

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Ребковец Ольга Александровна
Должность: И.о. ректора
Дата подписания: 24.05.2021 06:05:59
Уникальный программный ключ:
e789ec8739030382afc5ebff702978adf1af5cfb

ОПОП

СМК-РПД-В1.П2-2021

Рабочая программа дисциплины Б1.В.01 «Стохастические модели» для направления подготовки 01.04.02 Прикладная математика и информатика, профиль подготовки «Математическое моделирование и вычислительные технологии»

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Камчатский государственный университет имени Витуса Беринга»

Рассмотрено и утверждено на заседании
кафедры математики и физики
11.05.2021 г., протокол №8
Зав. кафедрой _____ И.А. Кашутина

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ (КУРСА, МОДУЛЯ)

Б1.В.01 «Стохастические модели»

Направление подготовки: 01.04.02 Прикладная математика и информатика

Профиль подготовки: «Математическое моделирование и вычислительные технологии»

Год набора: 2021

Квалификация выпускника: магистр

Форма обучения: очно-заочная

Курс 2 Семестр 3

Экзамен: 3 семестр

Петропавловск-Камчатский, 2021 г.

ОПОП		СМК-РПД-В1.П2-2021
Рабочая программа дисциплины Б1.В.01 «Стохастические модели» для направления подготовки 01.04.02 Прикладная математика и информатика, профиль подготовки «Математическое моделирование и вычислительные технологии»		

Рабочая программа составлена с учетом требований федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 01.04.02 Прикладная математика и информатика, утвержденного Приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 10.01.2018 № 13.

Разработчик:

Доцент кафедры математики и физики _____ Р.И. Паровик

ОПОП		СМК-РПД-В1.П2-2021
Рабочая программа дисциплины Б1.В.01 «Стохастические модели» для направления подготовки 01.04.02 Прикладная математика и информатика, профиль подготовки «Математическое моделирование и вычислительные технологии»		

СОДЕРЖАНИЕ

1. Цель и задачи освоения дисциплины	4
2. Место дисциплины в структуре ОП ВО	4
3. Планируемые результаты обучения по дисциплине	4
4. Содержание дисциплины	5
5. Тематическое планирование	5
3 семестр	Ошибка! Закладка не определена.
7. Примерная тематика контрольных работ, курсовых работ	7
8. Перечень вопросов на зачет, экзамен	7
9. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины	8
10. Формы и критерии оценивания учебной деятельности студента	8

ОПОП		СМК-РПД-В1.П2-2021
Рабочая программа дисциплины Б1.В.01 «Стохастические модели» для направления подготовки 01.04.02 Прикладная математика и информатика, профиль подготовки «Математическое моделирование и вычислительные технологии»		

1. Цель и задачи освоения дисциплины

Целью освоения дисциплины является формирование у студентов теоретических знаний и практических навыков построения и реализации стохастических моделей для решения практических задач.

Задачи освоения дисциплины:

- ознакомить студентов с сущностью, познавательными возможностями и практическим значением стохастического моделирования как одного из научных методов познания реальности;
- дать представление о наиболее распространённых математических методах, используемых в стохастическом моделировании;
- сформировать навыки построения и решения стохастической модели;
- научить интерпретировать результаты стохастического моделирования и применять их для решения задач.

2. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Дисциплина «Стохастические модели» относится к блоку Б1 дисциплин вариативной части учебного плана, формируемой участниками образовательных отношений.

3. Планируемые результаты обучения по дисциплине

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций в соответствии с ФГОС ВО по данному направлению подготовки:

Код и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенций
ПК-3. Способен разрабатывать и анализировать концептуальные и теоретические модели решаемых задач проектной и производственно-технологической деятельности	<p>ПК-3.1. Знает общую постановку проблемы принятия оптимальных проектных решений, основные понятия и определения; основные элементы проблемы принятия оптимальных проектных решений, включая состояние внешней среды, цели и матрицу решений; основные методы и модели принятия оптимальных проектных решений в условиях определенности и неопределенности; аналитические и эвристические методы оптимизации проектных решений; прикладные аспекты процессов принятия оптимальных проектных решений в условиях полной и неполной информации.</p> <p>ПК-3.2. Умеет ставить задачи принятия оптимальных проектных решений, в различных предметных областях; априорно выбирать методы, модели или системы поддержки принятия решений; применять методы, модели или системы поддержки принятия решений для машинной генерации как оптимальных, так и приемлемых решений; грамотно анализировать и интерпретировать решения и оценки их полезности; представлять результаты решений в форме научного отчета.</p> <p>ПК-3.3. Владеет методами математического моделирования проектной и производственно-технологической деятельности; методами поддержки принятия решений для машинной генерации как оптимальных, так и приемлемых решений; информационными техно-</p>

ОПОП	СМК-РПД-В1.П2-2021
Рабочая программа дисциплины Б1.В.01 «Стохастические модели» для направления подготовки 01.04.02 Прикладная математика и информатика, профиль подготовки «Математическое моделирование и вычислительные технологии»	

	логиями и системами оптимизации проектных решений.
ПСК-2. Способность определения сферы применения результатов научно-исследовательских и опытно-конструкторских работ	ПСК-2.1. Знает методы разработки информационных, объектных, документных моделей производственных организаций. ПСК-2.2. Умеет применять методы разработки информационных, объектных, документных моделей производственных предприятий. ПСК-2.3. Владеет методами решения задач аналитического характера.

4. Содержание дисциплины

Имитационные модели. Использование ППП в имитационном моделировании. Дискретный марковский процесс. Стохастический процесс. Марковские процессы. Цепи Маркова с дискретным временем. Переходная матрица за один и несколько шагов. Понятие финальных вероятностей и правила их нахождения. Системы массового обслуживания. Детерминированные модели управления запасами. Стохастические модели управления запасами. Моделирование сценариев в условиях неопределенности.

5. Тематическое планирование

Модули дисциплины

№	Наименование модуля	Лекции	Практики/ семинары	Лабораторные	Сам. работа	Всего, часов
1	Стохастические модели	12	14	0	46	72
	Всего	12	14	0	46	72

Тематический план

Модуль 1

№ темы	Тема	Кол-во часов	Компетенции по теме
	<i>Лекции</i>		
1	Имитационные модели.	6	ОПК-3, ПК-3, ПСК-2
2	Дискретный марковский процесс.	6	ОПК-3, ПК-3, ПСК-2
	<i>Практические занятия</i>		

ОПОП		СМК-РПД-В1.П2-2021
Рабочая программа дисциплины Б1.В.01 «Стохастические модели» для направления подготовки 01.04.02 Прикладная математика и информатика, профиль подготовки «Математическое моделирование и вычислительные технологии»		

1	Использование ППП в имитационном моделировании.	4	ОПК-3, ПК-3, ПСК-2
2	Марковский процесс в стационарном режиме.	4	ОПК-3, ПК-3, ПСК-2
3	Моделирование случайных чисел по известному закону распределения.	4	ОПК-3, ПК-3, ПСК-2
4	Системы массового обслуживания.	2	ОПК-3, ПК-3, ПСК-2
<i>Самостоятельная работа</i>			
1	Статическая детерминированная модель без дефицита.	6	ОПК-3, ПК-3, ПСК-2
2	Статическая детерминированная модель с дефицитом.	6	ОПК-3, ПК-3, ПСК-2
3	Стохастические модели управления запасами с фиксированным временем задержки поставок.	6	ОПК-3, ПК-3, ПСК-2
4	Имитационная модель управления запасами.	6	ОПК-3, ПК-3, ПСК-2
5	Рассмотрение различных сценариев при принятии управленческих решений в условиях неопределенности.	4	ОПК-3, ПК-3, ПСК-2
6	Использование «Диспетчера сценариев».	6	ОПК-3, ПК-3, ПСК-2
7	Оптимизационная модель формирования портфеля ценных бумаг (без учета и с учетом коррелированности доходности ценных бумаг).	6	ОПК-3, ПК-3, ПСК-2
8	Имитационная модель доходности портфеля ценных бумаг.	6	ОПК-3, ПК-3, ПСК-2

6. Самостоятельная работа

Самостоятельная работа включает две составные части: аудиторная самостоятельная работа и внеаудиторная.

Самостоятельная аудиторная работа включает выступление по вопросам практических занятий, выполнение практических заданий.

Внеаудиторная самостоятельная работа студентов заключается в следующих формах:

- выполнение практических заданий;
- подготовка сообщений по вопросам практических занятий.

ОПОП	СМК-РПД-В1.П2-2021
Рабочая программа дисциплины Б1.В.01 «Стохастические модели» для направления подготовки 01.04.02 Прикладная математика и информатика, профиль подготовки «Математическое моделирование и вычислительные технологии»	

6.1. Темы практических занятий

Практическая работа №1. Использование ППП в имитационном моделировании.

Практическая работа №2. Марковский процесс в стационарном режиме.

Практическая работа №3. Моделирование случайных чисел по известному закону распределения.

Практическая работа №4. Системы массового обслуживания.

6.2. Внеаудиторная самостоятельная работа

№ п/п	Наименование раздела	Наименование темы	Форма СР	Трудоемкость (час.)
1	Стохастические модели	Статическая детерминированная модель без дефицита.	выполнение практических заданий	6
2		Статическая детерминированная модель с дефицитом.		6
3		Стохастические модели управления запасами с фиксированным временем задержки поставок.		6
4		Имитационная модель управления запасами.		6
5		Рассмотрение различных сценариев при принятии управленческих решений в условиях неопределенности.		8
6		Использование «Диспетчера сценариев».		6
7		Оптимизационная модель формирования портфеля ценных бумаг (без учета и с учетом коррелированности доходности ценных бумаг).		6
8		Имитационная модель доходности портфеля ценных бумаг.		6
Итого				50

7. Примерная тематика контрольных работ, курсовых работ

Учебным планом контрольные работы и курсовые работы по дисциплине Б1.В.02 «Стохастические модели» не предусмотрены.

8. Перечень вопросов на экзамен

1. Разыгрывание дискретной СВ.

ОПОП		СМК-РПД-В1.П2-2021
Рабочая программа дисциплины Б1.В.01 «Стохастические модели» для направления подготовки 01.04.02 Прикладная математика и информатика, профиль подготовки «Математическое моделирование и вычислительные технологии»		

2. Разыгрывание противоположенных событий.
3. Разыгрывание полной группы событий.
4. Метод обратных функций.
5. Метод суперпозиции.
6. Генерация СВ на интервале $(a; 00)$.
7. Генерация СВ на интервале $(-00; a)$.
8. Генерация СВ на интервале $(-00; 00)$.
9. Моделирование нормальной СВ.
10. Моделирование многомерных СВ.
11. Алгоритм метода М-К.
12. Погрешность метода М-К.
13. Алгоритм метода М-К для кратных интегралов.
14. Однородные цепи Маркова, граф и матрица перехода.
15. Теорема о предельных вероятностях.
16. Типы СМО и их характеристики.
17. Моделирование СМО с ожиданиями.
18. Моделирование СМО с отказами.
19. Моделирование потока финансовых платежей.
20. Моделирование убытка и разорения в серии последовательных сделок.
21. Ожидаемый доход и риск инвестиционного портфеля.
22. Численное решение оптимизации инвестиционного портфеля.

9. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

9.1. Основная учебная литература:

1. Рохлин Д.Б., Основы стохастического анализа : учебное пособие / Рохлин Д.Б.. — Ростов-на-Дону, Таганрог : Издательство Южного федерального университета, 2019. — 190 с. — ISBN 978-5-9275-3132-5. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/95808.html> (дата обращения: 16.03.2021). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

9.2. Дополнительная учебная литература:

2. Нахман, А. Д. Введение в стохастическое моделирование : учебное пособие / А. Д. Нахман, Ю. В. Родионов. — Саратов : Ай Пи Эр Медиа, 2018. — 89 с. — ISBN 978-5-4486-0168-2. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/70761.html> (дата обращения: 16.03.2021). — Режим доступа: для авторизир. пользователей. - DOI: <https://doi.org/10.23682/70761>
3. *Кожевникова, И. А.* Стохастическое моделирование процессов : учебное пособие для вузов / И. А. Кожевникова, И. Г. Журбенко. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 148 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-09989-8. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/454199> (дата обращения: 16.03.2021).

10. Формы и критерии оценивания учебной деятельности студента

На основании разработанной компетентностной модели выпускника образовательные цели представлены в виде набора компетенций как планируемых результатов освоения образовательной программы. Определение уровня достижения планируемых результатов освоения образовательной программы осуществляется посредством оценки уровня сформированности компетенции и оценки уровня успеваемости обучающегося по пяти-

ОПОП	СМК-РПД-В1.П2-2021
Рабочая программа дисциплины Б1.В.01 «Стохастические модели» для направления подготовки 01.04.02 Прикладная математика и информатика, профиль подготовки «Математическое моделирование и вычислительные технологии»	

балльной системе («отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно», «зачтено», «не зачтено»).

Основными критериями оценки в зависимости от вида работы обучающегося являются: сформированность компетенций (знаний, умений и владений), степень владения профессиональной терминологией, логичность, обоснованность, четкость изложения материала, ориентирование в научной и специальной литературе.

Критерии оценивания уровня сформированности компетенций и оценки уровня успеваемости обучающегося

Текущий контроль

Уровень сформированности компетенции	Уровень освоения модулей дисциплины (оценка)	Критерии оценивания отдельных видов работ обучающихся		
		Устный/письменный опрос	Отчет по практической работе	Выполнение заданий самостоятельной работы
Высокий	отлично	Обучающийся ответил на все вопросы и продемонстрировал полноту знаний по изучаемому материалу	Содержит все задания лабораторной работы, оформлен в соответствии с требованиями	Студент безошибочно ответил на все основные вопросы, а также продемонстрировал свободное владение материалом при ответе на дополнительные вопросы; работа выполнена в полном объеме и в точном соответствии с требованиями; студент свободно владеет теоретическим материалом, безошибочно применяет его при решении задач, сформулированных в задании
Базовый	хорошо	Обучающийся ответил на большую часть вопросов и продемонстрировал понимание изучаемого материала	Содержит большинство заданий лабораторной работы, оформлен в соответствии с требованиями	Студент безошибочно ответил на основные вопросы, но не точно или не в полном объеме раскрыл дополнительные вопросы; работа выполнена в полном объеме и в точном соответствии с требованиями; студент твердо владеет теоретическим материалом, может применять его самостоятельно или по указанию преподавателя
Пороговый	удовлетворительно	Ответ обучающегося содержал ошибки и недочеты	Содержит меньшую часть заданий лабораторной работы, оформление не соответствует	Студент затрудняется в ответах на вопросы и отвечает только после наводящих вопросов, демонстрирует слабое знание при ответе на дополнительные вопросы; работа выполнена в основном правильно, но без достаточно глубокой проработки некоторых разделов; студент усвоил только основные раз-

ОПОП	СМК-РПД-В1.П2-2021
Рабочая программа дисциплины Б1.В.01 «Стохастические модели» для направления подготовки 01.04.02 Прикладная математика и информатика, профиль подготовки «Математическое моделирование и вычислительные технологии»	

			ет требова- ниям	делы теоретического материала и по указанию преподавателя применяет его практически; на вопросы отвечает неуверенно или допускает ошибки
Компетенции не сформированы	неудовлетворительно	Обучающийся не ответил на поставленные вопросы	Отчет не предоставлен	Студент не ответил ни на один вопрос; работа не выполнена

Промежуточная аттестация

Уровень сформированности компетенции	Уровень освоения дисциплины	Критерии оценивания обучающихся (работ обучающихся)
		экзамен
Высокий	отлично	Студент показал всесторонние, систематизированные, глубокие знания учебной программы дисциплины и умение уверенно применять их на практике при решении конкретных задач, свободное и правильное обоснование принятых решений
Базовый	хорошо	Студент твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, умеет применять полученные знания на практике, но допускает в ответе или в решении задач некоторые неточности
Пороговый	удовлетворительно	Студент показал фрагментарный, разрозненный характер знаний, недостаточно правильные формулировки базовых понятий, нарушения логической последовательности в изложении программного материала, но при этом он владеет основными разделами учебной программы, необходимыми для дальнейшего обучения и может применять полученные знания по образцу в стандартной ситуации
Компетенции не сформированы	неудовлетворительно	Студент не знает большей части основного содержания учебной программы дисциплины, допускает грубые ошибки в формулировках основных понятий дисциплины и не умеет использовать полученные знания при решении типовых практических задач

11. Материально-техническая база

Для проведения аудиторных занятий по дисциплине необходима следующая материально-техническая база: компьютерный кабинет, оборудованный мультимедийным проектором и интерактивной доской.