

Изучите зависимость от t и a трудоемкости метода моделирования случайной величины с усеченной гамма-плотностью

$$f(x) = \frac{x^{a-1}e^{-x}}{C(a)}, \quad x \geq t,$$

где $C(a)$ — некоторая нормализующая константа, $a > 1$.

Замечание: реализация метода должна быть соответствующим образом векторизована.

1. Моделирование E, E^* — экспоненциально распределенных с.в. Вычисление $X = t + \frac{E}{1 - \frac{a-1}{t}}$.
2. Если $\frac{X}{t} - 1 + \log \frac{t}{X} \leq \frac{E^*}{a-1}$, перейти к п. 1, иначе вернуть X .