

OBSAH

1. ÚVOD	5
2. ZÁKLADY SIMULAČNÍHO MODELOVÁNÍ	6
2.1 Pojem a podstata simulace	6
2.1.1 Metoda Monte Carlo	9
2.1.2 Příklad – výpočet určitého integrálu	9
2.2 Základní prvky simulačního modelu	12
2.2.1 Deterministické prvky	12
2.2.2 Stochastické prvky	12
2.2.3 Dynamické prvky	13
2.2.4 Elementární akce	14
2.2.5 Příznak	15
2.2.6 Filtr	15
3. GENEROVÁNÍ NÁHODNÝCH ČÍSEL A HODNOT NÁHODNÝCH VELIČIN	16
3.1 Generování náhodných čísel	16
3.1.1 Matematický generátor náhodných čísel	17
3.1.2 Testování náhodných čísel	19
3.2 Generování hodnot náhodných veličin	20
3.2.1 Spojitá rozdělení	21
3.2.2 Diskrétní rozdělení	23
3.3 Určení typu rozdělení	27
4. TVORBA SIMULAČNÍHO MODELU A HODNOCENÍ VÝSLEDKŮ	29
4.1 Metodika tvorby simulačního modelu	29
4.2 Verifikace simulačního modelu	31
4.3 Realizace simulačního projektu	31
4.4 Elementární simulační modely	33
4.4.1 Příklad	33
4.5 Vyhodnocení simulačního experimentu	36
4.5.1 Simulace s konečným horizontem	37
4.5.2 Simulace dlouhodobého chování systému	38
4.5.3 Počet simulačních experimentů	40
4.6 Příklad - Simulační model zásob se stochastickou poptávkou a znovuobjednávkou	41

