

**DOKTORANTŪROS STUDIJŲ DALYKO SANDAS**

Dalyko pavadinimas	Mokslų kryptis (šaka) kodas	Institutas	Skyrius
<b>Statistinis modeliavimas</b>	Informatika 09 P	Matematikos ir informatikos	Sistemų analizės
Studijų būdas	Kreditų skaičius	Studijų būdas	Kreditų skaičius
paskaitos	1	konsultacijos	2
individualus	1	seminarai	3
Dalyko anotacija			
Sandas nagrinėja stochastinio bei statistinio modeliavimo paradigmas, atsitiktinių procesų imitavimą kompiuterių, daugiamačių integralų vertinimo, aptarnavimo sistemų ir tinklų modeliavimo, stochastinį programavimo, imčių dispersijos sumažinimo metodus.			
Pagrindinė literatūra			
Paul Glasserman (2003). <i>Monte Carlo methods in financial engineering</i> . Springer-Verlag.			
Daniel J. Duffy and Joerg Kienitz (2009). <i>Monte Carlo Frameworks: Building Customisable High-performance C++ Applications</i> . Wiley			
Rubinstein, R. Y.; Kroese, D. P. (2007). <i>Simulation and the Monte Carlo Method</i>			
Robert, C. P.; Casella, G. (2004). <i>Monte Carlo Statistical Methods</i>			
Konsultuojančiųjų dėstytojų vardas, pavardė	mokslų laipsnis	pedag. vardas	Svarbiausieji darbai mokslų kryptyje (šakoje) paskelbti per pastaruosius 5 metus
Leonidas Sakalauskas Saulius Minkevičius	Habil. Dr. Dr.	Prof.	1. Bartkute V., Sakalauskas L. (2007). Simultaneous Perturbation Stochastic Approximation for Nonsmooth Functions. <i>European Journal of Operational Research</i> . ISSN : 0377-2217, Elsevier Science, vol. 181, No 3, pp. 1174–1188. 2. Bartkute V, Sakalauskas L. (2009) Statistical Inferences for Termination of Markov Type Random Search Algorithms. <i>Journal of Optimization Theory and Applications</i> , vol. 141, No 3, pp. 475–493. 3. Minkevičius S. (2009) On extreme values in open queueing networks. <i>Mathematical and Computer Modelling</i> , vol. 50, No 7–8, pp. 1058–1066 4. Minkevičius S. (2010) On the global values of the queue length in open queueing networks. <i>International Journal of Computing Mathematics</i> , vol. 87, No 6, pp: 1315–1325 5. Minkevičius S., Sakalauskas L. (2010) Nonlinear Phenomena in Digital Networks. <i>Information Technology and Control, Kaunas, Technologija</i> , 2010, Vol. 39, No. 3, 187–194.
Patvirtinta Matematikos ir informatikos instituto taryboje 2011 m. spalio 19 d., protokolo Nr. 5			
Tarybos pirmininkas		Kęstutis Kubilius	