

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.

**Программа дисциплины**

Статистическое моделирование Б1.В.ДВ.13

Направление подготовки: 01.03.02 - Прикладная математика и информатика

Профиль подготовки: Теория вероятностей и математическая статистика

Квалификация выпускника: бакалавр

Форма обучения: очное

Язык обучения: русский

**Автор(ы):**

Симушкин С.В.

**Рецензент(ы):**

Халиуллин С.Г.

**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

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) Симушкин С.В. кафедра математической статистики отделение прикладной математики и информатики ,  
Sergey.Simushkin@kpfu.ru

### 1. Цели освоения дисциплины

Цель преподавания дисциплины - ознакомление студентов с методами математического моделирования на ЭВМ, используемыми при решении сложных задач управления технологическими процессами, анализа, оптимизации, проектирования, исследования систем и процессов в отраслях народного хозяйства и в прикладных естественнонаучных областях.

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

Данная учебная дисциплина включена в раздел " Б1.В.ДВ.13 Дисциплины (модули)" основной образовательной программы 01.03.02 Прикладная математика и информатика и относится к дисциплинам по выбору. Осваивается на 4 курсе, 8 семестр.

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

Основу для изучения дисциплины "Статистическое моделирование" (Б3.ДВ.7.) составляют базовые курсы "Теория вероятностей и математическая статистика", "Математический анализ", "Дифференциальные уравнения". В свою очередь дисциплина "Статистическое моделирование" является базовой при изучении дисциплин "Эконометрика", "Моделирование финансового рынка", а также ряда дисциплин специализаций. Дисциплина изучается на 4 курсе обучения.

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

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ПК-1 (профессиональные компетенции)	Понимание студентом и возможность демонстрации основных фактов, концепций, принципов теорий в области статистического моделирования

В результате освоения дисциплины студент:

4. должен демонстрировать способность и готовность:

В рамках курса студент должен демонстрировать способность строить математические модели для решения задач в области управления технологическими процессами, анализа, оптимизации, проектирования, исследования систем и процессов в отраслях народного хозяйства и прикладных естественнонаучных областях. Овладеть навыками написания программ для проведения численных расчетов.

### 4. Структура и содержание дисциплины/ модуля

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

Форма промежуточного контроля дисциплины зачет в 8 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	8		0	5	0	
2.	Тема 2. Математические модели	8		0	5	0	
3.	Тема 3. Имитационное моделирование	8		0	5	0	
4.	Тема 4. Статистическое моделирование	8		0	5	0	
5.	Тема 5. Метод Монте-Карло и его применения	8		0	5	0	
6.	Тема 6. Обработка результатов численных экспериментов, интерпретация полученных результатов	8		0	5	0	
7.	Тема 7. Моделирование ряда физических, биологических и экономических процессов	8		0	5	0	
8.	Тема 8. Программное обеспечение	8		0	5	0	
	Тема . Итоговая форма контроля	8		0	0	0	зачет
	Итого			0	40	0	

#### 4.2 Содержание дисциплины

##### Тема 1. Введение

##### *практическое занятие (5 часа(ов)):*

Предмет курса, история и перспективы развития методов математического моделирования. Актуальность и значимость проблем имитационного и статистического моделирования.

##### Тема 2. Математические модели

##### *практическое занятие (5 часа(ов)):*

Понятие сложной системы. Показатели эффективности функционирования сложных систем. Виды моделирования систем. Классификация математических моделей. Дискретные непрерывные модели, детерминированные и стохастические модели. Агрегативные модели (А-модели).

### **Тема 3. Имитационное моделирование**

#### **практическое занятие (5 часа(ов)):**

Имитационное моделирование и условия его применения. Понятие о модельном времени. Способы описания имитационных моделей на основе событий, активностей, транзактов, процессов, агрегатов. Этапы построения имитационной модели.

### **Тема 4. Статистическое моделирование**

#### **практическое занятие (5 часа(ов)):**

Принципы моделирования случайных элементов. Датчики случайных чисел: табличные, физические, программные и их свойства. Псевдослучайные числа. Моделирование на ЭВМ случайных событий, дискретных и непрерывных случайных величин. Метод обратной функции и его применения. Метод исключения. Метод суперпозиции. моделирование векторных данных и случайных процессов. Моделирование случайных потоков. Контроль точности имитации

### **Тема 5. Метод Монте-Карло и его применения**

#### **практическое занятие (5 часа(ов)):**

Понятие вычислительного эксперимента. Метод Монте-Карло и его применения к приближенному вычислению интегралов. Методы понижения дисперсии при вычислении интегралов: выделение главной части, метод существенной выборки, метод расслоения выборки. Решение интегральных и линейных алгебраических уравнений методом Монте-Карло. Оптимальное планирование имитационных экспериментов. Цели и методы планирования экспериментов. Метод прямого статистического моделирования Г. Бёрда.

### **Тема 6. Обработка результатов численных экспериментов, интерпретация полученных результатов**

#### **практическое занятие (5 часа(ов)):**

Статистические модели экспериментальных данных. Сжатие данных методами главных компонент и факторного анализа. Методы статистического исследования зависимостей. Интерпретация результатов численных экспериментов.

### **Тема 7. Моделирование ряда физических, биологических и экономических процессов**

#### **практическое занятие (5 часа(ов)):**

Модели общего экономического равновесия. Модели экономических циклов неоклассического и кейнсианского типов. Модели молекулярной динамики.

### **Тема 8. Программное обеспечение**

#### **практическое занятие (5 часа(ов)):**

Обзор современного состояния имитационного и статистического моделирования. Принципы реализации методов статистического моделирования на языке C++.

## **4.3 Структура и содержание самостоятельной работы дисциплины (модуля)**

<b>N</b>	<b>Раздел Дисциплины</b>	<b>Семестр</b>	<b>Неделя семестра</b>	<b>Виды самостоятельной работы студентов</b>	<b>Трудоемкость (в часах)</b>	<b>Формы контроля самостоятельной работы</b>
1.	Тема 1. Введение	8		Обзор литературы по теме предмета	2	Опрос

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
2.	Тема 2. Математические модели	8		Изучение свойств некоторых математических моделей	2	Опрос
3.	Тема 3. Имитационное моделирование	8		Изучение имитационных моделей	2	Опрос
4.	Тема 4. Статистическое моделирование	8		Реализация статистических методов на языке C++	6	Консультация
5.	Тема 5. Метод Монте-Карло и его применения	8		Разработка программы на языке C++, реализующей метод Монте-Карло	6	Сдача программы
6.	Тема 6. Обработка результатов численных экспериментов, интерпретация полученных результатов	8		Использование программ для обработки и интерпретации численных экспериментов	2	Опрос
7.	Тема 7. Моделирование ряда физических, биологических и экономических процессов	8		Разработка программы, реализующей один из заданных процессов	6	Консультация
8.	Тема 8. Программное обеспечение	8		Доработка программы, интерпретация результатов моделирования	6	Сдача программы
	Итого				32	

## 5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения

Проведение аудиторных занятий. Разработка приложения на языке C++, интерактивное тестирования работоспособности. Коллективная интерпретация результатов моделирования.

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

### Тема 1. Введение

Опрос , примерные вопросы:

Проведение опроса по задачам и целям статистического моделирования

### Тема 2. Математические модели

Опрос , примерные вопросы:

Проведение опроса по классификации математических моделей

### **Тема 3. Имитационное моделирование**

Опрос , примерные вопросы:

Проведение опроса по условиям и способам применения имитационного моделирования

### **Тема 4. Статистическое моделирование**

Консультация , примерные вопросы:

Консультация по вопросам написания программы на языке C++

### **Тема 5. Метод Монте-Карло и его применения**

Сдача программы , примерные вопросы:

Сдача программы студентом, объяснение принципов и алгоритма работы.

### **Тема 6. Обработка результатов численных экспериментов, интерпретация полученных результатов**

Опрос , примерные вопросы:

Опрос по методам и программам для обработки результатов численных экспериментов

### **Тема 7. Моделирование ряда физических, биологических и экономических процессов**

Консультация , примерные вопросы:

Консультация по вопросам написания программы на языке C++

### **Тема 8. Программное обеспечение**

Сдача программы, примерные вопросы:

Сдача программы студентом, объяснение принципов и алгоритма работы.

### **Тема . Итоговая форма контроля**

Примерные вопросы к зачету:

Примерные вопросы к зачету:

1. Предмет курса, история и перспективы развития методов математического моделирования. Актуальность и значимость проблем имитационного и статистического моделирования.
2. Математические модели. Классификация математических моделей. Дискретные, непрерывные модели, детерминированные и стохастические модели.
3. Имитационное моделирование и условия его применения. Понятие о модельном времени . Способы описания имитационных моделей. Этапы построения имитационной модели.
4. Статистическое моделирование. Принципы моделирования случайных элементов. Датчики случайных чисел: табличные, физические, программные и их свойства. Псевдослучайные числа. Моделирование на ЭВМ случайных событий, дискретных и непрерывных случайных величин. Метод обратной функции и его применения. Метод исключения. Метод суперпозиции. моделирование векторных данных и случайных процессов. Моделирование случайных потоков. Контроль точности имитации
5. Понятие вычислительного эксперимента. Метод Монте-Карло и его применения к приближенному вычислению интегралов. Методы понижения дисперсии при вычислении интегралов: выделение главной части, метод существенной выборки, метод расслоения выборки. Решение интегральных и линейных алгебраических уравнений методом Монте-Карло. Оптимальное планирование имитационных экспериментов. Цели и методы планирования экспериментов. Метод прямого статистического моделирования Г. Бёрда.
6. Обработка результатов численных экспериментов, интерпретация полученных результатов.
7. Статистические модели экспериментальных данных. Сжатие данных методами главных компонент и факторного анализа. Методы статистического исследования зависимостей. Интерпретация результатов численных экспериментов.
8. Моделирование физических, биологических и экономических процессов. Модели общего

экономического равновесия. Модели экономических циклов неоклассического и кейнсианского типов. Модели молекулярной динамики.

9. Программное обеспечение. Принципы реализации методов статистического моделирования на языке C++.

### 7.1. Основная литература:

1. Ансельм А.И. Основы статистической физики и термодинамики. - СПб.: Лань, 2007. - 448 с.  
ЭБС "Лань": <http://e.lanbook.com/view/book/692/>
2. Белонучкин В.Е., Заикин Д.А., Ципенюк Ю.М. Курс общей физики. Основы физики. Т.2. Квантовая и статистическая физика. Термодинамика. - М.: ФИЗМАТЛИТ, 2007. - 608 с.  
ЭБС "Лань": <http://e.lanbook.com/view/book/2201/>
3. Свешников А.А. Прикладные методы теории вероятностей.- СПб.: Лань, 2012. - 480 с.  
ЭБС "Лань": [http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1\\_id=3184](http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=3184)
4. 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](http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=590)
5. 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](http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=656)

### 7.2. Дополнительная литература:

1. Воскобойников Ю.Е. Регрессионный анализ в пакете Mathcad. - СПб.: Лань, 2011. - 224 с.  
ЭБС "Лань": <http://e.lanbook.com/view/book/666/>
2. Дайитбегов Д.М. Компьютерный технологии анализа данных в эконометрике. - М.: Вузовский учебник : НИЦ ИНФРА-М, 2013. - 578 с.  
ЭБС "Знаниум": <http://znanium.com/bookread.php?book=365692>
3. Лысенко С.Н., Дмитриева И.А. Общая теория статистики. - М.: Вузовский учебник, 2009. - 219 с.  
ЭБС "Знаниум": <http://znanium.com/bookread.php?book=166015>
4. Шумак О.А., Гераськин А.В. Статистика. - М.: ИНФРА-М, 2012. - 311 с.  
ЭБС "Знаниум": <http://znanium.com/bookread.php?book=261152>
5. Козлов А.Ю., Мхитарян В.С., Шишов В.Ф. Статистический анализ данных в MS Excel. - М.: ИНФРА-М, 2014. - 320 с.  
ЭБС "Знаниум": <http://znanium.com/bookread.php?book=429722>

### 7.3. Интернет-ресурсы:

- Метод Монте-Карло - <http://www.math.ru/lib/book/plm/v46.djvu>  
Метод прямого статистического моделирования - <http://dic.academic.ru/dic.nsf/ruwiki/1034709>  
Операции над случайными величинами - [www.math.omsu.omskreg.ru/info/learn/terver/0\\_0.htm](http://www.math.omsu.omskreg.ru/info/learn/terver/0_0.htm)  
Проверка статистических гипотез - <http://psi.webzone.ru/st/087600.htm>  
Список литературы по прикладной эконометрике - [http://crow.academy.ru/econometrics/l\\_biblio.htm](http://crow.academy.ru/econometrics/l_biblio.htm)

### 8. Материально-техническое обеспечение дисциплины(модуля)

Освоение дисциплины "Статистическое моделирование" предполагает использование следующего материально-технического обеспечения:



Мультимедийная аудитория, вместимостью более 60 человек. Мультимедийная аудитория состоит из интегрированных инженерных систем с единой системой управления, оснащенная современными средствами воспроизведения и визуализации любой видео и аудио информации, получения и передачи электронных документов. Типовая комплектация мультимедийной аудитории состоит из: мультимедийного проектора, автоматизированного проекционного экрана, акустической системы, а также интерактивной трибуны преподавателя, включающей тач-скрин монитор с диагональю не менее 22 дюймов, персональный компьютер (с техническими характеристиками не ниже Intel Core i3-2100, DDR3 4096Mb, 500Gb), конференц-микрофон, беспроводной микрофон, блок управления оборудованием, интерфейсы подключения: USB, audio, HDMI. Интерактивная трибуна преподавателя является ключевым элементом управления, объединяющим все устройства в единую систему, и служит полноценным рабочим местом преподавателя. Преподаватель имеет возможность легко управлять всей системой, не отходя от трибуны, что позволяет проводить лекции, практические занятия, презентации, вебинары, конференции и другие виды аудиторной нагрузки обучающихся в удобной и доступной для них форме с применением современных интерактивных средств обучения, в том числе с использованием в процессе обучения всех корпоративных ресурсов. Мультимедийная аудитория также оснащена широкополосным доступом в сеть интернет. Компьютерное оборудование имеет соответствующее лицензионное программное обеспечение.

Компьютерный класс, представляющий собой рабочее место преподавателя и не менее 15 рабочих мест студентов, включающих компьютерный стол, стул, персональный компьютер, лицензионное программное обеспечение. Каждый компьютер имеет широкополосный доступ в сеть Интернет. Все компьютеры подключены к корпоративной компьютерной сети КФУ и находятся в едином домене.

Доска маркерная или меловая, проекционный экран, проектор, компьютерный класс с компилятором C++

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВПО и учебным планом по направлению 01.03.02 "Прикладная математика и информатика" и профилю подготовки Теория вероятностей и математическая статистика .

Автор(ы):

Симушкин С.В. \_\_\_\_\_

"\_\_" \_\_\_\_\_ 201\_\_ г.

Рецензент(ы):

Халиуллин С.Г. \_\_\_\_\_

"\_\_" \_\_\_\_\_ 201\_\_ г.