

## DOKTORANTŪROS STUDIJŲ DALYKO APRAŠAS

Dalyko pavadinimas	Mokslo kryptis (šaka) kodas	Fakultetas	Katedra
<b>Atsitiktiniai procesai</b>	Matematika 01P	Matematikos ir informatikos	Ekonometrinės analizės,
Studijų būdas	Kreditų skaičius	Studijų būdas	Kreditų skaičius
Paskaitos	0	Konsultacijos	1
Individualus	<b>4</b>	Seminarai	0

<p><b>Dalyko anotacija</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Stacionarūs procesai. Besišakojantys procesai. Atsitiktinis klaidžiojimas. Markovo grandinės.</li> <li>2. Puasono procesas. Sudėtinis Puasono procesas. Skaičiuojantys procesai.</li> <li>3. Atstatymo procesai.</li> <li>4. Tolydaus laiko procesai. Markovo, Brauno judesio.</li> <li>5. Procesų reguliarumo savybės.</li> <li>6. Levy procesai.</li> </ol>
<p><b>Pagrindinė literatūra</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. S. Resnick. <i>Adventures in Stochastic Processes</i>. Birkhauser, 1992.</li> <li>2. K. Sato. <i>Levy Processes and Infinitely Divisible Distributions</i>. Cambridge University Press, 2002.</li> <li>3. S. M. Ross. <i>Stochastic Processes</i>. New York, Academic press, 1996.</li> </ol>

Konsultuojančiųjų dėstytojų vardas, pavardė	Mokslo laipsnis	Pedag. vardas	Svarbiausieji darbai mokslo kryptyje (šakoje) paskelbti per pastaruosius 5 metus
Alfredas Račkauskas	Habil. dr.	Prof.	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Račkauskas, Alfredas; Suquet, Charles, Functional Laws of Large Numbers in Holder Spaces. // ALEA-LATIN AMERICAN JOURNAL OF PROBABILITY AND MATHEMATICAL STATISTICS. Volume: 10 Issue: 2 Pages: 609-624 Published: 2013</li> <li>2. Characiejus, Vaidotas; Račkauskas, Alfredas , Operator self-similar processes and functional central limit theorems,. // STOCHASTIC PROCESSES AND THEIR APPLICATIONS. Volume: 124 Issue: 8 Pages: 2605-2627 Published: AUG 2014.</li> <li>3. Markevičiūtė, Jurgita; Račkauskas, Alfredas; Suquet, Charles, Testing the epidemic change in nearly nonstationary autoregressive processes. // NONLINEAR ANALYSIS-MODELLING AND CONTROL. Volume: 19 Issue: 1 Pages: 67-82 Published: 2014</li> <li>4. Characiejus, Vaidotas; Račkauskas, Alfredas, Weak law of large numbers for linear processes, Acta Math. Hungar., 149 (1) (2016), 215–232.</li> <li>5. Alfredas Račkauskas and Charles Suquet Computing the distribution of sequential Hölder norms of the Brownian motion, COMMUNICATIONS IN STATISTICS—THEORY AND METHODS 2016, VOL. 45, NO. 15, 4378–4391.</li> </ol>

<p>Patvirtinta Matematikos ir informatikos fakulteto taryboje 2017 m. kovo 14 d., protokolo Nr. 5</p>
<p>Fakulteto tarybos pirmininkas prof. habil. dr. Mindaugas Bloznelis</p>