

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, $0 < a < 1$.

Замечание: реализация метода должна быть соответствующим образом векторизована.

Отбор из экспоненциального распределения

1. Моделирование U — р.р. $[0, 1]$, E — экспоненциально распределенной с.в. Вычисление $X = t + E$.
2. Если $XU^{\frac{1}{1-a}} \leq a$, перейти к п. 1, иначе вернуть X .