

PAC Probabilità al calcolatore

A.A. 2008/2009

A. Gaudillièrè

Introduzione alla simulazione di variabili aleatorie

1. Algoritmi per la simulazione di variabili aleatorie.

Generatori di numeri pseudo-random. Simulazione di una variabile uniforme in $[0, 1]$ tramite funzioni standard del linguaggio C. Variabili di Bernoulli, binomiali e finite. Variabile geometrica come istante di primo successo in uno schema di Bernoulli.

Metodo Monte Carlo per il calcolo di integrali. Metodo del rigetto. Fluttuazioni nel lancio di una moneta e legge dell'arcoseno. Metodo della trasformazione per variabili aleatorie continue. Variabili esponenziali. Simulazione di variabili Gaussiane con il metodo Box-Muller. Teorema del limite centrale.

TESTI CONSIGLIATI

Note reperibili all'indirizzo:

www.mat.uniroma3.it/users/caputo/didattica/pac_2008/pac_2008.html

MODALITÀ D'ESAME

- valutazione in itinere (“esoneri”)		<input type="checkbox"/> SI	<input checked="" type="checkbox"/> NO
- esame finale	scritto	<input type="checkbox"/> SI	<input checked="" type="checkbox"/> NO
	orale	<input checked="" type="checkbox"/> SI	<input type="checkbox"/> NO
- altre prove di valutazione del profitto (meglio descritte sotto)		<input type="checkbox"/> SI	<input checked="" type="checkbox"/> NO

La prova d'esame consiste in una discussione delle esercitazioni svolte in laboratorio dallo studente durante il corso. Gli esercizi sono disponibili all'indirizzo web citato, i codici (in C) dei programmi sono disponibili su richiesta scrivendo a gaudilli-at-mat.uniroma3.it. I programmi utilizzano il linguaggio C ma si lascia allo studente la possibilità di usare altri linguaggi. Per la rappresentazione grafica dei dati si utilizza il programma Gnuplot, ma lo studente può scegliere altri programmi per la grafica, se preferisce.