

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

Теория вероятностей и математическая статистика Б2.Б.3

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 983815

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) Халиуллин С.Г. кафедры 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 " Б2.Б.3 Общепрофессиональный" основной образовательной программы 090900.62 Информационная безопасность и относится к базовой (общепрофессиональной) части. Осваивается на 2 курсе, 3 семестр.

Данная дисциплина относится к общепрофессиональным дисциплинам.

Читается на 2 курсе в 3 семестре для студентов обучающихся по направлению "Информационная безопасность".

Изучение основывается на результатах изучения дисциплин "Алгебра и геометрия", "Математический анализ".

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

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ОК-11 (общекультурные компетенции)	способность к саморазвитию, самореализации, приобретению новых знаний, повышению своей квалификации и мастерства
ОК-12 (общекультурные компетенции)	способность критически оценивать свои достоинства и недостатки, определять пути и выбрать средства развития достоинств и устранения недостатков
ОК-8 (общекультурные компетенции)	способность к обобщению, анализу, восприятию информации, постановке цели и выбору путей ее достижения, владеть культурой мышления
ОК-9 (общекультурные компетенции)	способность логически верно, аргументированно и ясно строить устную и письменную речь, публично представлять собственные и известные научные результаты, вести дискуссии
ПК-1 (профессиональные компетенции)	способность использовать основные естественнонаучные законы, применять математический аппарат в профессиональной деятельности, выявлять сущность проблем, возникающих в ходе профессиональной деятельности

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ПК-2 (профессиональные компетенции)	способность понимать сущность и значение информации в развитии современного общества, применять достижения информатики и вычислительной техники, перерабатывать большие объемы информации проводить целенаправленный поиск в различных источниках информации по профилю деятельности, в том числе в глобальных компьютерных системах
ПК-20 (профессиональные компетенции)	способность применять методы анализа изучаемых явлений, процессов и проектных решений
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

4. должен продемонстрировать способность и готовность:

- применять полученные знания в своей профессиональной деятельности

4. Структура и содержание дисциплины/ модуля

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетных(ые) единиц(ы) 108 часа(ов).

Форма промежуточного контроля дисциплины экзамен в 3 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 явления. Статистический подход к понятию вероятности. Классическая вероятность. Геометрическая вероятность.	3		1	0	2	домашнее задание
2.	Тема 2. Понятие вероятностного пространства. Элементарные и случайные события. Алгебраические операции над событиями. Дискретные и непрерывные вероятностные пространства.	3		2	0	4	домашнее задание
3.	Тема 3. Аксиомы теории вероятностей. Аксиома непрерывности. Свойства вероятности. Продолжение вероятности с алгебры на сигма-алгебру. Теорема Каратеодори.	3		1	0	2	домашнее задание
4.	Тема 4. Условная вероятность. Независимость событий. Попарная независимость и независимость в совокупности. Пример Бернштейна. Вероятность произведения событий. Независимость сигма-алгебр. Схема Бернулли. Формула полной вероятности. Формула Байеса.	3		2	0	4	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	
5.	Тема 5. Предельные теоремы в схеме Бернулли: локальная предельная теорема, интегральная теорема Муавра-Лапласа, теорема Пуассона.	3		2	0	4	домашнее задание
6.	Тема 6. Случайные величины. Функции от случайных величин. Функция распределения случайной величины и ее свойства. Распределение случайной величины. Типы распределений: дискретный, непрерывный, сингулярный. Функция плотности и ее свойства. Примеры распределений: Бернулли, биномиальное, Пуассона, равномерное, показательное, нормальное и др.	3		1	0	2	контрольная работа
7.	Тема 7. Интеграл Лебега, интеграл Лебега-Стилтьеса. Математическое ожидание и его свойства. Дисперсия и ее свойства. Моменты. Коэффициенты асимметрии и эксцесса. Квантили, медианы и моды. Примеры. Неравенство Чебышева, правило "трех сигм".	3		2	0	4	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	
8.	Тема 8. Случайные векторы. Независимость случайных величин. Многомерные распределения. Свойства совместных функции распределения и функции плотности. Критерий независимости случайных величин. Свойства независимых случайных величин. Свертка функций распределения и функций плотности.	3		1	0	2	домашнее задание
9.	Тема 9. Моментные характеристики случайных векторов. Ковариационная и корреляционная матрицы. Свойства ковариации и коэффициента корреляции. Многомерное нормальное распределение.	3		1	0	2	домашнее задание
10.	Тема 10. Законы больших чисел. Закон больших чисел Я.Бернулли.	3		1	0	2	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	
11.	Тема 11. Сходимость последовательности случайных величин по вероятности. Сходимость почти наверное. Связь между этими сходимостями. Сходимость по распределению. Слабая сходимость последовательности функций распределения. Теорема Хелли (об эквивалентности двух определений слабой сходимости). Связь между сходимостью по вероятности и по распределению. Теоремы о слабой сходимости к непрерывной функции и к константе.	3		2	0	4	домашнее задание
12.	Тема 12. Характеристическая функция и ее свойства. Характеристические функции вырожденного распределения, распределения Бернулли, биномиального, Пуассона, равномерного на отрезке $[0, 1]$, нормального распределений.	3		1	0	2	домашнее задание
13.	Тема 13. Закон больших чисел Хинчина. Центральная предельная теорема. Модели роста, логнормальное распределение.	3		1	0	2	контрольная работа
.	Тема . Итоговая форма контроля	3		0	0	0	экзамен

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
	Итого			18	0	36	

4.2 Содержание дисциплины

Тема 1. Случайные явления. Статистический подход к понятию вероятности.

Классическая вероятность. Геометрическая вероятность.

лекционное занятие (1 часа(ов)):

Парадокс де Мере. Элементы комбинаторики: правило суммы и произведения; размещения, сочетания с повторением и без повторения, перестановки. Схема случайного выбора с возвращением и без возвращения. Примеры.

лабораторная работа (2 часа(ов)):

Задачи нахождения вероятностей событий по классической схеме. Геометрические вероятности. Равномерное распределение. Парадокс Бертрана. Задача Бюффона.

Тема 2. Понятие вероятностного пространства. Элементарные и случайные события.

Алгебраические операции над событиями. Дискретные и непрерывные вероятностные пространства.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Алгебраические операции над событиями. Понятие алгебры и сигма-алгебры событий.

лабораторная работа (4 часа(ов)):

Построение дискретных и непрерывных вероятностных пространств.

Тема 3. Аксиомы теории вероятностей. Аксиома непрерывности. Свойства вероятности.

Продолжение вероятности с алгебры на сигма-алгебру. Теорема Каратеодори.

лекционное занятие (1 часа(ов)):

Аксиоматика Колмогорова. Доказательство теоремы об эквивалентности аксиомы непрерывности (плюс конечной аддитивности) и аксиомы сигма-аддитивности.

лабораторная работа (2 часа(ов)):

Разбор теоремы Каратеодори о продолжении вероятности.

Тема 4. Условная вероятность. Независимость событий. Попарная независимость и независимость в совокупности. Пример Бернштейна. Вероятность произведения событий. Независимость сигма-алгебр. Схема Бернулли. Формула полной вероятности. Формула Байеса.

Формула Байеса.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Понятие условной вероятности и независимости событий. Определение и свойства схемы Бернулли.

лабораторная работа (4 часа(ов)):

Решение задач на использование формул полной вероятности и Байеса.

Тема 5. Предельные теоремы в схеме Бернулли: локальная предельная теорема, интегральная теорема Муавра-Лапласа, теорема Пуассона.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Теоремы Муавра-Лапласа и Пуассона в схеме Бернулли.

лабораторная работа (4 часа(ов)):

Применение теорем Муавра-Лапласа и Пуассона для вычисления вероятностей событий. Сравнение точности аппроксимации соответствующих формул.

Тема 6. Случайные величины. Функции от случайных величин. Функция распределения случайной величины и ее свойства. Распределение случайной величины. Типы распределений: дискретный, непрерывный, сингулярный. Функция плотности и ее свойства. Примеры распределений: Бернулли, биномиальное, Пуассона, равномерное, показательное, нормальное и др.

лекционное занятие (1 часа(ов)):

Понятие случайной величины и ее основные характеристики. Понятие вероятностного распределения. Типы распределений: дискретный, непрерывный, сингулярный. Функция плотности и ее свойства.

лабораторная работа (2 часа(ов)):

Решение задач, приводящих к различным распределениям: Бернулли, биномиальное, Пуассона, равномерное, показательное, нормальное и др.

Тема 7. Интеграл Лебега, интеграл Лебега-Стилтьеса. Математическое ожидание и его свойства. Дисперсия и ее свойства. Моменты. Коэффициенты асимметрии и эксцесса. Квантили, медианы и моды. Примеры. Неравенство Чебышева, правило "трех сигм".

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Математическое ожидание как интеграл Лебега, его свойства. Числовые характеристики случайных величин.

лабораторная работа (4 часа(ов)):

Решение задач на вычисление математических ожиданий, дисперсии и других характеристик случайных величин.

Тема 8. Случайные векторы. Независимость случайных величин. Многомерные распределения. Свойства совместных функции распределения и функции плотности. Критерий независимости случайных величин. Свойства независимых случайных величин. Свертка функций распределения и функций плотности.

лекционное занятие (1 часа(ов)):

Случайные векторы. Свойства совместных функции распределения и функции плотности. Критерий независимости случайных величин. Свертка функций распределения и функций плотности.

лабораторная работа (2 часа(ов)):

Вычисление совместных функций распределения и функций плотности. Восстановление частных распределений по совместным. Вычисление сверток.

Тема 9. Моментные характеристики случайных векторов. Ковариационная и корреляционная матрицы. Свойства ковариации и коэффициента корреляции. Многомерное нормальное распределение.

лекционное занятие (1 часа(ов)):

Ковариационная и корреляционная матрицы, их свойства. Коэффициент корреляции. Некоррелированность и независимость случайных величин.

лабораторная работа (2 часа(ов)):

Решение задач на независимость случайных величин.

Тема 10. Законы больших чисел. Закон больших чисел Я.Бернулли.

лекционное занятие (1 часа(ов)):

Сходимость частоты числа "успехов" в схеме Бернулли. Обобщение теоремы.

лабораторная работа (2 часа(ов)):

Скорость сходимости в предельных теоремах.

Тема 11. Сходимость последовательности случайных величин по вероятности. Сходимость почти наверное. Связь между этими сходимостями. Сходимость по распределению. Слабая сходимость последовательности функций распределения. Теорема Хелли (об эквивалентности двух определений слабой сходимости). Связь между сходимостью по вероятности и по распределению. Теоремы о слабой сходимости к непрерывной функции и к константе.

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Сходимость последовательности случайных величин по вероятности. Сходимость почти наверное. Связь между этими сходимостями. Сходимость по распределению. Слабая сходимость последовательности функций распределения. Теорема Хелли (об эквивалентности двух определений слабой сходимости).

лабораторная работа (4 часа(ов)):

Связь между сходимостью по вероятности и по распределению. Теоремы о слабой сходимости к непрерывной функции и к константе.

Тема 12. Характеристическая функция и ее свойства. Характеристические функции вырожденного распределения, распределения Бернулли, биномиального, Пуассона, равномерного на отрезке $[0, 1]$, нормального распределений.

лекционное занятие (1 часа(ов)):

Характеристические функции. Теоремы единственности и сложения Определение характеристической функции (х.ф.) Свойства х.ф. Вычисление х.ф. Свойства характеристических функций. Формула обращения Леви. Гамма распределение.

лабораторная работа (2 часа(ов)):

Характеристические функции вырожденного распределения, распределения Бернулли, биномиального, Пуассона, равномерного на отрезке $[0, 1]$, нормального распределений.

Тема 13. Закон больших чисел Хинчина. Центральная предельная теорема. Модели роста, логнормальное распределение.

лекционное занятие (1 часа(ов)):

Предельные теоремы теории вероятностей Формулировка критерия слабой сходимости. Закон больших чисел Хинчина. Вероятностные модели роста. Центральная предельная теорема.

лабораторная работа (2 часа(ов)):

Модели роста, логнормальное распределение.

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 явления. Статистический подход к понятию вероятности. Классическая вероятность. Геометрическая вероятность.	3		подготовка домашнего задания	1	домашнее задание
2.	Тема 2. Понятие вероятностного пространства. Элементарные и случайные события. Алгебраические операции над событиями. Дискретные и непрерывные вероятностные пространства.	3		подготовка домашнего задания	3	домашнее задание

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
3.	Тема 3. Аксиомы теории вероятностей. Аксиома непрерывности. Свойства вероятности. Продолжение вероятности с алгебры на сигма-алгебру. Теорема Каратеодори.	3		подготовка домашнего задания	1	домашнее задание
4.	Тема 4. Условная вероятность. Независимость событий. Попарная независимость и независимость в совокупности. Пример Бернштейна. Вероятность произведения событий. Независимость сигма-алгебр. Схема Бернулли. Формула полной вероятности. Формула Байеса.	3		подготовка домашнего задания	1	домашнее задание
5.	Тема 5. Предельные теоремы в схеме Бернулли: локальная предельная теорема, интегральная теорема Муавра-Лапласа, теорема Пуассона.	3		подготовка домашнего задания	1	домашнее задание

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
6.	<p>Тема 6. Случайные величины. Функции от случайных величин. Функция распределения случайной величины и ее свойства. Распределение случайной величины. Типы распределений: дискретный, непрерывный, сингулярный. Функция плотности и ее свойства. Примеры распределений: Бернулли, биномиальное, Пуассона, равномерное, показательное, нормальное и др.</p>	3		подготовка к контрольной работе	1	контрольная работа
7.	<p>Тема 7. Интеграл Лебега, интеграл Лебега-Стилтьеса. Математическое ожидание и его свойства. Дисперсия и ее свойства. Моменты. Коэффициенты асимметрии и эксцесса. Квантили, медианы и моды. Примеры. Неравенство Чебышева, правило "трех сигм".</p>	3		подготовка домашнего задания	1	домашнее задание

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
8.	Тема 8. Случайные векторы. Независимость случайных величин. Многомерные распределения. Свойства совместных функции распределения и функции плотности. Критерий независимости случайных величин. Свойства независимых случайных величин. Свертка функций распределения и функций плотности.	3		подготовка домашнего задания	1	домашнее задание
9.	Тема 9. Моментные характеристики случайных векторов. Ковариационная и корреляционная матрицы. Свойства ковариации и коэффициента корреляции. Многомерное нормальное распределение.	3		подготовка домашнего задания	2	домашнее задание
10.	Тема 10. Законы больших чисел. Закон больших чисел Я.Бернулли.	3		подготовка домашнего задания	1	домашнее задание

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
11.	Тема 11. Сходимость последовательности случайных величин по вероятности. Сходимость почти наверное. Связь между этими сходимостями. Сходимость по распределению. Слабая сходимость последовательности функций распределения. Теорема Хелли (об эквивалентности двух определений слабой сходимости). Связь между сходимостью по вероятности и по распределению. Теоремы о слабой сходимости к непрерывной функции и к константе.	3		подготовка домашнего задания	3	домашнее задание
12.	Тема 12. Характеристическая функция и ее свойства. Характеристические функции вырожденного распределения, распределения Бернулли, биномиального, Пуассона, равномерного на отрезке $[0, 1]$, нормального распределений.	3		подготовка домашнего задания	1	домашнее задание
13.	Тема 13. Закон больших чисел Хинчина. Центральная предельная теорема. Модели роста, логнормальное распределение.	3		подготовка к контрольной работе	1	контрольная работа
	Итого				18	

5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения

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

Теоретический материал излагается на лекциях. Причем конспект лекций, который остается у студента в результате прослушивания лекции не может заменить учебник. Его цель - формулировка основных утверждений и определений. Прослушав лекцию, полезно ознакомиться с более подробным изложением материала в учебнике. Список литературы разделен на две категории: необходимый для сдачи экзамена минимум и дополнительная литература.

Изучение курса подразумевает не только овладение теоретическим материалом, но и получение практических навыков для более глубокого понимания разделов дисциплины "Теория вероятностей и математическая статистика" на основе 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 явления. Статистический подход к понятию вероятности. Классическая вероятность. Геометрическая вероятность.

домашнее задание , примерные вопросы:

Решение задач по изучаемой теме: построение вероятного пространства в различных предположениях.

Тема 2. Понятие вероятностного пространства. Элементарные и случайные события. Алгебраические операции над событиями. Дискретные и непрерывные вероятностные пространства.

домашнее задание , примерные вопросы:

Решение задач по изучаемой теме: различные задачи в дискретном и непрерывном случаях.

Тема 3. Аксиомы теории вероятностей. Аксиома непрерывности. Свойства вероятности. Продолжение вероятности с алгебры на сигма-алгебру. Теорема Каратеодори.

домашнее задание , примерные вопросы:

Решение задач по изучаемой теме: исследование свойств вероятности.

Тема 4. Условная вероятность. Независимость событий. Парная независимость и независимость в совокупности. Пример Бернштейна. Вероятность произведения событий. Независимость сигма-алгебр. Схема Бернулли. Формула полной вероятности. Формула Байеса.

домашнее задание , примерные вопросы:

Решение задач по изучаемой теме: применение различных формул для вычисления вероятностей.

Тема 5. Предельные теоремы в схеме Бернулли: локальная предельная теорема, интегральная теорема Муавра-Лапласа, теорема Пуассона.

домашнее задание , примерные вопросы:

Решение задач по изучаемой теме: применение асимптотических формул для вычисления вероятностей.

Тема 6. Случайные величины. Функции от случайных величин. Функция распределения случайной величины и ее свойства. Распределение случайной величины. Типы распределений: дискретный, непрерывный, сингулярный. Функция плотности и ее свойства. Примеры распределений: Бернулли, биномиальное, Пуассона, равномерное, показательное, нормальное и др.

контрольная работа , примерные вопросы:

контрольная работа по темам 1-6

Тема 7. Интеграл Лебега, интеграл Лебега-Стилтьеса. Математическое ожидание и его свойства. Дисперсия и ее свойства. Моменты. Коэффициенты асимметрии и эксцесса. Квантили, медианы и моды. Примеры. Неравенство Чебышева, правило "трех сигм".

домашнее задание , примерные вопросы:

Решение задач по изучаемой теме: вычисление математических ожиданий и дисперсий случайных величин, других числовых характеристик случайных величин.

Тема 8. Случайные векторы. Независимость случайных величин. Многомерные распределения. Свойства совместных функции распределения и функции плотности. Критерий независимости случайных величин. Свойства независимых случайных величин. Свертка функций распределения и функций плотности.

домашнее задание , примерные вопросы:

Решение задач по изучаемой теме: независимые случайные величины, совместные распределения случайных величин.

Тема 9. Моментные характеристики случайных векторов. Ковариационная и корреляционная матрицы. Свойства ковариации и коэффициента корреляции. Многомерное нормальное распределение.

домашнее задание , примерные вопросы:

Решение задач по изучаемой теме: проверка на независимость различных случайных величин.

Тема 10. Законы больших чисел. Закон больших чисел Я.Бернулли.

домашнее задание , примерные вопросы:

Решение задач по изучаемой теме: использование предельных теорем для вычисления вероятностей.

Тема 11. Сходимость последовательности случайных величин по вероятности. Сходимость почти наверное. Связь между этими сходимостями. Сходимость по распределению. Слабая сходимость последовательности функций распределения. Теорема Хелли (об эквивалентности двух определений слабой сходимости). Связь между сходимостью по вероятности и по распределению. Теоремы о слабой сходимости к непрерывной функции и к константе.

домашнее задание , примерные вопросы:

Решение задач по изучаемой теме: исследование связей между различными типами сходимости.

Тема 12. Характеристическая функция и ее свойства. Характеристические функции вырожденного распределения, распределения Бернулли, биномиального, Пуассона, равномерного на отрезке $[0, 1]$, нормального распределений.

домашнее задание , примерные вопросы:

Решение задач по изучаемой теме: использование характеристических функций для решения задач и доказательства предельных теорем.

Тема 13. Закон больших чисел Хинчина. Центральная предельная теорема. Модели роста, логнормальное распределение.

контрольная работа , примерные вопросы:

контрольная работа по темам 7-12

Тема . Итоговая форма контроля

Примерные вопросы к экзамену:

По данной дисциплине предусмотрено проведение экзамена. Примерные вопросы для экзамена - Приложение 1.

Список билетов по дисциплине

Билет ♦ 1

1. Закон больших чисел Бернулли.
2. Характеристическая функция и ее свойства.

Билет ♦ 2

1. Гипергеометрическое распределение вероятностей.
2. Случайная величина и ее характеристики.

Билет ♦ 3

1. Свойства вероятности.
2. Распределения, возникающие в математической статистике: хи-квадрат, Стьюдента, Фишера

Билет ♦ 4

1. Статистический подход к понятию вероятности.
2. Сходимость почти всюду..

Билет ♦ 5

1. Условная вероятность и независимость. Пример событий, независимых попарно, но зависимых в совокупности.
2. Центральная предельная теорема.

Билет ♦ 6

1. Схема испытаний Бернулли и связанные с ней распределения.
2. Функция плотности и ее свойства.

Билет ♦ 7

1. Формула полной вероятности и формула Байеса.
2. Типы распределений - определения и примеры.

Билет ♦ 8

1. Нормальное распределение и его свойства.
2. Классическое определение вероятности.

Билет ♦ 9

1. Функции распределения, функция плотности и их свойства.
2. Дисперсия и ее свойства.

Билет ♦ 10

1. Показательное распределение и гамма распределение.
2. Сходимость по вероятности.

Билет ♦ 11

1. Независимость событий и семейств событий. Независимость булевых алгебр. Независимость случайных величин.
2. Локальная теорема Муавра-Лапласа.

Билет ♦ 12

1. Определение и свойства математического ожидания и дисперсии.
2. Интегральная теорема Муавра-Лапласа.

Билет ♦ 13

1. Закон больших чисел Хинчина.
2. Теорема Пуассона.

Билет ♦ 14

1. Распределение Пуассона и нормальное распределение как пределы биномиального распределения.
2. Использование комбинаторных формул для вычисления вероятности.

Билет ♦ 15

1. Геометрические вероятности.
2. Функция распределения случайной величины и ее свойства.

Билет ♦ 16

1. Совместные и маргинальные распределения. Критерий независимости случайных величин.
2. Парадокс де Мере.

Билет ♦ 17

1. Центральная предельная теорема.
2. Парадокс Бертрана.

Билет ♦ 18

1. Распределение суммы двух независимых случайных величин (формула свёртки)
2. Независимость случайных величин, критерий независимости.

Билет ♦ 19

1. Коэффициент корреляции и его свойства.
2. Дискретное вероятностное пространство.

Билет ♦ 20

1. Мультиномиальное распределение.
2. Непрерывные вероятностные пространства.

Билет ♦ 21

1. Схема Бернулли.
2. Свойства характеристических функций.

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. Лекции по теории вероятностей и математической статистики/ И.Н. Володин. - Казань: Изд-во КГУ, 2006. - 271 с.
3. Володин, Игорь Николаевич (д-р физ.-мат. наук ; 1937-) . Лекции по теории вероятностей и математической статистике [Текст: электронный ресурс] : [учебник] для студентов высших учебных заведений, обучающихся по специальности 010200 "Прикладная математика и информатика" и по направлению 510200 "Прикладная математика и информатика" / И. Н. Володин ; Казан. гос. ун-т, Каф. мат. статистики .? Электронные данные (1 файл: 1,5 Мб) .? (Казань : Казанский федеральный университет, 2013). - Режим доступа: открытый.
<URL:http://libweb.ksu.ru/ebooks/09_66%20_ds006.pdf>.
5. Симушкин С.В. Задачи по теории вероятностей/ С.В. Симушкин, Л.Н. Пушкин. - Казань: Изд-во КГУ, 2011. - 222с.
6. Симушкин, Сергей Владимирович (канд. физ.-мат. наук ; 1956-) . Задачи по теории вероятностей [Текст: электронный ресурс] : учебное пособие / С. В. Симушкин, Л. Н. Пушкин .? Электронные данные (1 файл: 1,48 Мб) .? (Казань : Казанский федеральный университет, 2014) .? Загл. с экрана .? Режим доступа: открытый .
<URL:<http://libweb.ksu.ru/ebooks/publicat/0-787673.pdf>>.

7. Теоретические аспекты заданий курсового проекта по математической статистике / Казан. гос. ун-т. Каф. мат. статистики; [Сост. С.В. Симушкин].?Казань: Казан. гос. ун-т, 2004.?67с.: ил..?Библиогр.: с.3.
8. Как выполнить курсовой проект по математической статистике в Excel / Казан. гос. ун-т. Каф. мат. статистики; [Сост. С.В. Симушкин].?Казань: Казан. гос. ун-т, 2004.?78с.: ил.
9. Бородин А.Н. Элементарный курс теории вероятностей и математической статистики. - СПб.: Лань, 2011. - 256с. http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=2026
10. Боровков А.А. Математическая статистика.- СПб.: Лань, 2010. - 704 с. http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=3810
11. Свешников А.А. Прикладные методы теории вероятностей.- СПб.: Лань, 2012. - 480 с. http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=3184

7.2. Дополнительная литература:

1. Кремер, Н. Ш. Теория вероятностей и математическая статистика = Probability theory and mathematical statistics: учеб. для студентов вузов, обучающихся по экон. спец. / Н.Ш. Кремер.?2-е изд., перераб. и доп..?Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2006.?573 с.
2. Гмурман, В. Е. Теория вероятностей и математическая статистика: учебное пособие для студентов вузов / В. Е. Гмурман.?12-е изд., перераб..?Москва: Высш. образование: Юрайт-Издат, 2009.?478 с.
3. 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.?Электронные данные (1 файл: 0,73 Мб). URL: http://libweb.ksu.ru/ebooks/09_66%20_ds005.pdf
4. Большев, Логин Николаевич. Таблицы математической статистики / Л. Н. Большев, Н. В. Смирнов.?Изд.3-е.?Москва: Наука, 1983.?416 с.: табл.; 27 см.?3 р. 10 к
5. Ван дер Варден Б. Л. Математическая статистика: перевод с немецкого / ; Пер. Л. Н. Большева; Под ред. И. В. Смирнова.?Москва: Изд-во иностранной литературы, 1960.?434 с

7.3. Интернет-ресурсы:

- Краткий справочник по математике - <http://matembook.chat.ru/>
Портал математических интернет-ресурсов - <http://www.math.ru/>
Портал математических интернет-ресурсов - <http://www.allmath.com/>
Сайт с материалами 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 "Теория вероятностей и математическая статистика" 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.

Лекции по дисциплине проводятся в аудитории, оснащенной доской и мелом(маркером), практические занятия по дисциплине проводятся в компьютерном классе.

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.