

Práctica 4. Investigación Operativa

1º Grado EII UMA

Estadística e Investigación Operativa

Antoni Torres Signes

Área de Estadística e Investigación Operativa
Facultad de Ciencias



Tabla de contenidos

- Método gráfico para la resolución de un problema de programación lineal

- Generación de Procesos Estocásticos (Statgraphics)

P3.1. Método gráfico para la resolución de un problema de programación lineal

Solución gráfica de un problema de PL

- Existe una gran cantidad de programas y *software* para la resolución de problemas de programación lineal (PL).
- Además de programas específicos de alto nivel como MatLab, Mathematica, R, etc., existe también *software* de dominio libre que permite alcanzar los objetivos a un nivel introductorio, como se plantea en el presente curso.
- En este sentido, utilizamos el sitio web:
<https://www.pmcvalidators.com/graphical-method-calculator/>
- Esta es una aplicación intuitiva que permite la obtención de la solución gráfica del problema de PL.
- Solamente requiere la indicación del tipo de función objetivo, coeficientes y restricciones.
- Vemos su aplicación mediante el desarrollo de un ejemplo y un ejercicio.



Ejemplo de la Relación

Ejemplo (Ejercicio 3)

La siguiente tabla indica los costos ($C.$) de recursos utilizados por unidad producida y la cantidad disponible ($D.$) de recursos a considerar en un problema de PL para maximizar beneficios ($B.$) según dos productos ($P.$), F y G , y cuatro recursos ($R.$), H , I , J , K .

$R.$	$C. P. F$	$C. P. G$	$D.$
H	4	2	4
I	3	6	6
J	3	3	4
K	–	4	3
$B. por unidad$	12	8	

Ejemplo de la Relación

Ejemplo (Ejercicio 3, continuación)

(a) *Formular el problema de PL.*

$$\begin{aligned} \text{max.} \quad & Z = 12x_1 + 8x_2, \\ \text{s. a} \quad & 4x_1 + 2x_2 \leq 4 \\ & 3x_1 + 6x_2 \leq 6 \\ & 3x_1 + 3x_2 \leq 4 \\ & 4x_2 \leq 3 \\ & x_1 \geq 0, \quad x_2 \geq 0. \end{aligned}$$

Ejemplo de la Relación

Ejemplo (Ejercicio 3, continuación)

(b) *Obtenga el gráfico con la región factible.*

Introducimos la formulación anterior en el sitio web comentado anteriormente. Según el problema, necesitamos dos restricciones más, que se añaden con el botón verde. Con el botón azul (*Graph*) obtenemos la solución.

Objective:

Maximize

Objective Function:

12 X_1 + 8 X_2

Constraints

Constraint 1:

4 X_1 + 2 X_2 ≤ 4

Constraint 2:

3 X_1 + 6 X_2 ≤ 6

Constraint 3:

3 X_1 + 3 X_2 ≤ 4

Constraint 4:

0 X_1 + 4 X_2 ≤ 3

$X_1, X_2 \geq 0$



Graph

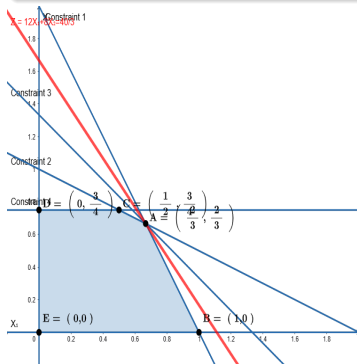
Reset



Ejemplo de la Relación

Ejemplo (Ejercicio 3, continuación)

(c) *Obtenga la solución óptima del problema.*



Here are the results of the objective function at each of the points in the feasible region

Point	Coordinates (X_1, X_2)	Objective Function Value $12X_1 + 8X_2$
A	$(2/3, 2/3)$	$12(2/3) + 8(2/3) = 40/3$
B	$(1, 0)$	$12(1) + 8(0) = 12$
C	$(1/2, 3/4)$	$12(1/2) + 8(3/4) = 12$
D	$(0, 3/4)$	$12(0) + 8(3/4) = 6$
E	$(0, 0)$	$12(0) + 8(0) = 0$

The optimal solution is $Z = 40/3$

It is obtained for the values of $X_1 = 2/3$ and $X_2 = 2/3$

Ejercicio propuesto

Ejercicio

Una empresa que tiene dos sedes, una en Málaga y otra en Marbella, ha generado 12000 euros de beneficio en el último ejercicio. De ese dinero, se abre un fondo de 5000 euros para primas a sus trabajadores que, según convenio, para el próximo ejercicio podrían ascender hasta 3000 y 5000 euros, respectivamente por sede. El dinero sobrante (el que no entra en el fondo), se utiliza para realizar inversiones en cada sede, de hasta 6000 y 4000 euros, respectivamente por sede, según se den las primas (es decir, que las cantidades guardan la misma relación). El beneficio esperado para el próximo ejercicio es de hasta 8000 y 5000 euros, respectivamente por sede, según el dinero destinado a cada sede. Obtenga cómo repartir el dinero en cada sede de manera que se maximice el beneficio esperado para el próximo ejercicio.

Ejercicio propuesto

Ejercicio (continuación)

- (a) *Obtención de la tabla*
- (b) *Formulación del problema de PL.*
- (c) *Obtención del gráfico con la región factible.*
- (d) *Obtención de la solución (o soluciones) óptima del problema.*
- (e) *Según el apartado anterior, ¿qué cantidad debería destinarse en concepto de primas en la sede de Marbella?*
- (f) *Los sindicatos negocian para eliminar el fondo de primas, es decir, que del beneficio obtenido en el ejercicio anterior, se destinen los 5000 euros, como mínimo, en concepto de primas a los trabajadores. ¿Afecta este cambio a la resolución del problema?*

P3.2. Generación de Procesos Estocásticos

Proceso de Bernoulli

- Secuencia de variables aleatorias independientes con idéntica distribución de Bernoulli, $Ber(p)$.
- Por lo tanto, se cumplen las hipótesis:
 - Independencia en las pruebas o ensayos.
 - Homogeneidad en las pruebas o ensayos.

Generación de muestras

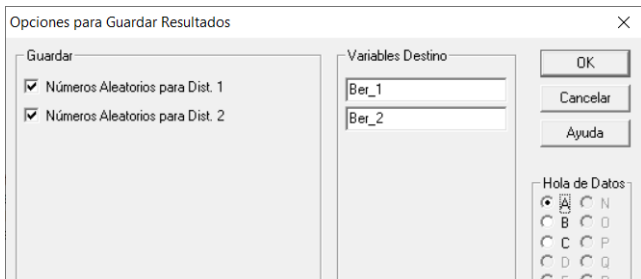
- Describir
 - > Ajuste de Distribuciones
 - > Distribuciones de Probabilidad
- Generamos dos muestras de tamaño 50 de variables aleatorias con distribuciones $Ber(0.5)$ y $Ber(0.6)$

The image shows two overlapping dialog boxes from a software application. The top dialog, titled "Opciones Bernoulli", has a close button (X) in the top right. It contains two input fields: the first is labeled "Prob. Evento" and contains the value "0.5"; the second is labeled "0.6". To the right of these fields are three buttons: "Aceptar", "Cancelar", and "Ayuda".

The bottom dialog, titled "Tablas y Gráficos", also has a close button (X) in the top right. It is divided into two columns of options. The left column is titled "TABLAS" and contains four items: "Resumen del Análisis" (checked), "Distribuciones Acumuladas", "Distribuciones Acumuladas Inversas", and "Números Aleatorios" (checked). The right column is titled "GRÁFICOS" and contains five items, all unchecked: "Función de Masa/Densidad", "Distribuciones Acumuladas", "Función de Supervivencia", "Función Logarítmica de Supervivencia", and "Función de Riesgo". To the right of these options are five buttons: "Aceptar", "Cancelar", "Todos", "Almacén", and "Ayuda".

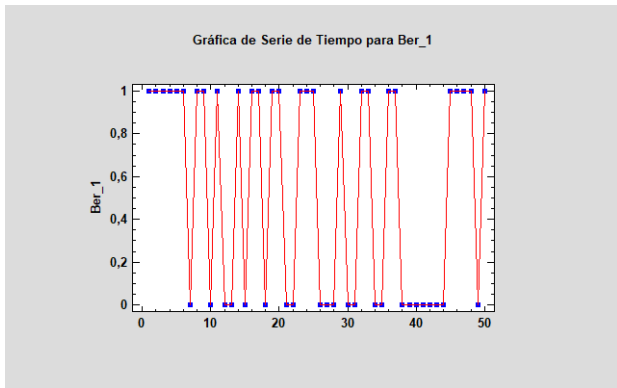
Generación de muestras

- En 'Opciones de Ventana' del panel de Números Aleatorios, le indicamos el tamaño, $n = 50$. Guardamos los resultados en el libro de datos.



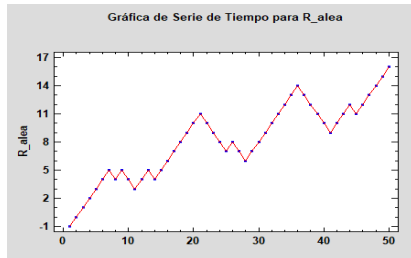
Trayectoria de un proceso

- Describir
 - > Series de Tiempo
 - > Métodos Descriptivos
- Se indica los datos del proceso generado que queremos analizar (Ber_1).



Recorrido Aleatorio

- Consideremos un caso particular de un *camino aleatorio* en el que del último estado del proceso al siguiente (etapa actual) se desplaza a la derecha o izquierda con probabilidades respectivas p , $1 - p$.
- Por lo tanto, a partir de un proceso de Bernoulli con valores 1 o -1, podemos llegar al recorrido aleatorio sin más que considerar en cada etapa la suma acumulada de las etapas anteriores.
- Creamos una columna ('Ber_2_mod'), con la modificación anterior.
- Creamos una columna ('R_alea') a partir de las sumas parciales de la columna anterior ('Ber_2_mod').



Proceso de Poisson

- Un proceso de Poisson es un proceso puntual. Dentro de los procesos puntuales, el programa permite trabajar con procesos de Poisson homogéneos, de renovación estacionaria y no homogéneos.
- Para generar un proceso de Poisson, necesitamos los puntos definidos en el tiempo, donde se dan las ocurrencias. En concreto, vamos a generar 50 puntos para un proceso de Poisson de razón $\lambda = 5$, en una columna (P_Poisson_1), siguiendo los pasos comentados anteriormente.
- Obtención de la trayectoria:

Describir

> Procesos Puntuales

> Unidimensional

Proceso de Poisson

Procesos puntuales unidimensionales

M_Exp_1
P_Poisson_1

Datos

Posiciones

Tiempos de localización:

P_Poisson_1

Opciones de proceso puntual unidimensional

Modelo

Proceso homogéneo de Poisson

Proceso de renovación estacionaria

Proceso no homogéneo de Poisson

Tasa del modelo

Función de potencia

Exponencial de primer orden

Exponencial de Segundo orden

Exponencial de tercer orden

Modelo IBM

Tiempo de suceso

El comienzo es el punto de renovación

Tablas y Gráficos

Distribución inters

Birnbaum-Sau

Cauchy

Exponencial

Exponencial 2

Potencial Exp

Normal Plegad

Gamma

Gamma 3 pará

TABLAS

Resumen del Análisis

Estadísticos de Tasa de Sucesos

Estadísticos de Tiempo Entre Sucesos

Test de la Tendencia

Modelo de Proceso Puntual

Modelo de Percentiles

Comparación de Distribuciones Alternativas

GRÁFICOS

Gráficos de Sucesos

Gráfico Acumulativo de Sucesos

Gráfico de Tasas

Gráfico ANOM

Diagrama Temporal de Dispersión Entre Sucesos

Gráfico Temporal de Percentiles Entre Sucesos

Gráficos Temporales de Distribución Entre Sucesos

Gráfico Temporal Quantil-Quantil Entre Sucesos

Aceptar

Cancelar

Ayuda

Aceptar

Cancelar

Todos

Almacén

Ayuda

Proceso de Poisson

Gráfico de Sucesos para P_Poisson_1

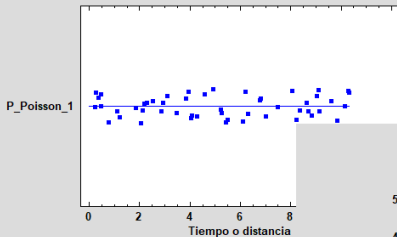
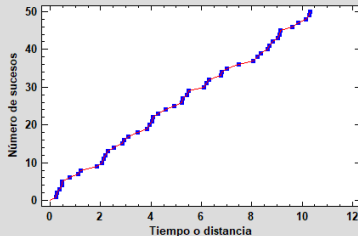


Gráfico de eventos acumulativo para P_Poisson_1



Práctica 4. Investigación Operativa

1º Grado EII UMA

Estadística e Investigación Operativa

Antoni Torres Signes

Área de Estadística e Investigación Operativa
Facultad de Ciencias

