

시뮬레이션 출력분석의 신 기법과 최근 연구 동향

김 윤 배*

* 성균관대학교 시스템경영공학과

Abstract

단독 실행을 통한 시뮬레이션 출력 분석은 정상상태(steady-state) 진입시점의 결정과 출력 내에 존재하는 자기상관(autocorrelation)으로 인하여 어려움이 있다. 이런 문제를 극복하기 위한 기존의 통계적인 출력분석 기법들 및 새로운 기법들을 소개하고, 최근 연구동향을 재 샘플링 기법을 위주로 소개한다. 본 발표에서 다룰 기존의 기법들로는, 반복/소거법(replication/deletion method), 재생적방법(regenerative method), 배치평균 방법(batch means method), 표준시계열 방법(standardized time series) 및 재 샘플링 기법(binary bootstrap, threshold bootstrap, moving block bootstrap, stationary bootstrap) 등이다.