

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

Прикладные вопросы математической статистики БЗ.ДВ.8

Направление подготовки: 090900.62 - Информационная безопасность

Профиль подготовки: Математические и программные средства защиты информации

Квалификация выпускника: бакалавр

Форма обучения: очное

Язык обучения: русский

Автор(ы):

Халиуллин С.Г.

Рецензент(ы):

Ишмухаметов Ш.Т.

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 943016

Казань
2016

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) Халиуллин С.Г. кафедра математической статистики отделение прикладной математики и информатики , Samig.Haliullin@kpfu.ru

1. Цели освоения дисциплины

Целью дисциплины является систематическое изучение методов теории вероятностей и математической статистики, которые используются в качестве математических моделей широкого круга процессов физики, техники, экономики и других разделов естествознания. Особое внимание уделяется вероятностным моделям реальных явлений и статистическим методам идентификации этих моделей.

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

Данная учебная дисциплина включена в раздел " Б3.ДВ.8 Профессиональный" основной образовательной программы 090900.62 Информационная безопасность и относится к дисциплинам по выбору. Осваивается на 3 курсе, 5 семестр.

Данная дисциплина относится к общепрофессиональным дисциплинам.

Читается на 3 курсе в 5 семестре для студентов обучающихся по направлению "Информационная безопасность".

Изучение основывается на результатах изучения дисциплин "Алгебра и геометрия", "Математический анализ 1", "Математический анализ 2", "Дифференциальные и разностные уравнения".

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

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ОК-8 (общекультурные компетенции)	способность к обобщению, анализу, восприятию информации, постановке цели и выбору путей ее достижения, владеть культурой мышления
ПК-1 (профессиональные компетенции)	способность использовать основные естественнонаучные законы, применять математический аппарат в профессиональной деятельности, выявлять сущность проблем, возникающих в ходе профессиональной деятельности
ПК-22 (профессиональные компетенции)	способность проводить эксперименты по заданной методике, обработку результатов, оценку погрешности и достоверности их результатов

В результате освоения дисциплины студент:

1. должен знать:

- основные принципы построения вероятностных моделей и методов принятия статистических решений

2. должен уметь:

- ориентироваться в классических и современных методах доказательства предельных теорем теории вероятностей и выводе распределения статистик - функций отклонение выборочных данных

3. должен владеть:

- теоретическими знаниями, связанными с основными законами теории вероятностей и теории статистического вывода

- навыками построения вероятностных моделей реальных явлений и навыки обработки статистических данных

- применять полученные знания в своей профессиональной деятельности.

4. Структура и содержание дисциплины/ модуля

Общая трудоемкость дисциплины составляет зачетных(ые) единиц(ы) 108 часа(ов).

Форма промежуточного контроля дисциплины зачет в 5 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. Случайные процессы	5		4	0	4	домашнее задание
2.	Тема 2. Проблема статистического вывода	5		4	0	4	домашнее задание
3.	Тема 3. Выборочные характеристики.	5		4	0	4	домашнее задание
4.	Тема 4. Оценка параметров. Метод моментов	5		4	0	4	домашнее задание
5.	Тема 5. Оценка параметров. Метод максимального правдоподобия	5		4	0	4	контрольная работа

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
6.	Тема 6. Доверительные интервалы	5		4	0	4	домашнее задание
7.	Тема 7. Статистическая проверка гипотез (критерии значимости)	5		4	0	4	домашнее задание
8.	Тема 8. Равномерно наиболее мощные критерии	5		4	0	4	домашнее задание
9.	Тема 9. Проверка модельных предположений. Критерии согласия	5		4	0	4	контрольная работа
	Тема . Итоговая форма контроля	5		0	0	0	зачет
	Итого			36	0	36	

4.2 Содержание дисциплины

Тема 1. Случайные процессы

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Случайные процессы Определение случайной функции. Задание распределения на пространстве траекторий случайного процесса. Пуассоновский процесс. Винеровский процесс.

лабораторная работа (4 часа(ов)):

Случайные процессы в дискретном и непрерывном времени. Свойства траекторий. Конечномерные распределения случайного процесса. Примеры случайных процессов.

Тема 2. Проблема статистического вывода

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Проблема статистического вывода Предмет математической статистики. Основные этапы статистического исследования с иллюстрациями на примерах. Строгое определение случайной выборки, выборочного пространства, статистической структуры и статистики. Распределение выборки.

лабораторная работа (4 часа(ов)):

Понятие генеральной совокупности и выборки. Процесс случайного выбора. Понятие статистической модели.

Тема 3. Выборочные характеристики.

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Выборочные характеристики выборки. Выборочная функция распределения, гистограмма. Числовые характеристики выборки - выборочное среднее, выборочная дисперсия, моменты.

лабораторная работа (4 часа(ов)):

Первоначальная обработка результатов наблюдений (выборки). Вычисление числовых характеристик, построение гистограммы и выборочной функции распределения.

Тема 4. Оценка параметров. Метод моментов

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Понятие оценки параметров. Постановка задачи оценки параметра; основная задача теории оценивания. Состоятельность оценок и их несмещенность. Метод моментов. Примеры с оценкой параметров биномиального и гамма распределений. Состоятельность и асимптотическая нормальность оценок по методу моментов.

лабораторная работа (4 часа(ов)):

Построение оценок по методу моментов. Проверка состоятельности и несмещенности этих оценок.

Тема 5. Оценка параметров. Метод максимального правдоподобия

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Оценка параметров. Метод максимального правдоподобия Эвристическое оправдание метода принятия решения на основе максимального правдоподобия с примером по оценке параметров нормального распределения. Определение функции правдоподобия; уравнение правдоподобия.

лабораторная работа (4 часа(ов)):

Нахождение оценок параметров методом максимального правдоподобия. Асимптотические свойства оценок максимального правдоподобия.

Тема 6. Доверительные интервалы

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Доверительные интервалы Полезность интервальной оценки в связи с требованиями точности и надежности. Определение доверительной области, доверительного уровня, доверительного коэффициента и доверительного интервала. Асимптотические доверительные интервалы для параметров биномиального и пуассоновского распределений.

лабораторная работа (4 часа(ов)):

Построение доверительных интервалов для выборок из нормального распределения.

Тема 7. Статистическая проверка гипотез (критерии значимости)

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Статистическая проверка гипотез (критерии значимости) Понятие гипотезы (простой и сложной). Общий принцип построения критериев заданного уровня на основе оценки тестируемого параметра. Двойственность задач доверительного оценивания и проверки гипотез.

лабораторная работа (4 часа(ов)):

Построение критериев значимости, критериев согласия. Критерии хи-квадрат, Стьюдента, Фишера.

Тема 8. Равномерно наиболее мощные критерии

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Равномерно наиболее мощные критерии Наиболее мощный критерий проверки простой гипотезы при простой альтернативе (критерий отношения правдоподобия, лемма Неймана-Пирсона). Использование леммы Неймана-Пирсона при построении равномерно наиболее мощных критериев на примере проверки надежности объектов при показательном распределении долговечности. Равномерно наиболее точные доверительные границы.

лабораторная работа (4 часа(ов)):

Примеры построение равномерно наиболее мощных критериев.

Тема 9. Проверка модельных предположений. Критерии согласия

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Проверка модельных предположений. Критерии согласия Критерий согласия хи-квадрат для проверки простой гипотезы. Критерий согласия хи-квадрат при неизвестных значениях параметров. Критерий независимости хи-квадрат (таблицы сопряженности признаков). Критерий однородности хи-квадрат.

лабораторная работа (4 часа(ов)):

Использование критериев согласия для проверки гипотезы однородности выборок и независимости признаков.

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. Случайные процессы	5		подготовка домашнего задания	4	домашнее задание
2.	Тема 2. Проблема статистического вывода	5		подготовка домашнего задания	4	домашнее задание
3.	Тема 3. Выборочные характеристики.	5		подготовка домашнего задания	4	домашнее задание
4.	Тема 4. Оценка параметров. Метод моментов	5		подготовка домашнего задания	4	домашнее задание
5.	Тема 5. Оценка параметров. Метод максимального правдоподобия	5		подготовка к контрольной работе	4	контрольная работа
6.	Тема 6. Доверительные интервалы	5		подготовка домашнего задания	4	домашнее задание
7.	Тема 7. Статистическая проверка гипотез (критерии значимости)	5		подготовка домашнего задания	4	домашнее задание
8.	Тема 8. Равномерно наиболее мощные критерии	5		подготовка домашнего задания	4	домашнее задание
9.	Тема 9. Проверка модельных предположений. Критерии согласия	5		подготовка к контрольной работе	4	контрольная работа
	Итого				36	

5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения

Обучение происходит в форме практических занятий, а также самостоятельной работы студентов.

Изучение курса подразумевает теоретическим материалом и получение практических навыков для более глубокого понимания разделов дисциплины "Прикладные задачи теории вероятностей". Получение практических навыков происходит за счет решения задач и упражнений, иллюстрирующих доказываемые теоретические положения, а также развитие абстрактного мышления и способности самостоятельно доказывать частные утверждения.

Самостоятельная работа предполагает выполнение домашних работ. Практические задания, выполненные в аудитории, предназначены для указания общих методов решения задач определенного типа. Закрепить навыки можно лишь в результате самостоятельной работы.

Кроме того, самостоятельная работа включает подготовку к экзамену. При подготовке к сдаче экзамена весь объем работы рекомендуется распределять равномерно по дням, отведенным для подготовки к экзамену, контролировать каждый день выполнения работы. Лучше, если можно перевыполнить план. Тогда всегда будет резерв времени.

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

Тема 1. Случайные процессы

домашнее задание , примерные вопросы:

Сформулировать постулаты процесса Пуассона и броуновского движения. Какой процесс называется гауссовским?

Тема 2. Проблема статистического вывода

домашнее задание , примерные вопросы:

Дать определение выборки. В чем различие между выборкой и выборочными данными, статистикой и результатом её применения. Что такое вероятностная модель эксперимента?

Тема 3. Выборочные характеристики.

домашнее задание , примерные вопросы:

Дать интуитивную интерпретацию понятию достаточной статистики. Провести первичную статистическую обработку данных курсового проекта.

Тема 4. Оценка параметров. Метод моментов

домашнее задание , примерные вопросы:

Дать понятия оценки и оценочной функции.

Тема 5. Оценка параметров. Метод максимального правдоподобия

контрольная работа , примерные вопросы:

Привести эвристические доводы в пользу методов моментов и максимального правдоподобия оценки параметров.

Тема 6. Доверительные интервалы

домашнее задание , примерные вопросы:

Как определяются доверительные границы для параметров модели. Что такое опорная функция?

Тема 7. Статистическая проверка гипотез (критерии значимости)

домашнее задание , примерные вопросы:

Сформулировать задачу проверки гипотез по результатам статистических измерений. Дать определения вероятностей ошибок первого и второго рода, мощности критерия.

Тема 8. Равномерно наиболее мощные критерии

домашнее задание , примерные вопросы:

Сформулировать утверждение леммы Неймана-Пирсона. Какая вероятностная модель имеет монотонное отношение правдоподобия?

Тема 9. Проверка модельных предположений. Критерии согласия

контрольная работа , примерные вопросы:

Описать способ проверки модельных предположений с помощью критериев Хи-квадрат и Колмогорова. Обосновать применимость критерия типа Хи-квадрат для проверки гипотезы независимости признаков

Тема . Итоговая форма контроля

Примерные вопросы к зачету:

Билет 1

1. Неравенство Рао-Крамера.

2. Оценка параметра показательного распределения методом моментов.

Билет 2

1. Ошибки первого и второго рода. Мощность критерия.

2. Оценка параметра сдвига показательного распределения.

Билет 3

1. Несмещённая и состоятельная оценка дисперсии.

2. Оценка параметра показательного распределения методом максимального правдоподобия.

Билет 4

1. Несмещённая и состоятельная оценка математического ожидания.

2. Оценка параметра распределения Бернулли методом моментов.

Билет 5

1. Общие понятия о проверке статистических гипотез.

2. Оценка параметра распределения Бернулли методом максимального правдоподобия.

Билет 6

1. Проверка гипотезы о виде распределения. Критерий согласия хи-квадрат.

2. Проверить несмещённость оценки среднего - выборочного среднего.

Билет 7

1. Оценка параметра равномерного распределения на отрезке.

2. Найти энтропию распределения Бернулли.

Билет 8

1. Метод максимального правдоподобия. Примеры.

2. Проверить несмещённость оценки дисперсии - выборочной дисперсии.

Билет 9

1. Задача линейной регрессии. Метод наименьших квадратов.

2. Оценка параметров нормального распределения методом моментов.

Билет 10

1. Одновыборочный критерий Стьюдента.

2. Оценка параметров нормального распределения методом максимального правдоподобия.

Билет 11

1. Выборочная (эмпирическая) функция распределения и её связь с истинной функцией распределения.

2. Методом моментов оценить параметр r равномерного распределения на отрезке $[0; 2r]$; $r > 0$.

Билет 12

1. Критическая область. Ошибки первого и второго рода. Мощность критерия.

2. Методом моментов оценить параметр r равномерного распределения на отрезке $[r; 2r]$; $r > 0$.

Билет 13

1. Теорема Неймана-Пирсона.

2. Методом моментов оценить параметр r равномерного распределения на отрезке $[0; r]$; $r > 0$.

Билет 14

1. Двухвыборочный критерий Стьюдента.

2. Методом моментов оценить параметр r равномерного распределения на отрезке $[r; r + 1]$; $r > 0$.

Билет 15

1. Оценка (интервальная) дисперсии при известном и неизвестном среднем для выборки из нормального распределения.

2. Методом моментов найти оценку параметра p биномиального распределения $Bi(n; p)$, если параметр n известен.

Билет 16

1. Оценка (интервальная) среднего при известной и неизвестной дисперсии для выборки из нормального распределения.

2. Методом моментов найти оценку параметра n биномиального распределения $Bi(n; p)$, если параметр p известен.

Билет 17

1. Критерии значимости, уровень значимости для проверки статистических гипотез.

2. Методом моментов найти оценку параметров биномиального распределения $Bi(n; p)$.

Билет 18

1. Теорема Фишера.

2. Методом моментов найти оценку параметра распределения Пуассона.

Билет 19

1. Распределение хи-квадрат.

2. Методом моментов найти оценку параметра p геометрического распределения.

Билет 20

1. Распределение Фишера.

2. Методом моментов найти оценку параметров биномиального распределения $Bi(n; p)$.

Билет 21

1. Распределение Стьюдента.

2. Методом моментов найти оценку параметра p биномиального распределения $Bi(n; p)$, если параметр n

известен.

Билет 22

1. Метод максимального правдоподобия. Оценка среднего и дисперсии нормального распределения по этому методу.

2. Методом моментов оценить параметр r равномерного распределения на отрезке $[r, 3r]$; $r > 0$.

Билет 23

1. Метод моментов. Оценка параметров биномиального распределения по этому методу.

2. Проверить несмещенность оценки среднего - выборочного среднего.

Билет 24

1. Критерий хи-квадрат как критерий однородности.

2. Методом моментов найти оценку параметра распределения Пуассона.

Билет 25

1. Доверительные интервалы. Оценка среднего нормального распределения при неизвестной дисперсии.

2. Методом моментов оценить параметр r равномерного распределения на отрезке $[r; r + 2]$; $r > 0$.

Билет 26

1. Критерий хи-квадрат как критерий сопряженности признаков.

2. Методом моментов оценить параметр r равномерного распределения на отрезке $[0; r]$; $r > 0$.

Билет 27

1. Теорема Неймана-Пирсона.

2. Методом моментов найти оценку параметра n биномиального распределения $Bi(n; p)$, если параметр p известен.

Билет 28

1. Теорема Пирсона.
2. Оценка параметра распределения Бернулли методом моментов.

Билет 29

1. Группировка данных и гистограмма. Связь с истинной функцией плотности.
2. Оценка параметров нормального распределения методом максимального правдоподобия.

Билет 30

1. Следствия из теоремы Фишера.
2. Оценка параметра показательного распределения по методу максимума правдоподобия.

7.1. Основная литература:

1. Спирина, М. С. Теория вероятностей и математическая статистика: учебник для студ. вузов / М. С. Спирина, П. А. Спирин. - Москва: Академия, 2007. - 352 с
2. Володин, И. Н. Математические основы вероятности [Текст: электронный ресурс]: [учебное пособие] / Володин И. Н., Тихонов О. Е., Турилова Е. А.; Казан. гос. ун-т, Каф. мат. статистики. - 2006. - Электронные данные (1 файл: 0,73 Мб). URL: http://libweb.ksu.ru/ebooks/09_66%20_ds005.pdf
3. Бородин А.Н. Элементарный курс теории вероятностей и математической статистики. - Санкт-Петербург: Лань, 2011. - 256 с.
URL: http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=2026
4. Боровков А.А. Математическая статистика.- Санкт-Петербург: Лань, 2010. - 704 с.
URL: http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=3810
5. Свешников А.А. Прикладные методы теории вероятностей.- Санкт-Петербург: Лань, 2012. - 480 с.
URL: http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=3184
6. Свешников А.А. Прикладные методы теории марковских процессов.- Санкт-Петербург: Лань, 2007. - 192 с.
URL: http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=590
7. Свешников А.А. Прикладные методы теории случайных функций.- Санкт-Петербург: Лань, 2011. - 464с
URL: http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=656

7.2. Дополнительная литература:

- Теория вероятностей и математическая статистика, Ч. 1. Теория вероятностей , , 2012г.
Теория вероятностей и математическая статистика, Гмурман, Владимир Ефимович, 2010г.
Теория вероятностей и математическая статистика, Титов, А. Н.;Бадертдинова, Е. Р.;Климова, А. С., 2011г.

7.3. Интернет-ресурсы:

- Википедия - <http://ru.wikipedia.org>
Портал математических интернет-ресурсов - <http://www.math.ru/>
Портал математических интернет-ресурсов - <http://www.allmath.com/>
Портал образовательных ресурсов по естественно-научным дисциплинам - <http://en.edu.ru/>

Сайт с учебными материалами по математическим дисциплинам - <http://www.exponenta.ru/>

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины(модуля)

Освоение дисциплины "Прикладные вопросы математической статистики" предполагает использование следующего материально-технического обеспечения:

Учебно-методическая литература для данной дисциплины имеется в наличии в электронно-библиотечной системе Издательства "Лань" , доступ к которой предоставлен студентам. ЭБС Издательства "Лань" включает в себя электронные версии книг издательства "Лань" и других ведущих издательств учебной литературы, а также электронные версии периодических изданий по естественным, техническим и гуманитарным наукам. ЭБС Издательства "Лань" обеспечивает доступ к научной, учебной литературе и научным периодическим изданиям по максимальному количеству профильных направлений с соблюдением всех авторских и смежных прав.

Практические занятия по дисциплине проводятся в аудитории, оснащенной доской и мелом(маркером).

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВПО и учебным планом по направлению 090900.62 "Информационная безопасность" и профилю подготовки Математические и программные средства защиты информации .

Автор(ы):

Халиуллин С.Г. _____

"__" _____ 201__ г.

Рецензент(ы):

Ишмухаметов Ш.Т. _____

"__" _____ 201__ г.