|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| ГЕНЕРАТОРЫ СЛУЧАЙНЫХ ЧИСЕЛ В основе метода Монте-Карло лежит генерация случайных чисел, которые должны быть равномерно распределены в интервале (0; 1).  Если генератор выдает числа, смещенные в какую-то часть интервала (одни числа выпадают чаще других), то результат решения задачи, решаемой статистическим методом, может оказаться неверным. Поэтому проблема использования хорошего генератора действительно случайных и действительно равномерно распределенных чисел стоит очень остро.  Математическое ожидание mr и дисперсия Dr такой последовательности, состоящей из n случайных чисел ri, должны быть следующими (если это действительно равномерно распределенные случайные числа в интервале от 0 до 1):  [ Формула 01 ]  [ Формула 02 ]  Если пользователю потребуется, чтобы случайное число x находилось в интервале (a; b), отличном от (0; 1), нужно воспользоваться формулой x = a + (b – a) · r, где r — случайное число из интервала (0; 1). Законность данного преобразования демонстрируется на рис. 22.1.   |  |  | | --- | --- | | |  | | --- | | [ Рис. 22.1. Схема перевода числа из интервала (0; 1) в интервал (a; b) ] | | | Рис. 22.1. Схема перевода числа из интервала (0; 1) в интервал (a; b) |   Теперь *x* — случайное число, равномерно распределенное в диапазоне от *a* до *b*. |
|  |

|  |  |
| --- | --- |
| |  | | --- | | За эталон генератора случайных чисел (ГСЧ) принят такой генератор, который порождает последовательность случайных чисел с *равномерным* законом распределения в интервале (0; 1). За одно обращение данный генератор возвращает одно случайное число. Если наблюдать такой ГСЧ достаточно длительное время, то окажется, что, например, в каждый из десяти интервалов (0; 0.1), (0.1; 0.2), (0.2; 0.3), …, (0.9; 1) попадет практически одинаковое количество случайных чисел — то есть они будут распределены равномерно по всему интервалу (0; 1). Если изобразить на графике k = 10 интервалов и частоты Ni попаданий в них, то получится экспериментальная кривая плотности распределения случайных чисел (см. рис. 22.2). | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| |  |  | | --- | --- | | |  | | --- | | [ Рис. 22.2. Частотная диаграмма выпадения случайных чисел, порождаемых реальным генератором ] | | | Рис. 22.2. Частотная диаграмма выпадения случайных чисел, порождаемых реальным генератором |   Заметим, что в идеале кривая плотности распределения случайных чисел выглядела бы так, как показано на рис. 22.3. То есть в идеальном случае в каждый интервал попадает одинаковое число точек: Ni = N/k, где N — общее число точек, k — количество интервалов, i = 1, …, k.   |  |  | | --- | --- | | |  | | --- | | [ Рис. 22.3. Частотная диаграмма выпадения случайных чисел, порождаемых идеальным генератором теоретически ] | | | Рис. 22.3. Частотная диаграмма выпадения случайных чисел, порождаемых идеальным генератором теоретически |   Следует помнить, что генерация произвольного случайного числа состоит из двух этапов:   * генерация нормализованного случайного числа (то есть равномерно распределенного от 0 до 1; * преобразование нормализованных случайных чисел *ri* в случайные числа *xi*, которые распределены по необходимому пользователю (произвольному) закону распределения или в необходимом интервале.   Генераторы случайных чисел по способу получения чисел делятся на:   * физические; * табличные; * алгоритмические.  Физические ГСЧ Примером физических ГСЧ могут служить: монета («орел» — 1, «решка» — 0); игральные кости; поделенный на секторы с цифрами барабан со стрелкой; аппаратурный генератор шума (ГШ), в качестве которого используют шумящее тепловое устройство, например, транзистор (рис. 22.4–22.5).   |  |  | | --- | --- | | |  | | --- | | [ Рис. 22.4. Схема аппаратного метода генерации случайных чисел ] | | | Рис. 22.4. Схема аппаратного метода генерации случайных чисел |  |  |  | | --- | --- | | |  | | --- | | [ Рис. 22.5. Диаграмма получения случайных чисел аппаратным методом ] | | | Рис. 22.5. Диаграмма получения случайных чисел аппаратным методом |  |  |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | --- | | |  | | --- | | Задача «Генерация случайных чисел при помощи монеты» | | |  |  |  | | --- | --- | --- | | |  | | --- | | Сгенерируйте случайное трехразрядное число, распределенное по равномерному закону в интервале от 0 до 1, с помощью монеты. Точность — три знака после запятой. | | **Первый способ решения задачи**  Подбросьте монету 9 раз, и если монета упала решкой, то запишите «0», если орлом, то «1». Итак, допустим, что в результате эксперимента получили случайную последовательность 100110100.  Начертите интервал от 0 до 1. Считывая числа в последовательности слева направо, разбивайте интервал пополам и выбирайте каждый раз одну из частей очередного интервала (если выпал 0, то левую, если выпала 1, то правую). Таким образом, можно добраться до любой точки интервала, сколь угодно точно.  Итак, **1**: интервал [0; 1] делится пополам — [0; 0.5] и [0.5; 1], — выбирается правая половина, интервал сужается: [0.5; 1]. Следующее число, **0**: интервал [0.5; 1] делится пополам — [0.5; 0.75] и [0.75; 1], — выбирается левая половина [0.5; 0.75], интервал сужается: [0.5; 0.75]. Следующее число, **0**: интервал [0.5; 0.75] делится пополам — [0.5; 0.625] и [0.625; 0.75], — выбирается левая половина [0.5; 0.625], интервал сужается: [0.5; 0.625]. Следующее число, **1**: интервал [0.5; 0.625] делится пополам — [0.5; 0.5625] и [0.5625; 0.625], — выбирается правая половина [0.5625; 0.6250], интервал сужается: [0.5625; 0.6250].  По условию точности задачи решение найдено: им является любое число из интервала [0.5625; 0.6250], например, 0.625.  В принципе, если подходить строго, то деление интервалов нужно продолжить до тех пор, пока левая и правая границы найденного интервала не СОВПАДУТ между собой с точностью до третьего знака после запятой. То есть с позиций точности сгенерированное число уже не будет отличимо от любого числа из интервала, в котором оно находится.  **Второй способ решения задачи**  Разобьем полученную двоичную последовательность 100110100 на триады: 100, 110, 100. После перевода этих двоичных чисел в десятичные получаем: 4, 6, 4. Подставив спереди «0.», получим: 0.464. Таким методом могут получаться только числа от 0.000 до 0.777 (так как максимум, что можно «выжать» из трех двоичных разрядов — это 1112 = 78) — то есть, по сути, эти числа представлены в восьмеричной системе счисления. Для перевода восьмеричного числа в десятичное представление выполним:  0.4648 = 4 · 8–1 + 6 · 8–2 + 4 · 8–3 = 0.601562510 = 0.60210.  Итак, искомое число равно: 0.602. | | | |  Табличные ГСЧ Табличные ГСЧ в качестве источника случайных чисел используют специальным образом составленные таблицы, содержащие проверенные некоррелированные, то есть никак не зависящие друг от друга, цифры. В табл. 22.1 приведен небольшой фрагмент такой таблицы. Обходя таблицу слева направо сверху вниз, можно получать равномерно распределенные от 0 до 1 случайные числа с нужным числом знаков после запятой (в нашем примере мы используем для каждого числа по три знака). Так как цифры в таблице не зависят друг от друга, то таблицу можно обходить разными способами, например, сверху вниз, или справа налево, или, скажем, можно выбирать цифры, находящиеся на четных позициях.   |  | | --- | | Таблица 22.1. Случайные цифры. Равномерно распределенные от 0 до 1 случайные числа | | |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | | **Случайные цифры** | | | | | | | | **Равномерно распределенные от 0 до 1 случайные числа** | | 9 | 2 | 9 | 2 | 0 | 4 | 2 | 6 | 0.929 | | 9 | 5 | 7 | 3 | 4 | 9 | 0 | 3 | 0.204 | | 5 | 9 | 1 | 6 | 6 | 5 | 7 | 6 | 0.269 | | **…** | | | | | | | | **…** | |   Достоинство данного метода в том, что он дает действительно случайные числа, так как таблица содержит проверенные некоррелированные цифры. Недостатки метода: для хранения большого количества цифр требуется много памяти; большие трудности порождения и проверки такого рода таблиц, повторы при использовании таблицы уже не гарантируют случайности числовой последовательности, а значит, и надежности результата. Алгоритмические ГСЧ Числа, генерируемые с помощью этих ГСЧ, всегда являются псевдослучайными (или квазислучайными), то есть каждое последующее сгенерированное число зависит от предыдущего:  *ri*+ 1 = *f*(*ri*).  Последовательности, составленные из таких чисел, образуют петли, то есть обязательно существует цикл, повторяющийся бесконечное число раз. Повторяющиеся циклы называются периодами.  Достоинством данных ГСЧ является быстродействие; генераторы практически не требуют ресурсов памяти, компактны. Недостатки: числа нельзя в полной мере назвать случайными, поскольку между ними имеется зависимость, а также наличие периодов в последовательности квазислучайных чисел.  Рассмотрим несколько алгоритмических методов получения ГСЧ:   * метод серединных квадратов; * метод серединных произведений; * метод перемешивания; * линейный конгруэнтный метод.  Метод серединных квадратов Имеется некоторое четырехзначное число R0. Это число возводится в квадрат и заносится в R1. Далее из R1 берется середина (четыре средних цифры) — новое случайное число — и записывается в R0. Затем процедура повторяется (см. рис. 22.6). Отметим, что на самом деле в качестве случайного числа необходимо брать не ghij, а 0.ghij — с приписанным слева нулем и десятичной точкой. Этот факт отражен как на рис. 22.6, так и на последующих подобных рисунках.   |  |  | | --- | --- | | |  | | --- | | [ Рис. 22.6. Схема метода серединных квадратов ] | | | Рис. 22.6. Схема метода серединных квадратов |   Недостатки метода: 1) если на некоторой итерации число R0 станет равным нулю, то генератор вырождается, поэтому важен правильный выбор начального значения R0; 2) генератор будет повторять последовательность через Mn шагов (в лучшем случае), где n — разрядность числа R0, M — основание системы счисления.  Для примера на рис. 22.6: если число R0 будет представлено в двоичной системе счисления, то последовательность псевдослучайных чисел повторится через 24 = 16 шагов. Заметим, что повторение последовательности может произойти и раньше, если начальное число будет выбрано неудачно.  Описанный выше способ был предложен Джоном фон Нейманом и относится к 1946 году. Поскольку этот способ оказался ненадежным, от него очень быстро отказались. Метод серединных произведений Число R0 умножается на R1, из полученного результата R2 извлекается середина R2\* (это очередное случайное число) и умножается на R1. По этой схеме вычисляются все последующие случайные числа (см. рис. 22.7).   |  |  | | --- | --- | | |  | | --- | | [ Рис. 22.7. Схема метода серединных произведений ] | | | Рис. 22.7. Схема метода серединных произведений |  Метод перемешивания В методе перемешивания используются операции циклического сдвига содержимого ячейки влево и вправо. Идея метода состоит в следующем. Пусть в ячейке хранится начальное число R0. Циклически сдвигая содержимое ячейки влево на 1/4 длины ячейки, получаем новое число R0\*. Точно так же, циклически сдвигая содержимое ячейки R0 вправо на 1/4 длины ячейки, получаем второе число R0\*\*. Сумма чисел R0\* и R0\*\* дает новое случайное число R1. Далее R1 заносится в R0, и вся последовательность операций повторяется (см. рис. 22.8).   |  |  | | --- | --- | | |  | | --- | | [ Рис. 22.8. Схема метода перемешивания ] | | | Рис. 22.8. Схема метода перемешивания |   Обратите внимание, что число, полученное в результате суммирования R0\* и R0\*\*, может не уместиться полностью в ячейке R1. В этом случае от полученного числа должны быть отброшены лишние разряды. Поясним это для рис. 22.8, где все ячейки представлены восемью двоичными разрядами. Пусть R0\* = 10010001 = 145, R0\*\* = 10100001 = 161, тогда R0\* + R0\*\* = 100110010 = 306. Как видим, число 306 занимает 9 разрядов (в двоичной системе счисления), а ячейка R1 (как и R0) может вместить в себя максимум 8 разрядов. Поэтому перед занесением значения в R1 необходимо убрать один «лишний», крайний левый бит из числа 306, в результате чего в R1 пойдет уже не 306, а 00110010 = 50. Также заметим, что в таких языках, как Паскаль, «урезание» лишних битов при переполнении ячейки производится автоматически в соответствии с заданным типом переменной. Линейный конгруэнтный метод Линейный конгруэнтный метод является одной из простейших и наиболее употребительных в настоящее время процедур, имитирующих случайные числа. В этом методе используется операция mod(x, y), возвращающая остаток от деления первого аргумента на второй. Каждое последующее случайное число рассчитывается на основе предыдущего случайного числа по следующей формуле:  *ri*+ 1 = mod(*k* · *ri* + *b*, *M*).   |  |  | | --- | --- | | |  | | --- | | *M* — модуль (0 < *M*);  *k* — множитель (0 ≤ *k* < *M*);  *b* — приращение (0 ≤ *b* < *M*);  *r*0 — начальное значение (0 ≤ *r*0 < *M*). | |   Последовательность случайных чисел, полученных с помощью данной формулы, называется линейной конгруэнтной последовательностью. Многие авторы называют линейную конгруэнтную последовательность при b = 0 мультипликативным конгруэнтным методом, а при b ≠ 0 — смешанным конгруэнтным методом.  Для качественного генератора требуется подобрать подходящие коэффициенты. Необходимо, чтобы число M было довольно большим, так как период не может иметь больше M элементов. С другой стороны, деление, использующееся в этом методе, является довольно медленной операцией, поэтому для двоичной вычислительной машины логичным будет выбор M = 2N, поскольку в этом случае нахождение остатка от деления сводится внутри ЭВМ к двоичной логической операции «AND». Также широко распространен выбор наибольшего простого числа M, меньшего, чем 2N: в специальной литературе доказывается, что в этом случае младшие разряды получаемого случайного числа ri + 1 ведут себя так же случайно, как и старшие, что положительно сказывается на всей последовательности случайных чисел в целом. В качестве примера можно привести одно из *чисел Мерсенна*, равное 231 – 1, и таким образом, M = 231 – 1.  Одним из требований к линейным конгруэнтным последовательностям является как можно большая длина периода. Длина периода зависит от значений M, k и b. Теорема, которую мы приведем ниже, позволяет определить, возможно ли достижение периода максимальной длины для конкретных значений M, k и b.  Теорема. Линейная конгруэнтная последовательность, определенная числами M, k, b и r0, имеет период длиной M тогда и только тогда, когда:   * числа *b* и *M* взаимно простые; * *k* – 1 кратно *p* для каждого простого *p*, являющегося делителем *M*; * *k* – 1 кратно 4, если *M* кратно 4.   Наконец, в заключение рассмотрим пару примеров использования линейного конгруэнтного метода для генерации случайных чисел.   |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | | |  | | --- | | Пример 1 | | |  |  | | --- | --- | | |  | | --- | | M = 2N k = 3 + 8 · q (или k = 5 + 8 · q) b = 0 r0 — нечетно | | | |   Было установлено, что ряд псевдослучайных чисел, генерируемых на основе данных из примера 1, будет повторяться через каждые M/4 чисел. Число q задается произвольно перед началом вычислений, однако при этом следует иметь в виду, что ряд производит впечатление случайного при больших k (а значит, и q). Результат можно несколько улучшить, если b нечетно и k = 1 + 4 · q — в этом случае ряд будет повторяться через каждые M чисел. После долгих поисков k исследователи остановились на значениях 69069 и 71365.   |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | | |  | | --- | | Пример 2 | | |  |  | | --- | --- | | |  | | --- | | M = 231 – 1 k = 1 220 703 125 b = 7 r0 = 7 | | | |   Генератор случайных чисел, использующий данные из примера 2, будет выдавать случайные неповторяющиеся числа с периодом, равным 7 миллионам.  Мультипликативный метод генерации псевдослучайных чисел был предложен Д. Г. Лехмером (D. H. Lehmer) в 1949 году. Проверка качества работы генератора От качества работы ГСЧ зависит качество работы всей системы и точность результатов. Поэтому случайная последовательность, порождаемая ГСЧ, должна удовлетворять целому ряду критериев.  Осуществляемые проверки бывают двух типов:   * проверки на равномерность распределения; * проверки на статистическую независимость.  Проверки на равномерность распределения 1) ГСЧ должен выдавать близкие к следующим значения статистических параметров, характерных для равномерного случайного закона:   |  |  |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | | |  |  | | --- | --- | | [ Формула 03 ] | — математическое ожидание; | | [ Формула 04 ] | — дисперсия; | | [ Формула 05 ] | — среднеквадратичное отклонение. | |   2) Частотный тест  Частотный тест позволяет выяснить, сколько чисел попало в интервал (mr – σr; mr + σr), то есть (0.5 – 0.2887; 0.5 + 0.2887) или, в конечном итоге, (0.2113; 0.7887). Так как 0.7887 – 0.2113 = 0.5774, заключаем, что в хорошем ГСЧ в этот интервал должно попадать около 57.7% из всех выпавших случайных чисел (см. рис. 22.9).   |  |  | | --- | --- | | |  | | --- | | [ Рис. 22.9. Частотная диаграмма идеального ГСЧ в случае проверки его на частотный тест ] | | | Рис. 22.9. Частотная диаграмма идеального ГСЧ в случае проверки его на частотный тест |   Также необходимо учитывать, что количество чисел, попавших в интервал (0; 0.5), должно быть примерно равно количеству чисел, попавших в интервал (0.5; 1).  3) Проверка по критерию «хи-квадрат»  Критерий «хи-квадрат» (χ2-критерий) — это один из самых известных статистических критериев; он является основным методом, используемым в сочетании с другими критериями. Критерий «хи-квадрат» был предложен в 1900 году Карлом Пирсоном. Его замечательная работа рассматривается как фундамент современной математической статистики.  Для нашего случая проверка по критерию «хи-квадрат» позволит узнать, насколько созданный нами *реальный* ГСЧ близок к [эталону ГСЧ](http://stratum.ac.ru/education/textbooks/modelir/lection22.html#etalonRNG), то есть удовлетворяет ли он требованию равномерного распределения или нет.  Частотная диаграмма *эталонного* ГСЧ представлена на рис. 22.10. Так как закон распределения эталонного ГСЧ равномерный, то (теоретическая) вероятность pi попадания чисел в i-ый интервал (всего этих интервалов k) равна pi = 1/k. И, таким образом, в каждый из k интервалов попадет *ровно* по pi · N чисел (N — общее количество сгенерированных чисел).   |  |  | | --- | --- | | |  | | --- | | [ Рис. 22.10. Частотная диаграмма эталонного ГСЧ ] | | | Рис. 22.10. Частотная диаграмма эталонного ГСЧ |   Реальный ГСЧ будет выдавать числа, распределенные (причем, не обязательно равномерно!) по k интервалам и в каждый интервал попадет по ni чисел (в сумме n1 + n2 + … + nk = N). Как же нам определить, насколько испытываемый ГСЧ хорош и близок к эталонному? Вполне логично рассмотреть квадраты разностей между полученным количеством чисел ni и «эталонным» pi · N. Сложим их, и в результате получим:  χ2эксп. = (*n*1 – *p*1 · *N*)2 + (*n*2 – *p*2 · *N*)2 + … + (*nk* – *pk* · *N*)2.  Из этой формулы следует, что чем меньше разность в каждом из слагаемых (а значит, и чем меньше значение χ2эксп.), тем сильнее закон распределения случайных чисел, генерируемых реальным ГСЧ, тяготеет к равномерному.  В предыдущем выражении каждому из слагаемых приписывается одинаковый вес (равный 1), что на самом деле может не соответствовать действительности; поэтому для статистики «хи-квадрат» необходимо провести нормировку каждого i-го слагаемого, поделив его на pi · N:  [ Формула 06 ]  Наконец, запишем полученное выражение более компактно и упростим его:  [ Формула 07 ]  Мы получили значение критерия «хи-квадрат» для экспериментальных данных.  В табл. 22.2 приведены *теоретические* значения «хи-квадрат» (χ2теор.), где ν = N – 1 — это число степеней свободы, p — это доверительная вероятность, задаваемая пользователем, который указывает, насколько ГСЧ должен удовлетворять требованиям равномерного распределения, или p — *это вероятность того, что экспериментальное значение* χ2эксп. *будет меньше табулированного (теоретического)* χ2теор. *или равно ему*.   |  | | --- | | Таблица 22.2. Некоторые процентные точки χ2-распределения | | |  |  |  |  |  |  |  |  | | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | |  | p = 1% | p = 5% | p = 25% | p = 50% | p = 75% | p = 95% | p = 99% | | *ν* = 1 | 0.00016 | 0.00393 | 0.1015 | 0.4549 | 1.323 | 3.841 | 6.635 | | *ν* = 2 | 0.02010 | 0.1026 | 0.5754 | 1.386 | 2.773 | 5.991 | 9.210 | | *ν* = 3 | 0.1148 | 0.3518 | 1.213 | 2.366 | 4.108 | 7.815 | 11.34 | | *ν* = 4 | 0.2971 | 0.7107 | 1.923 | 3.357 | 5.385 | 9.488 | 13.28 | | *ν* = 5 | 0.5543 | 1.1455 | 2.675 | 4.351 | 6.626 | 11.07 | 15.09 | | *ν* = 6 | 0.8721 | 1.635 | 3.455 | 5.348 | 7.841 | 12.59 | 16.81 | | *ν* = 7 | 1.239 | 2.167 | 4.255 | 6.346 | 9.037 | 14.07 | 18.48 | | *ν* = 8 | 1.646 | 2.733 | 5.071 | 7.344 | 10.22 | 15.51 | 20.09 | | *ν* = 9 | 2.088 | 3.325 | 5.899 | 8.343 | 11.39 | 16.92 | 21.67 | | *ν* = 10 | 2.558 | 3.940 | 6.737 | 9.342 | 12.55 | 18.31 | 23.21 | | *ν* = 11 | 3.053 | 4.575 | 7.584 | 10.34 | 13.70 | 19.68 | 24.72 | | *ν* = 12 | 3.571 | 5.226 | 8.438 | 11.34 | 14.85 | 21.03 | 26.22 | | *ν* = 15 | 5.229 | 7.261 | 11.04 | 14.34 | 18.25 | 25.00 | 30.58 | | *ν* = 20 | 8.260 | 10.85 | 15.45 | 19.34 | 23.83 | 31.41 | 37.57 | | *ν* = 30 | 14.95 | 18.49 | 24.48 | 29.34 | 34.80 | 43.77 | 50.89 | | *ν* = 50 | 29.71 | 34.76 | 42.94 | 49.33 | 56.33 | 67.50 | 76.15 | | *ν* > 30 | *ν* + sqrt(2*ν*) · *xp* + 2/3 · *x*2*p* – 2/3 + *O*(1/sqrt(*ν*)) | | | | | | | | *xp* = | –2.33 | –1.64 | –0.674 | 0.00 | 0.674 | 1.64 | 2.33 | |   Приемлемым считают **p** от 10% до 90%.  Если χ2эксп. много больше χ2теор. (то есть p — велико), то генератор не удовлетворяет требованию равномерного распределения, так как наблюдаемые значения ni слишком далеко уходят от теоретических pi · N и не могут рассматриваться как случайные. Другими словами, устанавливается такой большой доверительный интервал, что ограничения на числа становятся очень нежесткими, требования к числам — слабыми. При этом будет наблюдаться очень большая абсолютная погрешность.  Еще Д. Кнут в своей книге «Искусство программирования» заметил, что иметь χ2эксп. маленьким тоже, в общем-то, нехорошо, хотя это и кажется, на первый взгляд, замечательно с точки зрения равномерности. Действительно, возьмите ряд чисел 0.1, 0.2, 0.3, 0.4, 0.5, 0.6, 0.7, 0.8, 0.9, 0.1, 0.2, 0.3, 0.4, 0.5, 0.6, … — они идеальны с точки зрения равномерности, и χ2эксп. будет практически нулевым, но вряд ли вы их признаете случайными.  Если χ2эксп. много меньше χ2теор. (то есть p — мало), то генератор не удовлетворяет требованию случайного равномерного распределения, так как наблюдаемые значения ni слишком близки к теоретическим pi · N и не могут рассматриваться как случайные.  А вот если χ2эксп. лежит в некотором диапазоне, между двумя значениями χ2теор., которые соответствуют, например, p = 25% и p = 50%, то можно считать, что значения случайных чисел, порождаемые датчиком, вполне являются случайными.  При этом дополнительно надо иметь в виду, что все значения pi · N должны быть достаточно большими, например больше 5 (выяснено эмпирическим путем). Только тогда (при достаточно большой статистической выборке) условия проведения эксперимента можно считать удовлетворительными.  Итак, процедура проверки имеет следующий вид.   1. Диапазон от 0 до 1 разбивается на *k* равных интервалов. 2. Запускается ГСЧ *N* раз (*N* должно быть велико, например, *N*/*k* > 5). 3. Определяется количество случайных чисел, попавших в каждый интервал: *ni*, *i* = 1, …, *k*. 4. Вычисляется экспериментальное значение χ2эксп. по следующей формуле:   [ Формула 08 ]  где *pi* = 1/*k* — теоретическая вероятность попадания чисел в *k*-ый интервал.   1. Путем сравнения экспериментально полученного значения χ2эксп. с теоретическим χ2теор. (из табл. 22.2) делается вывод о пригодности генератора для использования. Для этого: а) входим в табл. 22.2 (**строка = количество экспериментов – 1**); б) сравниваем вычисленное χ2эксп. с χ2теор., встречающимися в строке. При этом возможно три случая.   **Первый случай**: χ2эксп. много больше любого χ2теор. в строке — гипотеза о случайности равномерного генератора не выполняется (разброс чисел слишком велик, чтобы быть случайным).  **Второй случай**: χ2эксп. много меньше любого χ2теор. в строке — гипотеза о случайности равномерного генератора не выполняется (разброс чисел слишком мал, чтобы быть случайным).  **Третий случай**: χ2эксп. лежит между значениями χ2теор. двух рядом стоящих столбцов — гипотеза о случайности равномерного генератора выполняется с вероятностью p (то есть в p случаях из 100).  Заметим, что чем ближе получается p к значению 50%, тем лучше. Проверки на статистическую независимость 1) Проверка на частоту появления цифры в последовательности  Рассмотрим пример. Случайное число 0.2463389991 состоит из цифр 2463389991, а число 0.5467766618 состоит из цифр 5467766618. Соединяя последовательности цифр, имеем: 24633899915467766618.  Понятно, что теоретическая вероятность pi выпадения i-ой цифры (от 0 до 9) равна 0.1.  Далее следует вычислить частоту появления каждой цифры в выпавшей экспериментальной последовательности. Например, цифра 1 выпала 2 раза из 20, а цифра 6 выпала 5 раз из 20.  Далее считают оценку и принимают решение по критерию «хи-квадрат».  **2) Проверка появления серий из одинаковых цифр**  Обозначим через nL число серий одинаковых подряд цифр длины L. Проверять надо все L от 1 до m, где m — это заданное пользователем число: максимально встречающееся число одинаковых цифр в серии.  В примере «24633899915467766618» обнаружены 2 серии длиной в 2 (33 и 77), то есть n2 = 2 и 2 серии длиной в 3 (999 и 666), то есть n3 = 2.  Вероятность появления серии длиной в L равна: pL = 9 · 10–L (теоретическая). То есть вероятность появления серии длиной в один символ равна: p1 = 0.9 (теоретическая). Вероятность появления серии длиной в два символа равна: p2 = 0.09 (теоретическая). Вероятность появления серии длиной в три символа равна: p3 = 0.009 (теоретическая).  Например, вероятность появления серии длиной в один символ равна pL = 0.9, так как всего может встретиться один символ из 10, а всего символов 9 (ноль не считается). А вероятность того, что подряд встретится два одинаковых символа «XX» равна 0.1 · 0.1 · 9, то есть вероятность 0.1 того, что в первой позиции появится символ «X», умножается на вероятность 0.1 того, что во второй позиции появится такой же символ «X» и умножается на количество таких комбинаций 9.  Частость появления серий подсчитывается по ранее разобранной нами формуле «хи-квадрат» с использованием значений pL.  Примечание: генератор может быть проверен многократно, однако проверки не обладают свойством полноты и не гарантируют, что генератор выдает случайные числа. Например, генератор, выдающий последовательность 12345678912345…, при проверках будет считаться идеальным, что, очевидно, не совсем так.  В заключение отметим, что третья глава книги Дональда Э. Кнута «Искусство программирования» (том 2) полностью посвящена изучению случайных чисел. В ней изучаются различные методы генерирования случайных чисел, статистические критерии случайности, а также преобразование равномерно распределенных случайных чисел в другие типы случайных величин. Изложению этого материала уделено более двухсот страниц. |