

**Направление подготовки: Прикладная математика и информатика,
бакалавриат, очное обучение**

Дисциплина: Метод Монте-Карло

Аннотация

Трудоемкость: 2 ECTS, 72 академических часа.

Форма итогового контроля: зачет.

Метод Монте Карло является мощнейшим инструментом для симулирования сложных, многомерных явлений в различных областях, таких как : физика, прикладная математика, биофизика, экономика, теория управления, теория игр и многих других. Исторически, метод был впервые применен для расчета многомерных интегралов высокой кратности. Другим важнейшим направлением применения метода является прямое вероятностное моделирование случайных процессов. В основе реализации метода лежат генераторы случайных чисел, распределенных с различными вероятностями.