第01回

- 講演者： **竹中 茂夫** 氏 (岡山理科大学理学部)
  - 題 目： 裾の重い分布に従う乱数の発生
  - 日 時： 平成 16年 5月 21日(金) 16:30 〜 17:30
  - 場 所： 数学科セミナー室 4号館 3階

種々の分野で裾の重い分布に従う確率変数が使われ始めている。 モデルと現実の比較のためには、計算機シミュ レーションが重要な役目を果たしているが、 このシミュレーションに使われる乱数は本当に裾が重いのだろうか。

裾の重い、すなわち平均や分散が無限であるような確率分布に従う乱数を、有限性に縛られた計算機で発生することは本質的に不可能である。 従って問題は、現実にシミュレーションで使用されている疑似乱数が無限大とみなせる程大きな平均を持つのか。 またそうでなければこの点を改善できるような乱数発生が可能であるのかということになる。

乱数に関わる話題では、使用する疑似乱数発生ルーティンが主要な問題とされがちだが、ここではそれを避けるために、 物理乱数発生ボードで得られた乱数を、15ビット（又は31ビット）の理想乱数と考えてシミュレーションを行っている。

[<6>]

From:
https://wiki.ma.noda.tus.ac.jp/rs/ - **(旧)理工学部 数学科**

Permanent link:
https://wiki.ma.noda.tus.ac.jp/rs/seminar/2004/001

Last update: **2017/11/17 19:23**