

Stochastické simulačné metódy (2-PMS-123)

rôzne informácie k predmetu

Radoslav Harman, KAMŠ, FMFI UK

3. októbra 2019

1 Osnova

Fyzikálne a algoritmické generátory náhodnosti, Generovanie realizácií z rovnomerného rozdelenia, Testovanie generátorov náhodných čísel, Generovanie realizácií diskretných náhodných premenných a vektorov, Generovanie realizácií spojitých náhodných premenných a vektorov, Princíp klasických metód Monte-Carlo, Simulačný výpočet pravdepodobností a objemov, Simulačný výpočet stredných hodnôt a integrálov, Úvod do metód Markov chain Monte Carlo (Metropolis-Hastings, Gibbs sampler).

2 Literatúra

- Elektronické materiály od vyučujúceho
- Ross S: Simulation. Academic Press 2006

3 Hodnotenie

Hodnotenie predmetu sa bude zakladať na vypracovanom projekte a odpovedi na jednu otázku z preberanej látky. (Prezentovať projekt aj odpovedať na otázku budete na skúške počas skúškového obdobia.) Prémiové body môže získať študent, ktorý (ako prvý) nájde chybu v poznámkach k prednáške uverejnených na našej www stránke, prípadne chyby na www stránke samotnej.