



UNIVERSIDADE DA CORUÑA Universidade de Vigo

PROGRAMA OFICIAL DE POSTGRADO EN ESTADÍSTICA E INVESTIGACIÓN OPERATIVA

DATOS IDENTIFICATIVOS DE LA MATERIA

Código de la materia: 614493122

Nombre de la materia: Simulación Estadística

Número de créditos ECTS: 5

Curso académico: 2026/2027

Profesorado: Rubén Fernández Casal

OBJETIVOS DE LA MATERIA

Se pretende que el alumno adquiera destreza en la identificación de problemas reales que pueden ser resueltos mediante simulación y su resolución en la práctica. Para ello se tratará de que el alumno conozca el funcionamiento de los principales algoritmos de generación de números aleatorios uniformes, así como de métodos generales y específicos para simular distintas distribuciones de probabilidad (tanto discretas como continuas, incluyendo el caso multidimensional). También se pretende que el alumno conozca las principales técnicas de simulación empleadas en la práctica (especialmente en inferencia estadística), incluyendo las ventajas y limitaciones de esta metodología.

CONTENIDOS DE LA MATERIA

1. Introducción.

Conceptos básicos: sistema real, modelo, experimentación real y simulación. Ventajas e inconvenientes de la simulación. Tipos de números aleatorios: puros, pseudo-aleatorios y cuasi-aleatorios. Números aleatorios en R.

2. **Generación de números pseudoaleatorios.**
Generadores congruenciales lineales y extensiones. Análisis de la calidad de un generador de números pseudoaleatorios uniformes. Repetición de contrastes.
3. **Análisis de los resultados de simulación.**
Diagnóstico de la convergencia. Estimación de la precisión. Determinación del número de generaciones. Problemas de estabilización y dependencia.
4. **Simulación de variables continuas.**
Método de inversión. Método de aceptación/rechazo y variantes. Método de composición. Ejemplos de métodos específicos para generación de distribuciones continuas notables.
5. **Simulación de variables discretas.**
Método de la transformación cuantil. Algoritmos basados en búsqueda secuencial. Método de la tabla guía. Método de Alias. Cálculo directo de la función cuantil. Ejemplos de métodos específicos para generación de distribuciones discretas notables.
6. **Simulación de distribuciones multidimensionales.**
Método de aceptación/rechazo. Métodos basados en la factorización de la matriz de covarianzas. Método de las distribuciones condicionadas. Simulación condicional e incondicional. Simulación basada en cópulas. Simulación de distribuciones multivariantes discretas.
7. **Métodos Monte Carlo.**
Integración Monte Carlo. Muestreo por importancia. Optimización Monte Carlo. Temple simulado. Algoritmos genéticos de optimización. Métodos Monte Carlo en Inferencia Estadística. Introducción al remuestreo Bootstrap.
8. **Técnicas de reducción de la varianza.**
Variables antitéticas. Muestreo estratificado. Variables de control. Números aleatorios comunes. Condicionamiento.
9. **Introducción a los métodos de cadenas de Markov Monte Carlo.**
Muestreo de Gibbs. Algoritmo Metropolis Hastings. Diagnóstico de un algoritmo MCMC.

BIBLIOGRAFÍA BÁSICA Y COMPLEMENTARIA

Bibliografía básica

- Cao R. (2002). *Introducción a la simulación y a la teoría de colas*. NetBiblo.
- Fernández-Casal R., Cao R. y Costa J. (2023). *Técnicas de Simulación y Remuestreo*.
<https://rubenfcasal.github.io/simbook>.
- Gentle J.E. (2003). *Random number generation and Monte Carlo methods*. Springer-Verlag.
- Jones O. et al. (2009). *Introduction to Scientific Programming and Simulation Using R*. CRC.
- Ripley B.D. (1987). *Stochastic Simulation*. John Wiley & Sons.

Robert C.P. y Casella G. (2010). *Introducing Monte Carlo Methods with R*. Springer.

Ross S.M. (1999). *Simulation*. Prentice Hall.

Suess E.A. y Trumbo B.E. (2010). *Introduction to probability simulation and Gibbs sampling with R*. Springer.

Bibliografía complementaria

Bratley P., Fox B.L. y Schrage L.E. (2012). *A guide to simulation*. Springer-Verlag.

Cao R. y Fernández-Casal R. (2022). *Técnicas de Remuestreo*.
https://rubenfcasal.github.io/book_remuestreo.

Davison A.C. y Hinkley D.V. (1997). *Bootstrap Methods and Their Application*. Cambridge University Press.

Devroye L. (1986). *Non-uniform random variate generation*. Springer-Verlag.

Hörmann W. et al. (2004). *Automatic Nonuniform Random Variate Generation*. Springer.

Moeschlin O., Grycko E., Pohl C. y Steinert F. (1998). *Experimental stochastic*. Springer-Verlag.

Pardo L. y Valdés T. (1987). *Simulación. Aplicaciones prácticas a la empresa*. Díaz de Santos.

Robert C.P. y G. Casella (2004). *Monte Carlo statistical methods*. Springer.

Shao J. (2003). *Mathematical statistics*. Springer.

COMPETENCIAS

En esta materia se trabajarán las competencias básicas, generales y transversales recogidas en la memoria del título. Se indican a continuación cuáles son las competencias específicas, que se potenciarán en esta materia:

- E1 - Conocer, identificar, modelar, estudiar y resolver problemas complejos de estadística e investigación operativa, en un contexto científico, tecnológico o profesional, surgidos en aplicaciones reales.
- E3 - Adquirir conocimientos avanzados de los fundamentos teóricos subyacentes a las distintas metodologías de la estadística y la investigación operativa, que permitan su desarrollo profesional especializado.
- E4 - Adquirir las destrezas necesarias en el manejo teórico-práctico de la teoría de la probabilidad y las variables aleatorias que permitan su desarrollo profesional en el ámbito científico/académico, tecnológico o profesional especializado y multidisciplinar.
- E5 - Profundizar en los conocimientos en los fundamentos teórico-prácticos especializados del modelado y estudio de distintos tipos de relaciones de dependencia entre variables estadísticas.
- E6 - Adquirir conocimientos teórico-prácticos avanzados de distintas técnicas matemáticas, orientadas específicamente a la ayuda en la toma de decisiones, y

desarrollar capacidad de reflexión para evaluar y decidir entre distintas perspectivas en contextos complejos.

- E8 - Adquirir conocimientos teórico-prácticos avanzados de las técnicas destinadas a la realización de inferencias y contrastes relativos a variables y parámetros de un modelo estadístico, y saber aplicarlos con autonomía suficiente un contexto científico, tecnológico o profesional.
- E9 - Conocer y saber aplicar con autonomía en contextos científicos, tecnológicos o profesionales, técnicas de aprendizaje automático y técnicas de análisis de datos de alta dimensión (big data).
- E10 - Adquirir conocimientos avanzados sobre metodologías para la obtención y el tratamiento de datos desde distintas fuentes, como encuestas, internet, o entornos "en la nube".

METODOLOGÍA DOCENTE: ACTIVIDADES DE APRENDIZAJE Y SU VALORACIÓN EN CRÉDITOS ECTS

La enseñanza constará de clases expositivas e interactivas, así como de la tutorización del aprendizaje y de las tareas encomendadas al alumnado. Durante las clases se presentarán los aspectos teóricos relevantes de la materia y las herramientas para su aplicación en la práctica. Se empleará el paquete estadístico R, por lo que es necesario que los alumnos dispongan en el aula de un ordenador.

La actividad presencial y el correspondiente trabajo personal del alumno para su preparación serán de 3.5 créditos ECTS (incluyendo el examen final). Los otros 1.5 créditos ECTS de la materia corresponden a la realización de ejercicios y trabajos prácticos durante el curso.

CRITERIOS Y MÉTODOS DE EVALUACIÓN

La evaluación consistirá en la realización de ejercicios y trabajos prácticos, individuales o en grupo, que se les propondrán a los alumnos (evaluación continua), y en un examen escrito teórico-práctico. Las distintas actividades de evaluación permitirán valorar el nivel de adquisición de las competencias básicas CB6-CB10, generales CG1-CG5, transversales CT1-CT5 y específicas E1-E10.

En la primera oportunidad, la nota del examen representará el 70% de la calificación global, mientras que el 30% restante corresponderá a la evaluación continua. En la segunda oportunidad la calificación global será el máximo de la nota del nuevo examen y de la media ponderada del nuevo examen y la evaluación continua. En ambas oportunidades, si no se obtiene una calificación de al menos 4 sobre 10 en cada una de las dos partes, evaluación continua y examen, se establecerá un máximo de 4.5 en el cálculo de su promedio.

TIEMPO DE ESTUDIO Y DE TRABAJO PERSONAL QUE DEBE DEDICAR UN ESTUDIANTE PARA SUPERAR LA MATERIA

Cada crédito ECTS se traduce en 7 horas de clase de tipo presencial. Se estima que el alumnado necesitará una hora para preparar el material correspondiente a cada hora presencial, previa a la propia clase. Posteriormente, precisará de hora y media para la comprensión global de los contenidos, incluyendo las actividades asociadas a ejercicios y otras tareas. En total resultarán 24.5 horas por crédito ECTS.

RECOMENDACIONES PARA EL ESTUDIO DE LA MATERIA

Es necesario que el alumno posea conocimientos (teóricos y aplicados) básicos de Estadística. Para superar con éxito la materia es aconsejable la asistencia a las clases, siendo fundamental el seguimiento diario del trabajo realizado en el aula. Disponer de conocimientos generales del entorno estadístico R facilitará el aprovechamiento de las clases y la realización de las prácticas.

RECURSOS PARA EL APRENDIZAJE

Bibliografía, apuntes y ordenador. Uso del equipo de Teams de la asignatura, del repositorio de material docente del máster, del libro de apuntes en abierto (<https://rubenfcasal.github.io/simbook>, disponible en el repositorio Github: <https://github.com/rubenfcasal/simbook>) y del software estadístico R.

OBSERVACIONES

El desarrollo de los contenidos de la materia se realizará teniendo en cuenta que las competencias a adquirir por el alumnado deben cumplir con el nivel MECES3. Además de adquirir conocimientos sobre las herramientas fundamentales de la simulación estadística, el alumnado deberá ser capaz de programar de manera autónoma los distintos métodos.

Para los casos de realización fraudulenta de ejercicios o pruebas, será de aplicación lo recogido en las respectivas normativas de las universidades participantes en el Máster en Técnicas Estadísticas.

Esta guía y los criterios y metodologías en ella descritos están sujetos a las modificaciones que se deriven de normativas y directrices de las universidades participantes en el Máster en Técnicas Estadísticas.