指定された分布に従う乱数

モデリングとシミュレーション

2016年度

©只木進一（佐賀大学）

一様乱数から指定された分布に従う乱数へ

- シミュレーションにおいて、乱数の分布が指定される場合がある
  - 指数分布に従う乱数
    - でたらめに事象が発生する
  - 正規分布に従う乱数
    - ある平均値のまわりのでたらめな揺らぎ
- 変換法
- 棄却法

確率分布

- 実数に対する分布
  - 実数は連続であることに注意
  - 「ある値になる確率」はあり得ない
- 確率変数$X \in [a, b)$に対して確率分布を定義

$$F(x) = P(a \leq X < x)$$

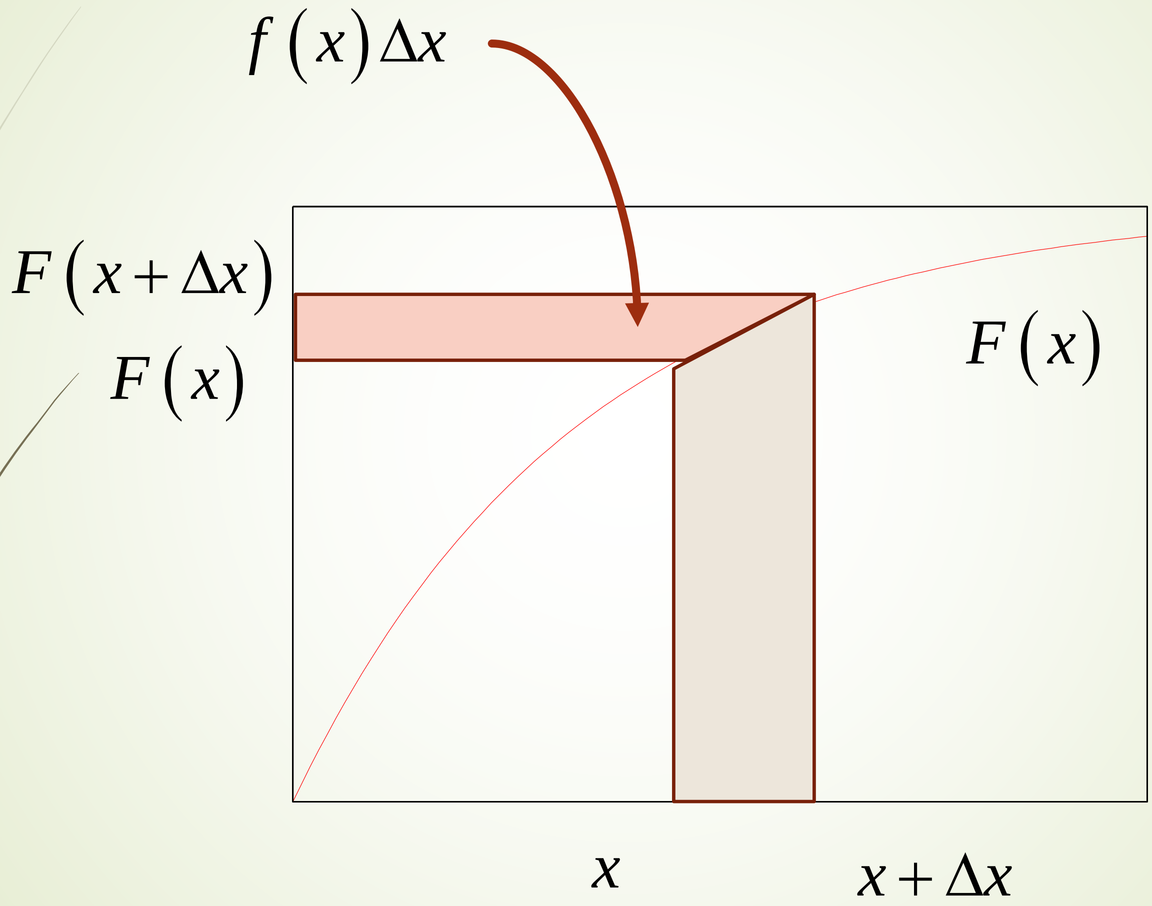
  - 注意：$a \leq X < x$という「範囲」に対して確率が定義されている

確率密度

- 区間$P(X \in [x, x+\Delta x))$

$$f(x)\Delta x = \frac{\mathrm{d}}{\mathrm{d}x} F(x) \Delta x$$

- $f(x)$を確率密度と呼ぶ



$f(x)\Delta x$
$F(x+\Delta x)$
$F(x)$
$F(x)$
x
$x+\Delta x$

変換法

- $r \in [0,1)$の一様乱数を生成
  - xへ変換　　$x = F^{-1}(r)$
- $[x, x+\Delta x)$に入る確率
  - $[F(x), F(x+\Delta x))$の長さ

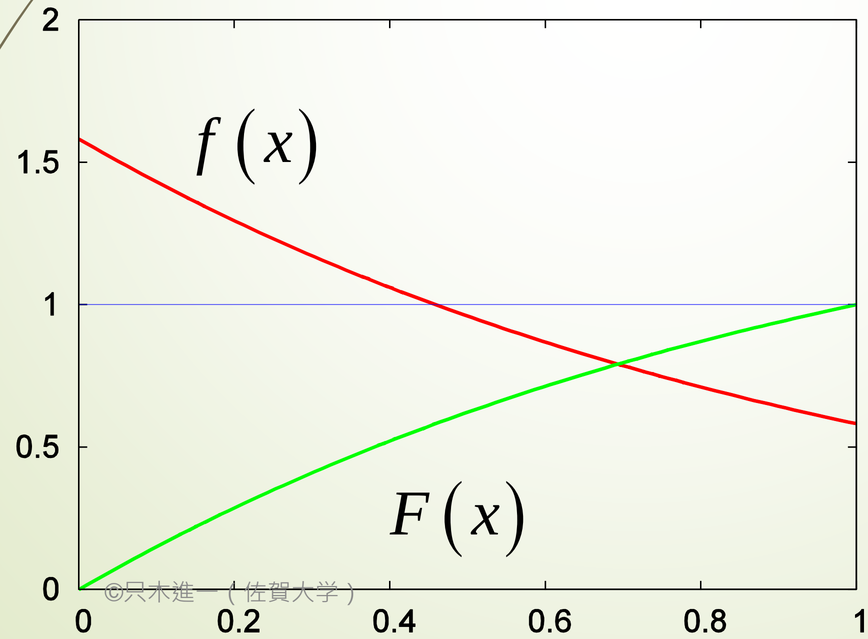
$$F(x+\Delta x) - F(x) = f(x)\Delta x + O\left(\Delta x^2\right)$$

  - つまり、$f(x)$に従う乱数

例：指数分布

$$f(x) = Ae^{-x}, \quad 0 \le x < 1, \quad A = \frac{e}{e-1}$$

$$F(x) = \int_0^x f(y)\,\mathrm{d}y = A\left(1 - e^{-x}\right)$$



$$F^{-1}(r) = -\ln(1 - r/A)$$

変換法の困難さ

- 変換法が使えるためには
  - 確率分布$F(x)$の表式を得られる
    - 不定積分の表式が得られる
  - 確率分布の逆関数$F^{-1}(x)$の表式を得られる
- これらは、かなり特殊な場合

正規分布：特殊な例

$$f(x)=\frac{1}{\sqrt{2\pi\sigma^2}}\exp\left(-\frac{x^2}{2\sigma^2}\right),\quad -\infty<x<\infty$$

- 不定積分は誤差関数と呼ばれ、表式は知られていない
  - 数表があるのみ
- 標準的な確率分布
  - よく使われる

- 二次元正規分布を考える

$$f(x,y)\mathrm{d}x\mathrm{d}y = \frac{1}{2\pi\sigma^2}\exp\left(-\frac{x^2+y^2}{2\sigma^2}\right)\mathrm{d}x\mathrm{d}y$$

- 極座標へ変換 $\begin{cases} x = r\cos\theta \\ y = r\sin\theta \end{cases}$

$$f(r)r\mathrm{d}r\mathrm{d}\theta = \frac{1}{2\pi\sigma^2}\mathrm{r}\exp\left(-\frac{r^2}{2\sigma^2}\right)\mathrm{d}r\mathrm{d}\theta$$

- θ方向には一様であること
  - θ方向に積分

$$f(r)r\mathrm{d}r = \frac{1}{\sigma^2} r \exp\left(-\frac{r^2}{2\sigma^2}\right)\mathrm{d}r$$

- 動径方向の確率分布は計算可能

$$\rho = \int_0^r f(r')r'\mathrm{d}r' = \int_0^r \frac{1}{\sigma^2} r' \exp\left(-\frac{r'^2}{2\sigma^2}\right)\mathrm{d}r' = 1 - \exp\left(-\frac{r^2}{2\sigma^2}\right)$$

$$r = \sqrt{-2\sigma^2 \ln(1-\rho)}$$

- 二つの乱数$(u, v), 0 \le u, v, < 1$

$$r = \sqrt{-2\sigma^2 \ln(1-u)}, \quad \theta = 2\pi v$$

$$x = r\cos\theta$$

- 二つの乱数から一つしか作ることができないことに注意

棄却法 (rejection method)

- 変換法で生成できない分布に対応
- 効率は悪いが、応用範囲が広い

1. $f(x)$の変域を$x \in [a, b)$とし、$0 \le f(x) < m$とする
2. 乱数生成 $(x, y) \in [0,1)$
3. $z = (b - a)x + a$
4. $y < f(z)/m$ならばzを採用
5. それ以外ならば棄却
6. 次の乱数を生成

ヒストグラムと規格化

- ヒストグラムは区間毎の頻度、または相対頻度
- 確率密度関数と比較するには
  - 確率密度関数は規格化されている：積分すると1になる
- ヒストグラムを規格化するには？

- ヒストグラムの規格化
  - bin の幅w
  - bin の頻度h_i
  - $s = \sum h_i$
  - $g_i = s^{-1} w^{-1} h_i$

$$\sum w g_i = \frac{1}{sw} \sum w h_i = 1$$