

51  
М54

МИНИСТЕРСТВО КУЛЬТУРЫ  
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ГОСУДАРСТВЕННОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ  
САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ  
УНИВЕРСИТЕТ КИНО И ТЕЛЕВИДЕНИЯ

806<sup>2</sup> Кафедра математики и информатики

# МЕТОД МОНТЕ-КАРЛО

Методические указания к выполнению лабораторной работы  
по математике на персональных ЭВМ  
для студентов дневного и заочного отделений ФАВТ и ФПСКТ

САНКТ-ПЕТЕРБУРГ  
2003

Составитель: канд. физ.-мат. наук, доцент В.Г. Галкина

Рецензент: канд. физ.-мат. наук А.С. Мальков

Рекомендовано к изданию в качестве методических указаний кафедрой математики и информатики.  
Протокол № 1 от 30.08.02.

**ВОЗВРАТИТЕ КНИГУ НЕ ПОЗЖЕ**  
обозначенного здесь срока


кино и телевидения,

## ВВЕДЕНИЕ

Метод Монте-Карло – это численный метод решения математических задач при помощи моделирования случайных величин. Этот метод можно определить как метод статистических испытаний или метод моделирования случайных величин с целью вычисления характеристик их распределений. Обычно предполагается, что моделирование осуществляется с помощью ЭВМ, хотя в некоторых случаях можно добиться успеха, используя приспособления типа рулетки, карандаш и бумагу [8].

В подавляющем большинстве задач, решаемых методом Монте-Карло, вычисляют математическое ожидание некоторой случайной величины. Так как математическое ожидание непрерывной случайной величины выражается через обычный интеграл, то центральное положение метода Монте-Карло занимают методы вычисления интегралов.

## ИСТОРИЧЕСКАЯ СПРАВКА

Название «Монте-Карло» произошло от города Монте-Карло в княжестве Монако, известного своими казино, ибо одним из простейших приборов для генерирования случайных чисел служит рулетка [12].

Идея моделирования случайных явлений очень стара и, по мнению некоторых авторов, например Дж. Н. Холтона [13], восходит ко временам Древнего Вавилона и Ветхого Завета. Что же касается использования таких методов для приближенных вычислений, то первой работой в этой области принято считать работу А. Холла [14] о вычислении числа  $\pi$  с помощью случайных бросаний иглы на разграфленную параллельными линиями бумагу [8]. Это так называемая задача Бюффона.

Пусть на плоскости изображена последовательность равноотстоящих параллельных прямых, и на плоскость сверху бросается игла. Какова вероятность пересечения иглой одной из прямых? Оказывается, что эта вероятность равна

$$p = \frac{1}{\pi}.$$

Можно ли отсюда определить значение числа  $\pi$ ? Для этого нужно фактически осуществить бросание иглы на плоскости, отмеченными на ней параллельными прямыми.

**БИБЛИОТЕКА  
УНИВЕРСИТЕТА  
КИНО И ТЕЛЕВИДЕНИЯ  
УЧЕБНЫЙ ФОНД**

Тогда

$$\frac{M}{N} \approx \frac{1}{\pi}, \quad (1)$$

где  $N$  – количество всех бросаний иглы,  $M$  – количество бросаний, при которых игла пересекла одну из прямых. Из соотношения (1) и определяется приближенное значение числа  $\pi$ . Это было проведено экспериментально. Получившиеся результаты дали хорошее совпадение с известным значением числа  $\pi$  [3].

Можно назвать также ряд более поздних работ, в которых до появления ЭВМ использовались по существу идеи метода Монте-Карло. Довольно подробно об этом сказано в книге Дж. Хамерелли и Д. Хэндскома [15]. Идеи эти не получили заметного развития вплоть до 1944 г., когда в связи с работами по созданию атомной бомбы Дж. фон Нейман предложил широко использовать аппарат теории вероятностей для решения прикладных задач с помощью ЭВМ. Первая работа, где этот вопрос систематически излагается, принадлежит Н. Метрополису и С. Уламу [16], опубликована в 1949 г. Этот год и считается официальной датой рождения метода Монте-Карло.

Первоначально метод Монте-Карло использовался главным образом для решения задач ядерной физики, где традиционные численные методы оказались малопригодными. Далее его влияние распространилось на широкий круг задач статистической физики, очень разных по своему содержанию. К разделам науки, где все в большей мере используется метод Монте-Карло, следует отнести теорию массового обслуживания, теорию игр и математическую экономику и ряд других [8].

Термин «метод Монте-Карло» равнозначен термину «метод статистических испытаний», также принятому в отечественной литературе. В зарубежных изданиях обычно говорят о *методах* Монте-Карло.

## КРАТКИЕ ТЕОРЕТИЧЕСКИЕ СВЕДЕНИЯ

Рассмотрим способ приближенного вычисления определенного интеграла по методу Монте-Карло.

Пусть требуется вычислить определенный интеграл

$$\int_0^1 \varphi(t) dt.$$

Рассмотрим равномерно распределенную случайную величину  $t$ , плотность распределения вероятностей которой имеет вид

$$p(t) = \begin{cases} 0, & \text{если } t < 0, \\ 1, & \text{если } 0 \leq t \leq 1, \\ 0, & \text{если } t > 1. \end{cases}$$

Тогда математическое ожидание функции случайного аргумента  $\varphi(t)$  вычисляется по формуле [5, 10]

$$M(\varphi(t)) = \int_{-\infty}^{\infty} \varphi(t) p(t) dt.$$

С учетом значений функции  $p(t)$  имеем

$$M(\varphi(t)) = \int_0^1 \varphi(t) dt. \quad (2)$$

Вычислим приближенное значение математического ожидания  $M(\varphi(t))$ . Пусть в результате  $N$  испытаний получено  $N$  значений случайной величины  $t$ :

$$t_i, \quad i = 1, 2, \dots, N.$$

Эти значения можно взять из таблицы случайных чисел или получить с помощью генератора случайных чисел на ЭВМ. Тогда по теореме Чебышева

$$M(\varphi(t)) \approx \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N \varphi(t_i). \quad (3)$$

Сравнивая (2) и (3), получаем формулу для приближенного вычисления определенного интеграла:

$$\int_0^1 \varphi(t) dt \approx \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N \varphi(t_i). \quad (4)$$

Вычисление определенного интеграла с произвольными пределами интегрирования  $\int_a^b f(x) dx$  сводится к предыдущей задаче с помощью замены переменной  $x = a + (b - a)t$

$$\int_a^b f(x) dx = (b-a) \int_0^1 \varphi(t) dt,$$

где  $\varphi(t) = f(a + (b-a)t)$ .

С учетом (4) получим

$$\int_a^b f(x) dx \approx \frac{b-a}{N} \sum_{i=1}^N \varphi(t_i)$$

или

$$\int_a^b f(x) dx \approx \frac{b-a}{N} \sum_{i=1}^N f(x_i), \quad (5)$$

где  $x_i = a + (b-a)t_i$ ,  $i = 1, 2, \dots, N$ , или значения  $x_i$  можно получить на ЭВМ с помощью генератора равномерно распределенных на отрезке  $[a, b]$  чисел.

Другой способ приближенного вычисления определенного интеграла методом Монте-Карло основан на определении геометрической вероятности [5, 6, 10].

Пусть требуется вычислить площадь фигуры, ограниченной линиями  $y = f(x)$ ,  $y = 0$ ,  $x = 0$ ,  $x = a$ , где  $f(x)$  на отрезке  $[0, a]$  принимает неотрицательные значения.

То есть требуется вычислить площадь  $S$  криволинейной трапеции (рис. 1), которая численно равна значению определенного интеграла

$$\int_0^a f(x) dx. \quad (6)$$

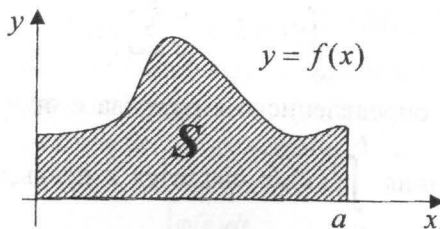


Рис. 1

Отметим, что интеграл с произвольными пределами интегрирования  $\int_c^d f_1(z) dz$  сводится к интегралу (6) с помощью замены переменной  $z = x + c$ .

Фигура площади  $S$  может быть вписана в прямоугольник со сторонами  $a$  и  $b$  (рис. 2), где  $b \geq \max_{x \in [0, a]} f(x)$ .

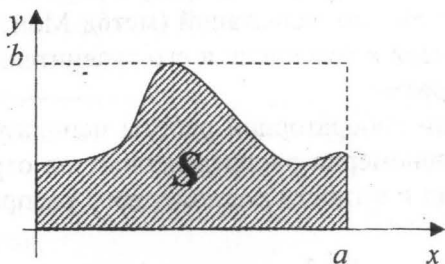


Рис. 2

Пусть в прямоугольник со сторонами  $a$  и  $b$  попадают  $N$  случайных точек, координаты которых независимо и равномерно распределены:  $x_i$  – на отрезке  $[0, a]$ ,  $y_i$  – на отрезке  $[0, b]$ ,  $i=1, 2, \dots, N$ . Тогда вероятность того, что случайная точка попадет на фигуру  $S$ , равна отношению площадей фигуры  $S$  и прямоугольника со сторонами  $a$  и  $b$ , то есть

$$p = \frac{S}{ab}.$$

С другой стороны, эта же вероятность приближенно равна

$$p \approx \frac{M}{N},$$

где  $M$  – число случайных точек, попавших на фигуру  $S$ ,  $N$  – число случайных точек, попавших в прямоугольник, площадь которого равна  $ab$ .

Таким образом, получаем

$$\frac{S}{ab} \approx \frac{M}{N} \quad \text{или} \quad S \approx \frac{M}{N} ab \quad (7)$$

или

$$\int_0^a f(x) dx \approx \frac{M}{N} ab. \quad (7')$$

Отметим [2, 4, 8], что точность (погрешность) при вычислении по методу Монте-Карло оценивается величиной

$$\varepsilon = k \frac{1}{\sqrt{N}},$$

где  $k$  – некоторая постоянная,  $N$  – число испытаний. Очевидно, что величина  $\varepsilon$  стремится к нулю с ростом  $N$ , но достаточно медленно. Увеличение точности расчетов, например в 10 раз, приводит к стократному увеличению времени решения задачи. Но при решении многих практических задач, где не требуется очень большая точность, метод статистических испытаний (метод Монте-Карло) широко применим, благодаря в том числе и его сравнительной простоте и естественности алгоритма.

При выполнении лабораторной работы используется генератор случайных чисел, равномерно распределенных на отрезке  $[0, x]$ . Напомним, что функция плотности равномерного распределения имеет вид [5, 10]

$$p(x) = \begin{cases} \frac{1}{d-c}, & \text{если } x \in [c, d], \\ 0, & \text{если } x \notin [c, d], \end{cases}$$

график которой изображен на рис. 3.

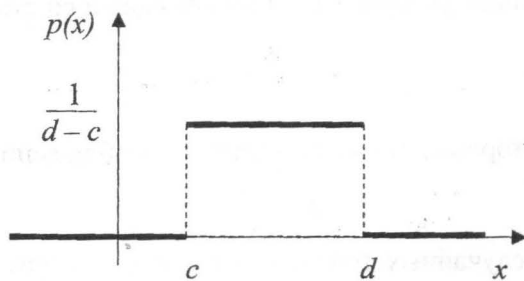


Рис. 3

Математическое ожидание  $M(X)$  и дисперсия  $D(X)$  равномерного распределения вычисляются по формулам [5, 10]

$$M(X) = \frac{c+d}{2}, \quad D(X) = \frac{(c-d)^2}{12}.$$

В частности, если случайная величина равномерно распределена на отрезке  $[0, a]$  (рис. 4), то она имеет плотность распределения



$$p(x) = \begin{cases} \frac{1}{a}, & \text{если } x \in [0, a], \\ 0, & \text{если } x \notin [0, a]. \end{cases}$$

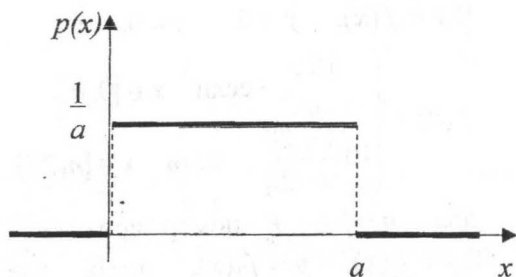


Рис. 4

Ее математическое ожидание  $M(X)$  и дисперсия  $D(X)$  вычисляются по формулам

$$M(X) = \frac{a}{2}, \quad D(X) = \frac{a^2}{12}. \quad (8)$$

Предполагается, что лабораторная работа будет выполняться на компьютере в системе MathCAD [7].

# ЗАДАНИЯ ДЛЯ ЛАБОРАТОРНОЙ РАБОТЫ

## ЗАДАНИЕ 1

Используя метод Монте-Карло, вычислить площадь треугольника, ограниченного линиями

$$1) y = f(x), \quad y = 0, \quad x = 0, \quad \text{где}$$

$$f(x) = \begin{cases} \frac{10x}{n}, & \text{если } x \in [0, n), \\ 10 \frac{x-20}{n-20}, & \text{если } x \in [n, 20) \end{cases}$$

для  $n \leq 10$ ,  $n$  – номер варианта

$$2) y = f_1(x), \quad y = f_2(x), \quad x = 0, \quad \text{где}$$

$$f_1(x) = \frac{10x}{n},$$

$$f_2(x) = 10 \frac{x-20}{n-20} + 20,$$

для  $n \geq 11$ ,  $n$  – номер варианта

**Указание:** При выполнении задания 1 следует выполнить следующие действия.

1. Построить график функции

$$y = f(x) \quad \text{для } n \leq 10$$

$$(y = f_1(x), y = f_2(x), \quad \text{для } n \geq 11).$$

Определить размеры  $a$ ,  $b$  прямоугольника, в котором целиком лежит фигура, площадь которой нужно вычислить.

2. Выбрать количество случайных точек  $N$ , например  $N=100$ .

3. С помощью встроенной функции  $rnd(x)$  (генератора случайных чисел, равномерно распределенных на отрезке  $[0, x]$ ) получить  $N$  равномерно распределенных в прямоугольнике  $a \times b$  случайных точек с координатами  $(x_i, y_i)$ ,  $i=1, 2, \dots, N$ .

Установив курсор на команде  $x_i := rnd(a)$ , с помощью нажатия на клавишу F9 выбрать такую часть последовательности случайных чисел, для которой среднее значение (математическое ожидание) и дисперсия мало отличаются от соответствующих для равномерного распределения теоретических значений, вычисляемых по формулам (8). Для вычисления математического ожидания используется встроенная функция  $mean(x)$ , дисперсии –  $var(x)$ .

Аналогичные операции проделать для  $y_i := rnd(b)$ .

4. Вычислить количество  $M$  случайных точек, лежащих внутри фигуры  $S$ . Для этого нужно проверить выполнение условия  $y_i < f(x_i)$

(для вариантов  $n \leq 10$ ) или  $f_1(x_i) < y_i < f_2(x_i)$  (для вариантов  $n \geq 11$ ). Если это условие выполняется, то точка попадает на фигуру  $S$ .

5. Вычислить приближенно площадь фигуры  $S$  по формуле (7)

$$S \approx \frac{M}{N} a \cdot b$$

или по формуле (5)

$$S \approx \frac{a}{N} \sum_{i=1}^N f(x_i).$$

6. Оценить абсолютную и относительную погрешности по методу Монте-Карло.

7. Увеличить количество точек  $N$  и повторить выполнение пп. 3-6.

## ЗАДАНИЕ 2

Вычислить приближенно определенный интеграл по методу Монте-Карло

$$1) \int_0^5 \sqrt{11 - u \sin^2 x} dx, \quad \text{для } n \leq 10,$$

$$2) \int_0^7 \sqrt{29 - u \cos^2 x} dx, \quad \text{для } n \geq 11.$$

$n$  – номер варианта

Указание. Выполнить пп. 1-7 из указания для задания 1.

## ЗАДАНИЕ 3

Вычислить приближенное значение числа  $\pi$ , исходя из вычисления площади круга радиуса  $R=n$ , где  $n$  – номер варианта.

Указание. Так как площадь круга радиуса  $R$ , лежащего целиком в квадрате со стороной  $2R$  и площадью  $S=4R^2$ , равна

$$S_R = \pi R^2, \quad \text{то } S_R \approx \frac{M}{N} S$$

$$\text{или } \pi R^2 \approx \frac{M}{N} 4R^2 \quad \text{или } \pi \approx 4 \frac{M}{N},$$

где  $N$  – общее число случайных точек квадрата  $[-R, R] \times [-R, R]$ ,  
 $M$  – число случайных точек, попавших в круг радиуса  $R$ .

При выполнении задания 3 следует выполнить следующие действия.

1. Выбрать количество случайных точек, например  $N=100$ .

2. С помощью генератора случайных, равномерно распределенных на отрезке  $[0, x]$  чисел  $rnd(x)$  получить  $N$  равномерно распределенных случайных точек на отрезке длиной  $2R$  ( $x_i := rnd(2R)$ ,  $i=1, 2, \dots, N$ ), оценить среднее значение и дисперсию выбранной части последовательности  $x_i$  (см. п. 3 задания 1). В качестве значений случайных ординат  $y_i$  выбрать следующие  $N$  значений последовательности случайных чисел ( $j:=1 \dots N$ ;  $y_j := x_{j+N}$ ).

3. Вычислить количество  $M$  случайных точек с координатами  $(x_i, y_i)$ , лежащих внутри круга  $S_R$ , для чего нужно проверить выполнение условия

$$(x_i + R)^2 + (y_i - R)^2 < R^2.$$

Если это условие выполняется, то точка попадает в круг  $S_R$ .

4. Построить окружность радиуса  $R$ , вписанную в квадрат  $[-R, R] \times [-R, R]$ , нанести на этот квадрат выбранные случайные точки с координатами  $(x_i, y_i)$ . Использовать параметрическое задание окружности

$$\begin{aligned} x &= R + R \cos \varphi, \\ y &= R + R \sin \varphi, \quad \varphi \in [0, 2\pi]. \end{aligned}$$

#### ЗАДАНИЕ 4

Вычислить приближенно по методу Монте-Карло площадь фигуры, ограниченной замкнутой линией, заданной в полярных координатах.

$$\rho^2 = A \cos^2 \varphi + B \sin^2 \varphi, \quad \text{где}$$

$$1) A = 11 + n, \quad B = 11 - n, \quad \text{для } n \leq 10$$

$$2) A = n = 10, \quad B = n - 10, \quad \text{для } n \geq 11$$

$n$  – номер варианта.

*Указание.*

1. Построить график кривой, заданной в полярных координатах, используя формулы перехода от полярных координат к декартовым

$$x = \rho(\varphi) \cos \varphi, \quad y = \rho(\varphi) \sin \varphi, \quad \varphi \in [0, 2\pi].$$

Определить размеры  $[-a, a] \times [-b, b]$  прямоугольника, в котором лежит фигура  $S$ , ограниченная заданной замкнутой линией.

2. Выполнить пункты 2, 3 из задания 1.

3. Вычислить количество  $M$  случайных точек, лежащих внутри фигуры  $S$ . Для этого нужно проверить выполнение условия

$$r_i < \rho(\varphi_i),$$

где  $(r_i, \varphi_i)$  - полярные координаты случайной точки  $(x_i, y_i)$ ;

$$r_i = \sqrt{x_i^2 + y_i^2}; \quad \varphi_i = \begin{cases} \arctg \frac{y_i}{x_i}, & \text{если } x_i > 0 \\ \pi + \arctg \frac{y_i}{x_i}, & \text{если } x_i < 0 \\ \frac{\pi}{2}, & \text{если } x_i = 0 \text{ и } y_i > 0 \\ -\frac{\pi}{2}, & \text{если } x_i = 0 \text{ и } y_i < 0 \\ 0, & \text{если } x_i = 0 \text{ и } y_i = 0 \end{cases}$$

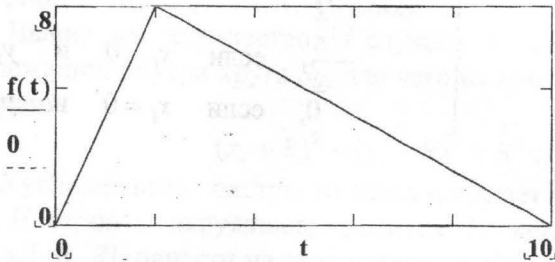
# ПРИМЕР ВЫПОЛНЕНИЯ ЛАБОРАТОРНОЙ РАБОТЫ

## ЗАДАНИЕ 1

Используя метод Монте-Карло, вычислить площадь треугольника, ограниченного линиями  $y = 4x$ ,  $y = 10 - x$ ,  $y = 0$ .

## РЕШЕНИЕ

$$f(x) := \text{if}(x < 2, 4 \cdot x, 10 - x) \quad t := 0, 0.5..10$$



$$b := 8 \quad a := 10 \quad N := 200 \quad i := 1..N$$

$$x_i := \text{rnd}(a) \quad y_i := \text{rnd}(b)$$

$$m_i := \text{if}(y_i < f(x_i), 1, 0)$$

$$M := \sum_i m_i \quad M = 110$$

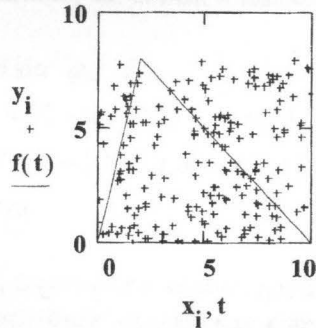
$$S := \frac{M}{N} \cdot a \cdot b$$

$$S = 44$$

Проверка

$$s := \int_0^a f(t) dt$$

$$s = 40.001$$



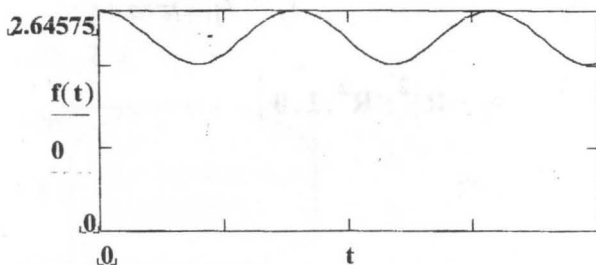
## ЗАДАНИЕ 2

Вычислить приближенно определенный интеграл по методу Монте-Карло

$$\int_0^8 \sqrt{7 - 3 \sin^2 x} dx.$$

### РЕШЕНИЕ

$$f(x) := \sqrt{7 - 3 \cdot \sin(x)^2} \quad t := 0, 0.125 .. 8$$



$$b := 3 \quad a := 8 \quad N := 200 \quad i := 1..N$$

$$x_i := \text{rnd}(a) \quad y_i := \text{rnd}(b)$$

$$m_i := \text{if}(y_i < f(x_i), 1, 0)$$

$$M := \sum_i m_i \quad M = 159$$

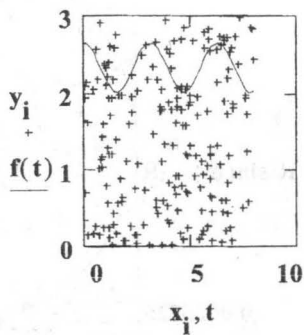
$$S := \frac{M}{N} \cdot a \cdot b$$

$$S = 19.08$$

Проверка

$$s := \int_0^a f(t) dt$$

$$s = 18.625$$



### ЗАДАНИЕ 3

Вычислить приближенное значение числа  $\pi$ , исходя из вычисления площади круга радиуса  $R=33$ .

#### РЕШЕНИЕ

$$R := 33 \quad N := 200 \quad i := 1..2 \cdot N$$

$$z_i := \text{rnd}(R \cdot 2) \quad \text{mean}(z) = 31.482 \quad \text{var}(z) = 363.79$$

$$4 \cdot R \cdot \frac{R}{12} = 363$$

$$j := 1..N \quad x_j := z_j \quad y_j := z_j + N$$

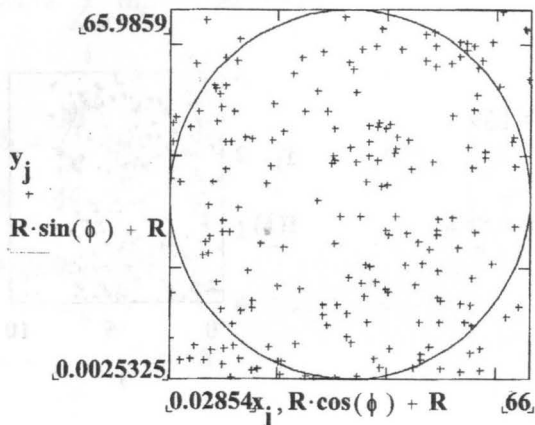
$$m_j := \text{if} \left[ (x_j - R)^2 + (y_j - R)^2 < R^2, 1, 0 \right]$$

$$M := \sum_j m_j \quad M = 155$$

$$S := \frac{M}{N} \cdot (2 \cdot R)^2 \quad S = 3.376 \cdot 10^3 \quad \text{pi} := \frac{S}{R^2} \quad \text{pi} = 3.1$$

$$\pi = 3.142$$

$$\phi := 0, .1..2 \cdot \pi$$





### ЗАДАНИЕ 4

Вычислить приближенно по методу Монте-Карло площадь фигуры, ограниченной замкнутой линией, заданной в полярных координатах.

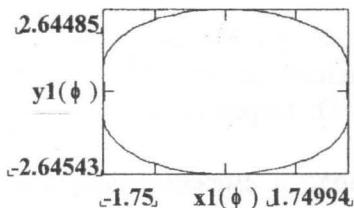
$$\rho^2 = 3 \cos^2 \varphi + 7 \sin^2 \varphi$$

### РЕШЕНИЕ

$$\rho(\phi) := \sqrt{3 \cdot \cos(\phi)^2 + 7 \cdot \sin(\phi)^2} \quad N := 179 \quad i := 1..N$$

$$x1(\phi) := \rho(\phi) \cdot \cos(\phi) \quad y1(\phi) := \rho(\phi) \cdot \sin(\phi)$$

$$\phi := 0, .05 .. 2 \cdot \pi \quad a := 3 \quad b := 3$$

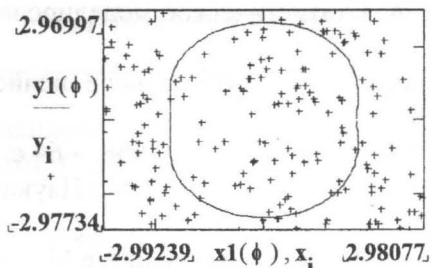


$$x_i := \text{rnd}(2 \cdot a)$$

$$y_i := \text{rnd}(2 \cdot b)$$

$$x_i := x_i - a$$

$$y_i := y_i - b$$



$$\phi\phi_i := \text{if} \left( x_i > 0, \text{atan} \left( \frac{y_i}{x_i} \right), \text{if} \left( x_i < 0, \text{atan} \left( \frac{y_i}{x_i} \right) + \pi, \text{if} \left( y_i > 0, \frac{\pi}{2}, \pi \cdot \frac{3}{2} \right) \right) \right)$$

$$\rho\rho_i := \sqrt{(x_i)^2 + (y_i)^2} \quad m_i := \text{if}(\rho\rho_i < \rho(\phi\phi_i), 1, 0) \quad M := \sum_i m_i \quad M = 77$$

Проверка

$$S := \frac{M}{N} \cdot (a \cdot b \cdot 4)$$

$$ss := \frac{\pi}{2} \cdot (3 + 7)$$

$$ss = 15.708$$

$$S = 15.486$$

$$s := \frac{1}{2} \int_0^{\pi \cdot 2}$$

$$\rho(\phi)^2 d\phi \quad s = 15.708$$

## ЛИТЕРАТУРА

1. Бинер К. Методы Монте-Карло в статистической физике. – М.: Мир, 1982. – 400 с.
2. Соболев И.М. и др. Метод статистических испытаний (Метод Монте-Карло) (СМБ): М.: Физматгиз, 1962. – 332 с.
3. Бусленко Н.П., Шрейдер Ю.А. Метод статистических испытаний (Метод Монте-Карло) и его реализация на цифровых вычислительных машинах: М.: 1961. – 226 с.
4. Вероятность и математическая статистика: Энциклопедия/ Гл. редактор Прохоров Ю.В. – М.: Большая Российская энциклопедия, 1999. – 910 с.
5. Гмурман В.Е. Теория вероятности и математическая статистика. – М.: Высшая школа, 2000.
6. Данко П.Е., Попов А.Г., Кожевникова Т.Я. Высшая математика в упражнениях и задачах. – М.: Высшая школа, 2000, ч.2.
7. Дьяконов В.П. Система MathCAD: Справочник. – М.: Радио и связь, 1993. – 128 с.
8. Ермаков С.М. Метод Монте-Карло и смежные вопросы. – М.: Наука, 1975. – 472 с.
9. Ермаков С.М., Михайлов Г.А. Статистическое моделирование. – М.: Наука, 1982. – 296 с.
10. Пискунов Н.С. Дифференциальное и интегральное исчисление для ВТУЗов. – М.: Наука, 1996. Т.2.
11. Соболев И.М. Метод Монте-Карло. – М.: Наука, 1968. – 64 с.
12. Соболев И.М. Численные методы Монте-Карло. – М.: Наука, 1973. – 312 с.
13. Halton J.H. A retrospective and prospective survey of the Monte Carlo Method. SIAM Rev., (1970) 12, N1. – p.1– 63.
14. Hall A. On an experiment determination of  $\pi$ . Messing. Math. (1873) 2. – p.113 – 11.
15. Hammersley J.M., Handcomb D.C. Monte Carlo Method, London – N.Y., 1964.
16. Metropolis N., Ulam S. The Monte Carlo Method, J. Amer. Stat. Assoc. (1949) 44, N 247. – p. 335-341.

Редактор Н.Н. Кадина

Компьютерный набор: Антон Чесноков

Компьютерная верстка: Н.И. Васильева

Подписано к печати 30.01.03 г.

Объем 1 уч.-изд. л. Тираж 250 экз.

Заказ/31/Цена договорная

---

Редакционно-издательский отдел СПбГУКиТ.

192102. С.-Петербург, ул. Бухарестская, 22.

Подразделение оперативной полиграфии СПбГУКиТ.

192102. С.-Петербург, ул. Бухарестская, 22.