

# or-4. モンテカルロシミュレー ション

#### (オペレーションズリサーチ)

URL: https://www.kkaneko.jp/cc/or/index.html

金子邦彦





オペレーションズリサーチ



- ・ある行動を実行する前に、前もって、**データを** 使って確かめておく
- ・現実の模倣であるシミュレーションは、オペレー ションズリサーチを実施するための有効な手立て



# 4-1 乱数



- 乱数は、<u>ランダムな数値</u>のこと.
- ・乱数はシミュレーションに欠かせない.



※コンピュータゲームで,敵キャラがランダムに 登場する

= **乱数**を使って「現実感」を出す例 ※シミュレーションで,現実世界の再現のために 乱数を使うことも





#### =RAND()

#### 0以上1未満の乱数

	Α	
1	0.258162	
2	0.541572	
3	0.374084	
4	0.154463	
5	0.3569	
c		

Excel で、式「=RAND()」を コピー&貼り付け

# 乱数の範囲の調整



元の乱数は**0か ら1**の範囲とす る

2倍すると, 範 囲は**0から2**  2倍して,1引く と,範囲は**-1 から1** 

#### Excel で乱数



# =**TRUNC(** RAND() \* 10) + 1 1以上 11 未満の乱数を<mark>整数化</mark> (1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10)



#### Excel で、 式「**=TRUNC( RAND() \* 10 ) + 1**」 をコピー&貼り付け

## Excel で乱数



0以上1未満の乱数 =RAND() 0以上 10 未満の乱数 =RAND() \* 10 =TRUNC(RAND()\*10) 0以上10未満の乱数を整数化 (0, 1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9)=TRUNC( RAND() \* 10 ) + 1 1以上11未満の乱数を整数化 (1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10)

#### ※ TRUNC による**整数化**は、**小数点以下切り捨て**

まとめ



## **=RAND()** 0 以上 1 未満の乱数

# **=TRUNC( RAND() \* 10 ) + 1** 1 以上 11 未満の乱数を<mark>整数化</mark> (1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10)

#### ※ TRUNC による整数化は、小数点以下切り捨て





#### Excel を起動. 起動したら「空白のブック」を選ぶ







# {1, 2, 3, 4, 5, 6} の範囲の乱数 「=TRUNC( RAND() \* 6 ) + 1」をセル A1 に

i	SU	M +	: ×	✓ f <sub>x</sub>	=TRUN	C( RAND()	* 6 ) + 1
(	1	A	В	С	D	E	F
Þ ř	2	(0)+1					
	3						



#### ② セル A1 の式を, A2, A3, A4, A5 に「コピー&貼り付け」 右クリックメニューが便利



#### <u>ポイント</u> 乱数なので、ランダムな値



さいころを振ったときの 目の出方を再現



# 4-2 乱数を用いたシミュレーションの例





- ◆ 商品は 30円
- ◆ 硬貨は **10円玉、50円玉**だけが使える

## ある人は10円玉×3枚で買い物

ある人は50円玉×1枚で買い物(おつり20円 を受け取る)







- ◆ 商品は 30円
- ◆ 硬貨は **10円玉、50円玉**だけが使える

# ある人は**10円玉×3枚**で買い物 **自動販売機は、10円玉が3枚増える(+3)** ある人は50円玉×1枚で買い物(**おつり20円** を受け取る)

自動販売機は、10円玉が2枚減る(-2)





シミュレーションの例



- ◆ 商品は 30円
  - ▶ 硬貨は **10円玉、50円玉**だけが使える

あるときには3枚増える(+3) ある人 **自動販売機は、10円玉が3枚増える(+3)** ある人は50円玉×1枚で買い物(**おつり20円** を受け取る)







◆ イベント1

## 自動販売機は、10円玉が3枚増える(+3)



◆ イベント2

#### 自動販売機は、10円玉が2枚減る(-2)







#### =IF(RAND() < 0.7, 3, -2)

#### 確率 70% で「3」になり、 確率 30% で「-2」になる。



#### Excel で、 式「=IF(RAND() < 0.7, 3, -2)」を コピー&貼り付け

まとめ



#### Excel で IF と RAND の組み合わせ

#### =IF(RAND() < 0.7, 3, -2)

# 確率 70% で「3」になり、 確率 30% で「-2」になる。





#### Excel を起動. 起動したら「空白のブック」を選ぶ





#### ① セル A1 に値「0.7」





#### ② セル A2 に式「=IF(RAND() < A\$1, 3, -2)」</p>





#### ③ セル A2 の式を, A3 から A16 に「コピー&貼り付け」 右クリックメニューが便利

- 24			
1		Α	В
2	1	0.7	
3	2	-2	
4	3	3	
5	4	3	
6	5	3	
7	6	3	
8	7	3	
9	8	3	
10	9	3	
1	10	3	
12	11	3	
13	12	-2	
4	13	3	
15	14	3	
16	15	3	
17	16	3	
18	17		

# 確率 70% で「3」になり、 確率 30% で「-2」になる。



#### ④ セル A17 に式「=SUM(A2:A16)」



10円×3枚の人が全体の70% 50円×1枚の人が全体の30% のとき、 15人が買い物を終えると、 10円玉は何枚増えるか(減るか)の シミュレーション



#### ⑤ セル A1 の値を「0.5」に書きかえて、<mark>セル A17 の値の変</mark> <u>化</u>をみなさい

		А	
2	1	0.5	
;	2	3	
Ļ	3	-2	
i	4	3	
;	5	3	
•	6	-2	
;	7	-2	
)	8	-2	
D	9	-2	
1	10	3	
2	11	-2	
3	12	-2	
4	13	3	
5	14	3	
6	15	3	
7	16	3	
8	17	10	
n	18		

**10円×3枚**の人が全体の**50% 50円×1枚**の人が全体の**50%** のとき、 15人が買い物を終えると、 10円玉は何枚増えるか(減るか)の シミュレーション



#### ⑥ セル A1 の値を「0.3」に書きかえて、セル A17 の値の変 化をみなさい









#### **乱数**を使って、異なるイベントを**ランダム**に発生

=IF(RAND() < 0.7, 3, -2)

確率 70% で「3」になり、 確率 30% で「-2」になる。

**シミュレーション**を行った



# 4-3 シミュレーションで, 面積を推定









# 面積と面積比









## **-1 以上 2 未満**の乱数の式 「**=RAND() \* 3 - 1**」をセル A1 に





# ② セル A1 の式を, A2 から A20 と、B1 から B20 に「コピー&貼り付け」 右クリックメニューが便利

	Α	В	
1	1.886727	0.361703	
2	-0.89616	1.476738	
3	0.254013	-0.80048	
4	-0.12913	-0.36662	
5	1.155274	-0.85364	
6	-0.00331	1.182228	
7	1.361084	0.256562	
8	0.797903	1.625232	
9	-0.34948	1.000749	
10	-0.58961	1.593319	
11	-0.06947	0.745195	
12	-0.65242	0.805857	
13	-0.84107	1.608053	
14	-0.23082	-0.31832	
15	1.93006	-0.50838	
16	0.096903	0.009469	
17	0.8189	0.619243	
18	0.337119	0.203961	
19	-0.15335	1.818734	
20	0.251849	1.166029	
21			-0

#### 実行のたびに、違う値になる (乱数なので、ランダムな値)



# **セル A1 から B20 まで**のエリア を,マウスでドラッグして(**範囲選択**),**散布図**を選ぶ



マウスでドラッグ(範囲選択)





縦の長さ3,横の長さ3の<u>正方形の中</u>に, 青い<u>点は20個</u>



# ④ 放物線の式 「=0.5 \* A1 \* A1」をセル C1 に

							~ 1
SL	JM -	:	×	$\checkmark$	$f_{x}$	=0.5 *	A1 * A1
	Α	E	3	С		D	E
1	-0.48039	1.00	0283	=0.5 *	A1	* A1	
2	0.488408	1.23	2157				
3	1.098326	1.63	6929				

C1に式「=0.5 \* A1 \* A1 」



# ⑤ セル C1 の式を, C2 から C20 に「コピー&貼り付け」 右クリックメニューが便利

F2	7 -	:	$\times$	~	$f_{x}$	
	А	E	3	C	)	C
1	0.499546	-0.3	37779	0.12	4773	
2	0.094771	1.09	8137	0.00	4491	
3	-0.14156	1.48	9797	0.0	1002	
4	1.468767	-0.8	87056	1.07	8638	
5	0.023893	-0.2	4674	0.00	0285	
6	1.418366	-0.7	8966	1.00	5882	
7	1.700746	-0.1	2596	1.44	6268	
8	-0.02258	-0.	.6003	0.00	0255	
9	0.931436	-0.1	9776	0.43	3787	
10	-0.54795	0.18	32346	0.15	0127	
11	0.311951	0.25	6827	0.04	8657	
12	1.77473	0.34	1855	1.57	4833	
13	0.003042	0.00	6816	4.63	E-06	
14	-0.76366	1.93	82737	0.29	1586	
15	1.634991	1.51	2736	1.33	6597	
16	0.685177	0.46	6697	0.23	4734	
17	1.415413	0.04	1565	1.00	1696	
18	1.008191	1.48	81623	0.50	8225	
19	-0.55911	1.58	9503	0.15	6304	
20	-0.71855	-0.6	2536	0.25	8158	
01						-



#### ⑥ 今度は, **セル A1 から C20 まで**のエリア を,マウスでド ラッグして(**範囲選択),散布図**を選ぶ















#### ⑦「=(B1 > C1)」をセル D1 に

SL	JM -	:	$\times$	$\checkmark$	$f_{\mathcal{K}}$	=(B1	>	C1)	
	А	E	3	C	2	D			Е
1	-0.50974	1.87	5182	0.12	9917	=(B1 >	C1	.)	
2	0.432885	1.19	3062	0.09	3695				
3	1.316389	-0.9	8872	0.8	6644				



# ⑧ セル D1 の式を, D2 から D20 に「コピー&貼り付け」 右クリックメニューが便利

	А	В	С	D
1	1.252385	0.507992	0.784234	FALSE
2	1.185458	0.878061	0.702655	TRUE
3	-0.54415	0.497422	0.14805	TRUE
4	1.444668	0.056255	1.043532	FALSE
5	1.837659	-0.85608	1.688495	FALSE
6	1.739147	1.992973	1.512316	TRUE
7	0.950232	0.63679	0.45147	TRUE
8	0.667019	-0.48011	0.222457	FALSE
9	1.147729	0.30866	0.658641	FALSE
10	-0.42766	0.623569	0.091448	TRUE
11	0.12169	1.29624	0.007404	TRUE
12	0.815106	-0.46163	0.332199	FALSE
13	-0.23961	0.408605	0.028707	TRUE
14	-0.76323	0.074546	0.29126	FALSE
15	1.246427	-0.138	0.77679	FALSE
16	0.562154	-0.2799	0.158008	FALSE
17	0.465424	-0.67043	0.10831	FALSE
18	-0.9774	-0.8326	0.477656	FALSE
19	0.619365	0.815466	0.191807	TRUE
20	0.062715	1.871022	0.001967	TRUE



B列:青点,C列:オレンジ D列:<u>オレンジ点の方が上</u> だったら FALSE

#### 実行のたびに、違う値になる (乱数なので、ランダムな値)









## 青い点は全部で<u>20個</u> (分布はランダム)

この中に点が<u>11個</u> とすると

面積比は 1 : 0.55

正方形の面積:9 オレンジ色部分の面積: たぶん 9×**0.55**=4.95





#### =COUNTIF(D1:D20, FALSE)

#### セルの範囲 D1:D20 の中で, 値が FALSE になっているものを数える



#### ⑨「**=COUNTIF(D1:D20, FALSE)**」をセル **D21** に書いて, FALSE の数を数える

SUM	<b>•</b> :	×	$\checkmark f_x$	=COUN	TIF(D1:D2	0, FALSE)	
A		В	С	D	E	F	



# 4-4 シミュレーションで 円周率を求める





#### Excel を起動. 起動したら「空白のブック」を選ぶ





#### ① **-1 以上 1 未満**の乱数の式 「**=RAND() \* 2 - 1**」をセル A1 に





# ② セル A1 の式を, A2 から A100 と、B1 から B100 に「コピー&貼り付け」 右クリックメニューが便利

	Α	B		A	в		A	
1	0.997/81	0.673662	34	0.9202	-0.75397	67	-0.4123	
2	0 47988	-0.85556	35	-0.1315	0.180341	68	-0.5622	
2	0.47300	0.530266	36	-0.209	0.61245	69	0.38781	
4	0.43103	0.330200	37	-0.2287	-0.23073	70	0.39091	
4	-0.3240	0.495292	38	-0.4298	0.669809	71	0.30541	
0	-0.7602	0.546105	39	0.69534	0.237229	72	0.86894	
0 7	-0.8933	0.017799	40	0.52934	0.901252	73	0.95575	
/ ^	-0.3845	-0.48221	41	0.31009	-0.2172	74	-0.8418	
5	0.59986	-0.07926	42	-0.8217	0.505928	75	0.89096	
	0.74466	-0.97094	43	-0.7677	0.231401	76	0.76699	
U	0.70638	-0.86975	44	0.46232	-0.79775	77	-0.8968	
1	0.77766	-0.5897	45	0.3433	0.883392	78	-0.735	
2	0.27357	0.902645	46	0 25504	0.878006	79	-0.8177	
3	-0.836	-0.33386	47	0 32223	0 24259	80	-0.9026	
4	-0.189	-0.23659	18	0.21051	-0.45464	81	0.33466	
5	-0.0141	0.687842	40	-0.5253	0.508201	82	-0.0762	
6	0.63455	0.028027	4J 50	-0.5255	0.508291	83	-0.4598	
7	0.18998	-0.87649	50	-0.0725	0.245622	84	0.89201	
3	0.09969	-0.46288	51	-0.8225	0.345032	85	0.37084	
)	-0.267	-0.11643	52	0.1250	-0.01007	86	0.30176	
)	0.6837	0.131939	53	-0.1259	0.25859	87	0 24959	
1	-0.7267	-0.34867	54	-0.7783	0.913507	88	-0.8998	
2	0.61525	0.393156	55	-0.1234	0.090802	89	0.87218	
3	0.21464	-0.07963	50	0.04000	-0.20154	90	-0 4264	
4	0.12393	-0.83618	57	0.23109	0.8438/3	91	-0.9079	
5	-0.6674	-0.60254	58	-0.5351	0.739647	91	-0.3073	
6	-0.8549	-0.04112	59	-0.5012	0.028964	92	-0.3808	
7	-0.9124	-0.58381	60	-0.6891	0.731487	93	-0.3696	
8	0.66503	-0.56371	61	0.25921	-0.26316	94	-0.0911	
9	-0.0103	0.113609	62	-0.1731	-0.1646	95	-0.3247	
0	0.74758	-0.01615	63	-0.0041	-0.23819	96	-0.3487	
1	-0.3342	0.129065	64	-0.8791	-0.5837	97	-0.0363	
32	0.14946	0.475261	65	-0.8162	-0.95471	98	-0.39	
33	0.88572	-0.33392	66	-0.8948	-0.23167	99	-0.9899	
24	0.0202	0.75207	67	-0.4123	-0.85534	100	-0.9211	

#### 実行のたびに、違う値になる (乱数なので、ランダムな値)



#### ③ **セル A1 から B100 まで**のエリア を,マウスで ドラッグして(**範囲選択**),散布図を選ぶ



マウスでドラッグ(範囲選択)







#### ④ 中心 (0, 0) で半径 1 の円の式 「**=(A1 \* A1 + B1 \* B1 ) < 1**」をセル **C1** に



#### <u>点が「半径1の円の中にあるか」を調べている</u> <u>100個の点全てを調べ,</u> <u>円の中の点の数が60なら,円の面積は60\*4/100</u>



縦の長さ2,横の長さ2の<u>正方形</u>



# ⑤ セル C1 の式を, C2 から C100 に「コピー&貼り付け」 右クリックメニューが便利

	Α	В	С
1	-0.18852	-0.94632	TRUE
2	0.81153	0.575006	TRUE
3	0.82409	-0.95954	FALSE
4	-0.616	0.94346	FALSE
5	0.95012	-0.94337	FALSE
6	-0.0291	0.819365	TRUE
7	-0.5121	0.090481	TRUE
8	0.22279	0.903306	TRUE
9	0.6657	0.431078	TRUE
10	0.21965	0.76199	TRUE
11	-0.8337	-0.75165	FALSE
12	0.56483	-0.86502	FALSE
13	0.69613	-0.63478	TRUE
14	0.18813	-0.63003	TRUE
15	0.85656	0.680139	FALSE
16	-0.8115	0.806409	FALSE
17	0.4053	0.276278	TRUE
18	0.83722	0.060781	TRUE
19	-0.5675	-0.59988	TRUE
20	-0.8188	0.164358	TRUE
21	-0.5033	-0.54786	TRUE







# =COUNTIF(C1:C100, TRUE)

## セルの範囲 C1:C100 の中で, 値が TRUE になっているものを<u>数える</u>



## ⑥ セル C101 に 「=COUNTIF(C1:C100, TRUE)」を書いて, <u>TRUE の数</u>を数える

SUM			-		×	$\checkmark$	fx	=C	=COUNTIF(C1:C100, TRUE)				
	A	В	С		D	E	F	G	Н	I	J	K	L
94	-0.44997	0.678004	TRUE										
95	-0.75428	-0.03567	TRUE										
96	0.302366	-0.78958	TRUE										
97	0.298396	-0.41443	TRUE										
98	0.609758	-0.31601	TRUE										
99	-0.24066	0.569179	TRUE										
100	-0.43547	-0.29085	TRUE										
101				77									



#### ⑦ セル C102

「**=C101 \* 4 / 100**」をセル C102 に書いて,

結果を確認する

→ 円周率に近い近い値が求まる

#### ※ 円の面積 = 円周率 × (半径)<sup>2</sup>

101		80	
102		3.2	





# 今までは,点の数を100個にしていたが,200個に増やして,円周率を求めてみる