

DOKTORANTŪROS STUDIJŲ DALYKO SANDAS

Dalyko pavadinimas	Mokslo kryptis (šaka) kodas	Institutas	Skyrius
Stochastinis programavimas	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 programavimo uždavinių formuluotes įvairiose srityse, stochastinį diferencijavimą, dviejų ir daugelio etapų stochastinį tiesinį ir netiesinį programavimą, Monte-Karlo metodo taikymą stochastiniam programavimui.			
Pagrindinė literatūra			
1. Birge J.R. and Louveaux F.V. (1997) <i>Introduction to Stochastic Programming</i> . Springer Verlag, New York, 1997			
2. Spall, J. C., <i>Introduction to Stochastic Search and Optimization: Estimation, Simulation, and Control</i> , Wiley, Hoboken, New York, 2003.			
Rubinstein, R. Y.; Kroese, D. P. (2007). <i>Simulation and the Monte Carlo Method</i>			
4. Shapiro, Alexander; Dentcheva, Darinka; Ruszczyński, Andrzej (2009). <i>Lectures on stochastic programming: Modeling and theory</i> . MPS/SIAM Series on Optimization			
Konsultuojančiųjų dėstytojų vardas, pavardė	mokslo laipsnis	pedag. vardas	Svarbiausieji darbai mokslo kryptyje (šakoje) paskelbti per pastaruosius 5 metus
Leonidas Sakalauskas	Habil. 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. (Thomson ISI Web of Science). 2. Bakšys D., Sakalauskas L. (2007) Study of the Simulation and Optimization System of Interbank Settlements. <i>Information Technology And Control</i> , vol. 36, No. 4, 388–392. ISSN 1392-124X. (Thomson ISI Web of Science) 3. 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. (Thomson ISI Web of Science) 4. Kabasinskas A., Rachev S.T., Sakalauskas L, et al. (2009). Alpha-stable paradigm in financial markets, <i>Journal of Computational Analysis and Applications</i> , vol. 11, no 4, pp. 641–668. (Thomson ISI Web of Science) 5. L.Sakalauskas (2010) On the Empirical Bayesian Approach for the Poisson-Gaussian model. <i>Methodology and Computing in Applied Probability</i> , vol. 12, No 2, pp. 247–259. (Thomson ISI Web of Science)
Patvirtinta Matematikos ir informatikos instituto taryboje 2011 m. spalio 19 d., protokolo Nr. 5			
Tarybos pirmininkas		Kęstutis Kubilius	