

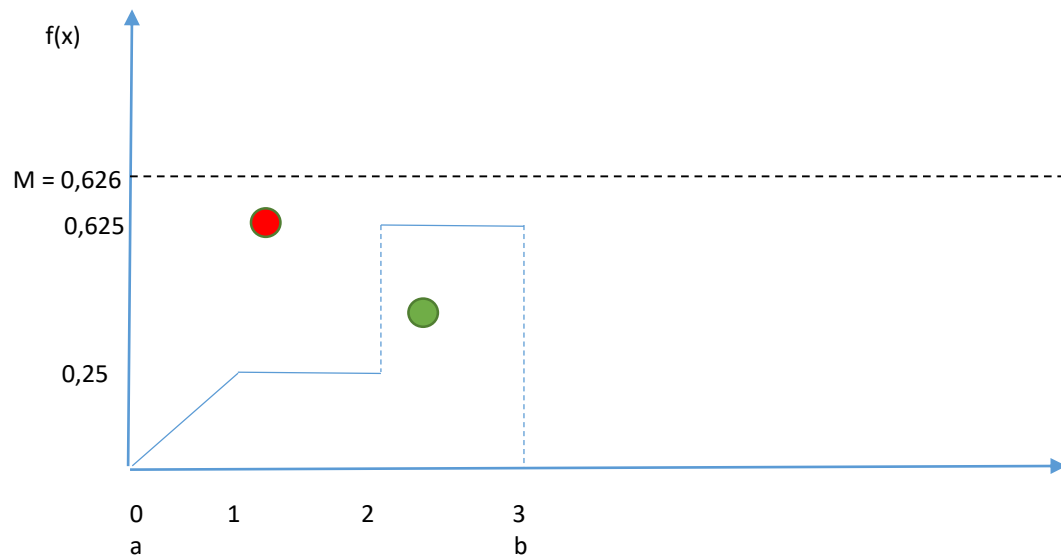
VERWERFUNGSMETHODE

BSP 15

Dickbauer, Perner, Moser

Verwerfungsmethode

- Anhand einer gegebenen Dichtefunktion soll eine ZZ generiert werden, die der Verteilungsfunktion zur Dichtefunktion genügt.
- Um diese zu generieren Bedarf es eines Algorithmus und einer Bestimmung wann eine ZZ behalten wird und wann sie verworfen wird (accept-reject)



Algorithmus

- INPUT: Numbers to be generated; GIVEN: density function and corresponding $f(x)$
1. Generierung einer ZZ1 in einem Interval $[a,b]$ der Dichtefunktion (hier 0-3)
 2. Generierung einer GV ZZ2 $[0,M]$ hier ($M=0,626$)
 3. If $ZZ2 > \text{density_function}(ZZ1)$
 reject ZZ1
 else accept
 4. Dies mach solange bis LISTEN LÄNGE = NUMBER INPUT