

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное учреждение
высшего профессионального образования
"Казанский (Приволжский) федеральный университет"
Институт вычислительной математики и информационных технологий



УТВЕРЖДАЮ

Проректор по образовательной деятельности КФУ

Проф. Таюрский Д.А.



_____ 20__ г.

подписано электронно-цифровой подписью

Программа дисциплины
Метод Монте-Карло БЗ.ДВ.5

Направление подготовки: 010400.62 - Прикладная математика и информатика

Профиль подготовки: Теория вероятностей и математическая статистика

Квалификация выпускника: бакалавр

Форма обучения: очное

Язык обучения: русский

Автор(ы):

Стребков Е.В.

Рецензент(ы):

Беговатов Е.А.

СОГЛАСОВАНО:

Заведующий(ая) кафедрой: Турилова Е. А.

Протокол заседания кафедры No ____ от " ____ " _____ 201__ г

Учебно-методическая комиссия Института вычислительной математики и информационных технологий:

Протокол заседания УМК No ____ от " ____ " _____ 201__ г

Регистрационный No 945615

Казань
2015

Содержание

1. Цели освоения дисциплины
2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы
3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля
4. Структура и содержание дисциплины/ модуля
5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения
6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов
7. Литература
8. Интернет-ресурсы
9. Материально-техническое обеспечение дисциплины/модуля согласно утвержденному учебному плану

Программу дисциплины разработал(а)(и) доцент, к.н. (доцент) Стребков Е.В. кафедра математической статистики отделение прикладной математики и информатики ,
Evgenij.Strebkov@kpfu.ru

1. Цели освоения дисциплины

Курс представляет собой общедоступное введение в методы статистического моделирования случайных величин и процессов (метод Монте-Карло). Универсальность и междисциплинарность метода позволяет использовать его для решения вероятностных задач математической физики, техники, экономики, экологии, медицины и т. д.

2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы высшего профессионального образования

Данная учебная дисциплина включена в раздел " Б3.ДВ.5 Профессиональный" основной образовательной программы 010400.62 Прикладная математика и информатика и относится к дисциплинам по выбору. Осваивается на 3 курсе, 6 семестр.

Дисциплина "Метод Монте-Карло" входит в число факультативных курсов профи-ля "Теория вероятностей и математическая статистика" для подготовки бакалавров по на-правлению "Прикладная математика и информатика".

Логическая и содержательно - методическая взаимосвязь с другими дисциплинами и частями ООП выражается в следующем.

Для освоения дисциплины используются знания, умения и виды деятельности, сформированные в процессе изучения курсов: "Теория вероятностей и математическая статистика", "Случайные процессы".

Дисциплина "Метод Монте-Карло" необходима для понимания специального курса "Имитационное моделирование". Полученные в рамках данной дисциплины знания и навыки могут быть использованы в любой сфере деятельности, где возникает потребность в методах статистического моделирования.

3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ПК-2 (профессиональные компетенции)	Способность приобретать новые научные и профессиональные знания, используя современные образовательные и информационные технологии
ПК-5 (профессиональные компетенции)	Способность критически переосмысливать накопленный опыт, изменять при необходимости вид и характер своей профессиональной деятельности.
ПК-7 (профессиональные компетенции)	Способность собирать, обрабатывать и интерпретировать данные современных научных исследований, необходимые для формирования выводов по соответствующим научным, профессиональным, социальным и этическим проблемам.
ПК-8 (профессиональные компетенции)	Способность формировать суждения о значении и последствиях своей профессиональной деятельности с учетом социальных, профессиональных и этических позиций.

В результате освоения дисциплины студент:

1. должен знать:

Основные классы линейных генераторов, основные методы генерации случайных чисел неравномерных распределений, способы их применения в задачах статистического моделирования.

- Приемы тестирования качества генераторов случайных чисел.
- Примеры использования методов Монте-Карло в задачах математики, математической физики, финансовой математики.

2. должен уметь:

Использовать современные языки программирования и ППП имитационного моделирования.

- Самостоятельно реализовывать генераторы случайных чисел различных распределений.
- Проводить тестирование качества генераторов случайных чисел.
- Моделировать физические, экономические и прочие процессы и решать задачи стохастической оптимизации.

3. должен владеть:

Методами статистического моделирования реальных случайных процессов.

4. должен демонстрировать способность и готовность:

Самостоятельно конструировать модификации алгоритмов реализации статистических процессов.

4. Структура и содержание дисциплины/ модуля

Общая трудоемкость дисциплины составляет 2 зачетных(ые) единиц(ы) 72 часа(ов).

Форма промежуточного контроля дисциплины зачет в 6 семестре.

Суммарно по дисциплине можно получить 100 баллов, из них текущая работа оценивается в 50 баллов, итоговая форма контроля - в 50 баллов. Минимальное количество для допуска к зачету 28 баллов.

86 баллов и более - "отлично" (отл.);

71-85 баллов - "хорошо" (хор.);

55-70 баллов - "удовлетворительно" (удов.);

54 балла и менее - "неудовлетворительно" (неуд.).

4.1 Структура и содержание аудиторной работы по дисциплине/ модулю

Тематический план дисциплины/модуля

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
1.	Тема 1. Введение в теорию статистического моделирования.	6	1	0	2	0	домашнее задание
2.	Тема 2. Генераторы случайных чисел. Равномерное распределение.	6	2-3	0	4	0	домашнее задание

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
3.	Тема 3. Генераторы случайных чисел. Неравномерное распределение.	6	4-6	0	6	0	домашнее задание
4.	Тема 4. Моделирование цепей Маркова и случайных процессов.	6	7-10	0	8	0	контрольная работа
5.	Тема 5. Метод Монте-Карло в задачах математики и физики.	6	11-13	0	6	0	домашнее задание
6.	Тема 6. Стохастическая оптимизация.	6	14-16	0	6	0	домашнее задание
7.	Тема 7. Точность методов Монте-Карло.	6	17-18	0	4	0	контрольная работа
	Тема . Итоговая форма контроля	6		0	0	0	зачет
	Итого			0	36	0	

4.2 Содержание дисциплины

Тема 1. Введение в теорию статистического моделирования.

практическое занятие (2 часа(ов)):

Имитация случайности. Датчики случайных чисел.

Тема 2. Генераторы случайных чисел. Равномерное распределение.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Важность равномерного распределения. Классы линейных генераторов.

Тема 3. Генераторы случайных чисел. Неравномерное распределение.

практическое занятие (6 часа(ов)):

Общие и специальные методы моделирования случайных чисел.

Тема 4. Моделирование цепей Маркова и случайных процессов.

практическое занятие (8 часа(ов)):

Статистическое моделирование в физике, биологии, медицине, экономике. Моделирование систем массового обслуживания.

Тема 5. Метод Монте-Карло в задачах математики и физики.

практическое занятие (6 часа(ов)):

Вычисление интегралов, решение уравнений, поиск экстремальных точек.

Тема 6. Стохастическая оптимизация.

практическое занятие (6 часа(ов)):

Модели систем массового обслуживания, управления запасами.

Тема 7. Точность методов Монте-Карло.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Выборка по значимости.

4.3 Структура и содержание самостоятельной работы дисциплины (модуля)

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
1.	Тема 1. Введение в теорию статистического моделирования.	6	1	подготовка домашнего задания	2	домашнее задание
2.	Тема 2. Генераторы случайных чисел. Равномерное распределение.	6	2-3	подготовка домашнего задания	4	домашнее задание
3.	Тема 3. Генераторы случайных чисел. Неравномерное распределение.	6	4-6	подготовка домашнего задания	8	домашнее задание
4.	Тема 4. Моделирование цепей Маркова и случайных процессов.	6	7-10	подготовка к контрольной работе	6	контрольная работа
5.	Тема 5. Метод Монте-Карло в задачах математики и физики.	6	11-13	подготовка домашнего задания	6	домашнее задание
6.	Тема 6. Стохастическая оптимизация.	6	14-16	подготовка домашнего задания	6	домашнее задание
7.	Тема 7. Точность методов Монте-Карло.	6	17-18	подготовка к контрольной работе	4	контрольная работа
	Итого				36	

5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения

Чтение лекций по данной дисциплине проводится традиционным способом.

Студентам предоставляется возможность для самоподготовки и подготовки к зачёту, используя электронный вариант конспекта лекций, подготовленный преподавателем в соответствии с планом лекций.

При работе используется диалоговая форма ведения лекций с постановкой и решением проблемных задач, обсуждением дискуссионных моментов и т.д.

При проведении практических занятий создаются условия для максимально самостоятельного выполнения заданий.

При проведении практического занятия преподавателю рекомендуется:

1. Провести устный экспресс-опрос по теоретическому материалу, необходимому для выполнения работы.
2. Проверить правильность выполнения заданий, подготовленных студентом.

В случае необходимости преподаватель напоминает необходимый минимум теоретического материала и разъясняет порядок выполнения задач повышенной сложности.

Любой практическое занятие включает самостоятельную проработку теоретического материала и изучение методики решения типичных задач. Некоторые задачи могут по-требовать углубленной самостоятельной проработки теоретического материала.

Организация внеаудиторной самостоятельной работы

В процессе изучения учебного курса "Метод Монте-Карло" часть учебной нагрузки отводится на самостоятельную подготовку студентов.

Самостоятельная работа предполагает:

? повторение основных определений и понятий дисциплин, указанных в качестве предшествующих для данного курса

? ознакомление с рекомендованной литературой

? выполнение индивидуальных заданий повышенной сложности, направленных на развитие у студентов научного мышления и инициативы.

6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов

Тема 1. Введение в теорию статистического моделирования.

домашнее задание , примерные вопросы:

Проверка домашнего задания. Разыгрывание дискретных случайных величин.

Тема 2. Генераторы случайных чисел. Равномерное распределение.

домашнее задание , примерные вопросы:

Проверка домашнего задания. Разыгрывание непрерывных случайных величин.

Тема 3. Генераторы случайных чисел. Неравномерное распределение.

домашнее задание , примерные вопросы:

Проверка домашнего задания. Алгоритм и погрешность метода М-К для кратных интегралов.

Тема 4. Моделирование цепей Маркова и случайных процессов.

контрольная работа , примерные вопросы:

Контрольные задания по темам 2-3
Вариант контрольного задания: 1. Записать формулу метода М-К для приближенного вычисления трехкратного интеграла от функции $f(x,y,z)$ на области $(5 < x < 10)$, $(-00 < y < -2)$, $(4 < z < 99)$. 2. В трехканальную СМО с отказами поступает пуассоновский поток заявок. Время между двумя заявками распределено по показательному закону с плотностью $l=4$. Длительность обслуживания заявки равно 1 мин. Найти методом М-К математическое ожидание числа обслуженных заявок за время $T=5$ мин.

Тема 5. Метод Монте-Карло в задачах математики и физики.

домашнее задание , примерные вопросы:

Проверка домашнего задания. Моделирование систем массового обслуживания.

Тема 6. Стохастическая оптимизация.

домашнее задание , примерные вопросы:

Проверка домашнего задания Моделирование потока финансовых платежей.

Тема 7. Точность методов Монте-Карло.

контрольная работа , примерные вопросы:

Контрольные задания по темам 5,7. Вариант контрольного задания: 1. Устройство состоит из трех узлов, соединенных последовательно. Первый узел содержит элементы А и В которые соединены параллельно. Второй узел содержит элемент С, а третий - элемент D. Время безотказной работы устройств (в час.) распределены по показательному закону с соответствующими параметрами: 0,01 ; 0,03 ; 0,05 ; 0,02 . Найти методом М-К : 1) вероятность безотказной работы устройства в течении 8 часов; 2) среднее время безотказной работы устройства.

Тема . Итоговая форма контроля

Примерные вопросы к зачету:

Вопросы к зачету.

1. Разыгрывание дискретной СВ.

- 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.

7.1. Основная литература:

- 1.Попов, Владимир Александрович (канд. физ.-мат. наук ; 1970-) . Теория вероятностей : учебное пособие / В. А. Попов ; Казан. (Приволж.) федер. ун-т, Ин-т физики .? Казань : [Казанский университет], 2013 .? ; 21. Ч. 2: Случайные величины .? 2013 .? 43, [2] с.
- 2.Попов, Владимир Александрович (канд. физ.-мат. наук ; 1970-) .Теория вероятностей : учебное пособие / В. А. Попов ; Казан. (Приволж.) федер. ун-т, Ин-т физики .? Казань : [Казанский университет], 2013 .? ; 21. Ч. 1: Элементарная теория вероятностей .? 2013 .? 46, [2] с.
3. Гмурман, Владимир Ефимович. Теория вероятностей и математическая статистика : учебное пособие для вузов / В. Е. Гмурман .? Издание 10-е, стереотипное .? Москва : Высшая школа, 2004 .? 479 с.
4. Кобзарь, Александр Иванович (1941-) .
Прикладная математическая статистика : для инженеров и науч. работников / А.И. Кобзарь .? Москва : Физматлит, 2006 .? 813 с.
- 5.Вентцель, Елена Сергеевна (1907-2002) .
Теория случайных процессов и ее инженерные приложения : учебное пособие для студентов высших технических учебных заведений / Е. С. Вентцель, Л. А. Овчаров .? 5-е изд., стер. ? Москва : КноРус, 2011 .? 441 с.
- 6.Бородин А.Н. Элементарный курс теории вероятностей и математической статистики. - СПб.: Лань, 2011. - 256с. ЭБС "Лань":http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=2026
- 7.Боровков А.А. Математическая статистика.- СПб.: Лань, 2010. - 704 с. ЭБС "Лань":
http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=3810
- 8.Свешников А.А. Прикладные методы теории вероятностей.- СПб.: Лань, 2012. - 480 с. ЭБС "Лань": http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=3184

- 9.Свешников А.А. Прикладные методы теории марковских процессов.- СПб.: Лань, 2007. - 192 с. ЭБС "Лань": http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=590
- 10.Свешников А.А. Прикладные методы теории случайных функций.- СПб.: Лань, 2011. - 464 с. ЭБС "Лань": http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=656

7.2. Дополнительная литература:

- 1.Механизм диагностики и управления потенциалом интегрированной экономической системы в условиях нестабильности, Ермакова, Лариса Владимировна, 2008г.
2. Феллер В. Введение в теорию вероятностей и ее приложения. - М.: Мир, 1984.
3. Ермаков С.М.,Метод Монте-Карло и смежные вопросы. - М.: Наука, 1975.
- 4.Ермаков С.М., Михайлов Г.А. Курс статистического моделирования. - М.: Наука, 1976.
- 5.Ермаков С.М., Жиглявский А.А. Математическая теория оптимального эксперимента. - М.:Наука, 1987.
- 6.Вентцель Е.С. Теория вероятностей. - М.: Академия, 2003.

7.3. Интернет-ресурсы:

- кр. справоч. по математике - <http://matembook.chat.ru/>
портал матем. интернет ресурсов - <http://www.math.ru/>
портал матем. интернет ресурсов - <http://www.allmath.ru/>
сайт по матем. дисциплинам - <http://www.exponenta.ru/>
сайт с матер. поестеств.-научн. дисциплинам - <http://en.edu.ru/>

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины(модуля)

Освоение дисциплины "Метод Монте-Карло" предполагает использование следующего материально-технического обеспечения:

Лекции по дисциплине проводятся в аудитории, оснащенной доской и мелом (маркером).
Практические занятия проводятся в компьютерном классе с установленным необходимым программным обеспечением.

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВПО и учебным планом по направлению 010400.62 "Прикладная математика и информатика" и профилю подготовки Теория вероятностей и математическая статистика .

Автор(ы):

Стребков Е.В. _____

"__" _____ 201__ г.

Рецензент(ы):

Беговатов Е.А. _____

"__" _____ 201__ г.