

Программа курса:  
*Статистическое моделирование*

Д. В. Гринёв

Математический факультет, кафедра нелинейной динамики

ЯрГУ им. П.Г.Демидова  
Ярославль, сентябрь 2021 г.

# Программа курса:

- Статистическое моделирование случайных величин
  - Введение в численные методы Монте-Карло
  - Статистическое моделирование независимых равномерно распределённых случайных величин
  - Методы моделирования одномерных случайных величин
  - Моделирование многомерных случайных величин
- Применение методов Монте-Карло
  - Общая схема метода Монте-Карло
  - Вычисление определенных интегралов
  - Расчет системы массового обслуживания
  - Моделирование времени ожидания

# Список основной литературы

- Методы Монте-Карло
  - И. М. Соболев, "Численные методы Монте-Карло"
  - С. М. Ермаков, Г.А.Михайлов, "Статистическое моделирование"
  - А. М. Половко, "Mathematica для студента"