

- 考虑如何从简单的非均匀分布中生成随机数，假设我们有一个均匀分布的随机数来源， z 在区间 $(0,1)$ 上均匀分布，

$$y = f(z)$$

$$p(y) = p(z) \left| \frac{dy}{dz} \right|$$

$$\text{此时 } p(z) = 1,$$

$$\text{令 } y = h^{-1}(z)$$

$$\text{则 } z = h(y) = \int_0^y p(y) dy.$$

- 对于正态分布可以通过对 y 的不同假设得到不同分布的 y .

