizzare il profitto netto di un'azienda considerando variabili come il prezzo di vendita, i costi delle materie prime, e le spese operative. Il Risolutore permette di:

- 1. Definire l'Obiettivo: Massimizzare la cella del profitto netto.
- 2. Variabili: Modificare più celle simultaneamente, come prezzo di vendita e quantità di unità vendute.
- **3. Vincoli**: Aggiungere vincoli realistici, ad esempio, il prezzo di vendita non può scendere sotto un certo limite, o la produzione non può superare una certa capacità.

Questa flessibilità e potenza rendono il Risolutore uno strumento fondamentale per l'ottimizzazione in scenari aziendali complessi, superando di gran lunga i limiti della semplice funzione "Ricerca Obiettivo".

	R	Risolutore		Parametri Risolutore X
Assunzion	i	Income Statemen	nt	Imposta obiettivo: SHS11
Unità Vendute	61000	Entrate	€ 305 000.00	
Prezzo per Unità	€ 5.00	Costo Merce Venduta (COGs)	-€ 167 750.00	A:
Costo per Unità	€ 2.75	Profitto Lordo	€ 137 250.00	
Spese Amministrative	€ 10 000.00	Spese Amministrative	-€ 10 000.00	Mo <u>d</u> ificando le celle variabili:
Tasse	21.00%	EBT (Earning Before Tax)	€ 127 250.00	\$D\$5:\$D\$6
		Tasse	-€ 26 722.50	
		Profitto (Perdita) Netto	€ 100 527.50	Soggette ai vincoli:
				\$D\$5 <= 25000 \$D\$6 <= 9
Vincoli				
Net Income	€ 100 000.00			C <u>a</u> mbia
Unità Vendute	25000			Elimina
Prezzo per Unità	€ 9.99			
				Doi:
				Reimpos <u>t</u> a tutto
				∨ <u>C</u> arica/Salva
				✓ Rendi non negati <u>v</u> e le variabili senza vincoli
				Selezionare un metodo di GRG non lineare Opzioni
				risoluzione:
				Metodo di risoluzione
				Selezionare il motore GRG non lineare per i problemi lisci non lineari del Risolutore. Selezionare
				il motore Simplex LP per i problemi lineari e il motore evolutivo per i problemi non lisci.
				<u>G</u> uida Ri <u>s</u> olvi C <u>h</u> iudi
				Zaras Ciliadi

Esempio 2 – Integrazione con Tabella Dati

	P	Risolutore	Price and Quantity Sensitivity	
Assunz		Income Statement		€ 100 000.00 10 000 15 000 20 000 25 000 30 000 35 000 40 00
Unità Vendute	25000	Entrate	€ 205 332.28	€ 5.00
Prezzo per Unità	€ 8.21	Costo Merce Venduta (COGs)	-€ 68 750.00	€ 6.00
Costo per Unità	€ 2.75	Profitto Lordo	€ 136 582.28	€ 7.00
Spese Amministrative	€ 10 000.00	Spese Amministrative	-€ 10 000.00	€ 8.00
Tasse	21.00%	EBT (Earning Before Tax)	€ 126 582.28	€ 9.00
		Tasse	-€ 26 582.28	€ 10.00
		Profitto (Perdita) Netto	€ 100 000.00	€ 11.00
Vince	oli			
Net Income	€ 100 000.00	Tabella dati ?	×	
Unità Vendute	25000			
Prezzo per Unità	€ 9.99	Cella di input per <u>r</u> iga: \$D\$5	<u> </u>	
		Cella di input per <u>c</u> olonna: \$D\$6	1	
		OK A	Annulla	
			Annulia	

- » Dopo aver analizzato un problema lineare, occupiamoci di un problema non lineare.
- » Il problema è reso non lineare dalla funzione SE/IF che useremo per calcolare il nostro totale.
- » Il problema è semplice. Immaginiamo di aver bisogno di 100 pannelli stampati per una specifica data, mantenendo i costi più bassi possibile.
- » Abbiamo la possibilità di rifornirci da 3 laboratori. Nessuno di essi è in grado di produrre per la data che ci interessa tutti i 100 pannelli. Ognuno ha un suo limite di pezzi producibili.
- » Ogni laboratorio ha un prezzo per ogni singolo pannello, a cui vanno aggiunte le spese di spedizione. Anche il costo di spedizione si basa sulla quantità spedita. Il costo di spedizione indicato è per 20 pezzi. Questo costo va moltiplicato per multipli di 20 e spezzoni.

Tabella 1 - I dati dei tre laboratori.

	Capacità produttiva massima	Costo unitario	Spese di spedizione per 20 pezzi
LabA	20	€ 10,00	€ 6,00
LabB	60	€ 12,00	€ 5,00
LabC	30	€ 9,00	€ 7,00

Calcolo spese di spedizione

=SE(RESTO(C4;20)=0;QUOZIENTE(C4;20);QUOZIENTE(C4;20)+1)

- La formula sembra complicata, ma il fondo non lo è. A parte la funzione SE/IF, viene usata la funzione RESTO/MOD, che restituisce il resto di una divisione, e la funzione QUOZIENTE/QUOTIENT, che restituisce, appunto, il quoziente di una divisione, ma solo la sua parte intera.
- In pratica, con la funzione SE/IF andiamo a verificare se il numero di pezzi che quel laboratorio deve consegnare (C4) è divisibile per 20. In quel caso, prendiamo il quoziente della divisione, altrimenti il quoziente + 1 (si tratta della parte eccedente i 20 pezzi, per cui bisogna comunque pagare la quota di spedizione intera).
- Per finire, moltiplichiamo il risultato della funzione SE per le spese di spedizione relative a 20 pezzi (in F4).

- » A questo punto, possiamo completare il prospetto Excel, calcolando, nella colonna I, il costo complessivo per ogni laboratorio (calcolato come il numero dei pezzi prodotti moltiplicato per il costo unitario, più le spese di spedizione complessive: =C4*E4+H4).
- » In C10 calcoliamo il totale dei pezzi prodotti (=SOMMA(C4:C6)) e in I10 il costo complessivo (=SOMMA(I4:I6)).

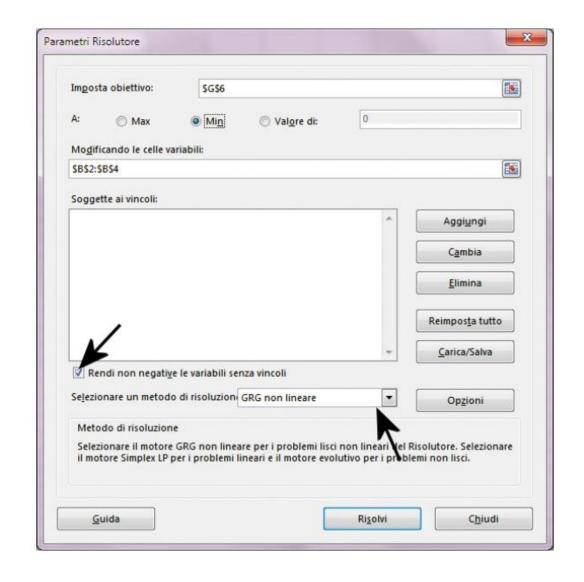
			Tabella 1 - I dati d	dei tre laboratori				
	Lab	Nro Pezzi Prodotti	Capacità produttiva massima	Costo unitario	Spese di spedizione per 20 pezzi	Quantità	Costo Spedizione Complessivo	Costo Complessivo Laboratorio
	LabA	20	20	€ 10.00	€ 6.00	1	6	€ 206.00
	LabB	50 \	60	€ 12.00	€ 5.00	3	15	€ 615.00
	LabC	30	30	€ 9.00	€ 7.00	2	14	€ 284.00
			VARIAE	ш				
otale Pezzi Prodotti		100					Costo Complessivo	=SOMMA(I4:I6

- » Prima di usare il Risolutore, facciamo il punto della situazione.
- » Il nostro obiettivo è mantenere il Costo totale (calcolato in I10) il più basso possibile comprando comunque 100 pannelli.
- » La somma dei pannelli acquistati dai tre laboratori (calcolata in C10), cioè, deve essere 100.
- » Dobbiamo decidere, grazie al Risolutore, quanti pezzi ordinare a ciascun laboratorio (in pratica i valori di C4, C5, C6).
- » In tutto questo, ci sono delle condizioni dettate dalla capacità massima produttiva di ciascun laboratorio.
- » Un altro vincolo da imporre al Risolutore è che i valori di C4, C5, C6 devono essere numeri interi (d'altronde si tratta di singoli pezzi).

Tabella 2 - I vincoli da imporre al Risolutore.

Vincolo	Descrizione
B2<=C2	LabA non può produrre più pezzi della sua capacità produttiva
B3<=C3	LabB non può produrre più pezzi della sua capacità produttiva
B4<=C4	LabC non può produrre più pezzi della sua capacità produttiva
B2, B3, B4 sono numeri interi	Ogni laboratorio produce pezzi interi
B6=100	Ci servono 100 pannelli

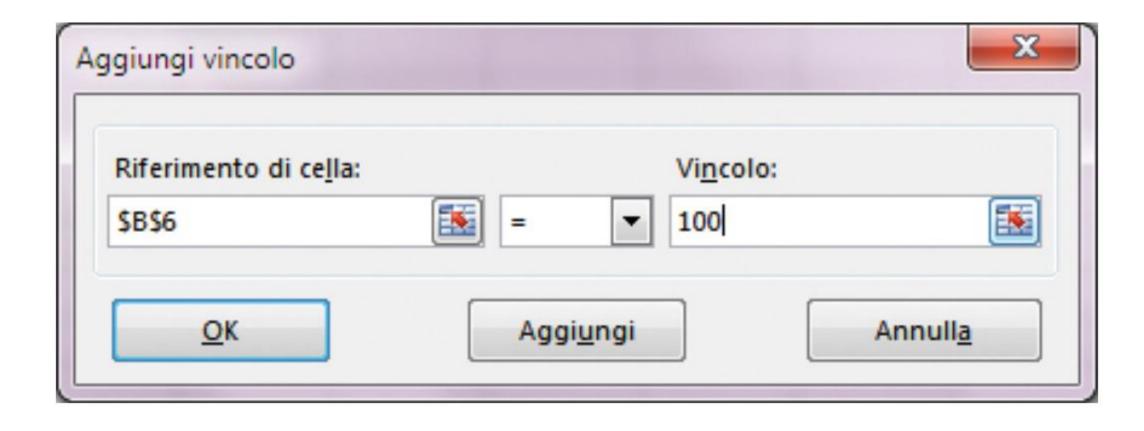
- » È giunto il momento di avviare il Risolutore (scheda Dati/Data, gruppo Analisi/Analysis).
- » Excel vi mostrerà la finestra Parametri Risolutore/Solver Parametres.
- » Nella casella Imposta obiettivo/Set Objective, indichiamo qual è la cella del risultato: G6, ossia la cella col costo complessivo.
- » Abbiamo anche chiesto di impostare il valore di quella cella al minimo possibile (opzione Min).
- » Nella casella Modificando le celle variabili By/Changing Variables Cells abbiamo già indicato che le celle variabili sono B2, B3 e B4.



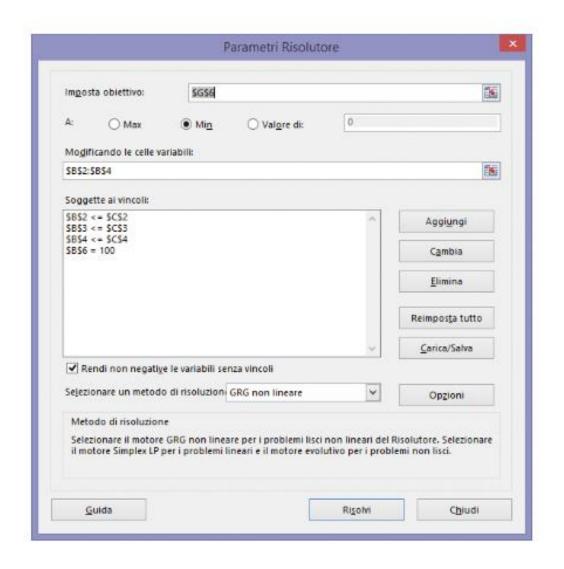
- » Siamo pronti per impostare i vincoli.
- » Pertanto, premete il pulsante Aggiungi/Add.
- » Vedrete la finestra Aggiungi vincolo/Add Constraint.
- » Per impostare il primo vincolo, nella casella Riferimento di cella/Cell Reference, scriviamo B2 e dall'elenco a discesa centrale scegliamo <=, quindi nella cella Vincolo/Constraint scriviamo C2.
- » Una volta compilata la finestra, premete il pulsante Aggiungi/Add per impostare un nuovo vincolo.
- » Impostate i vincoli che definiscono che B3 e B4 devono avere valori minori o uguali rispettivamente a C3 e C4.

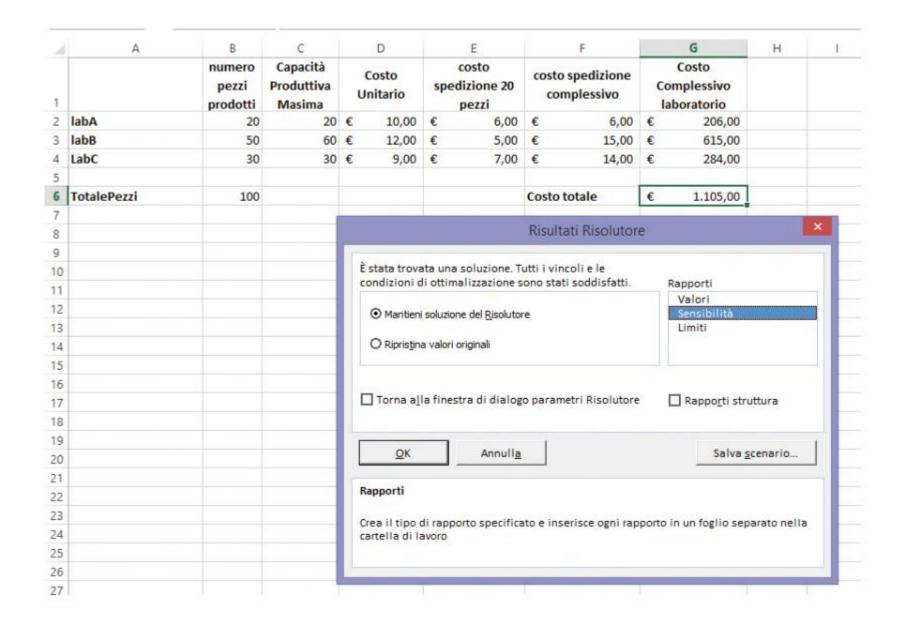


» Non ci rimane che aggiungere l'ultimo vincolo, che impone che il valore di B6 (cioè la somma complessiva dei pannelli) sia 100



- » Premete ora il pulsante OK, per tornare alla finestra Parametri Risolutore/Solver Parameters, che deve presentarsi come nella Figura.
- » Il Risolutore ha tutto quello che gli occorre per lavorare: premete il pulsante Risolvi/Solve per avviare il calcolo dei valori da usare nelle celle variabili.





Tipi di metodi di risoluzione nel risolutore Excel

Excel Solver offre tre metodi per trovare la soluzione migliore per il tuo problema. Ecco una rapida panoramica:

» GRG non lineare

- Ideale per: problemi non lineari.
- Come funziona: trova una soluzione ottimale locale.
- Metodo predefinito: questo è il metodo più comunemente utilizzato ed è impostato come predefinito.

» LP semplice

- Ideale per: problemi lineari.
- Come funziona: risolve in modo efficiente problemi con relazioni lineari.

» Evolutivo

- Ideale per: problemi non lineari complessi e non uniformi.
- Come funziona: cerca una soluzione ottimale globale, che può richiedere più tempo per l'esecuzione rispetto a GRG Non lineare.