



Національний технічний університет України
«КИЇВСЬКИЙ ПОЛІТЕХНІЧНИЙ ІНСТИТУТ
імені ІГОРЯ СІКОРСЬКОГО»



Кафедра математичного
аналізу та теорії
ймовірностей

КОНЦЕПЦІЇ ЗАЛЕЖНОСТІ ДЛЯ ВИПАДКОВИХ ПРОЦЕСІВ

Робоча програма навчальної дисципліни (Силабус)

Реквізити навчальної дисципліни

Рівень вищої освіти	<i>Третій (освітньо-науковий)</i>
Галузь знань	<i>11 Математика та статистика</i>
Спеціальність	<i>111 Математика</i>
Освітня програма	<i>Математика</i>
Статус дисципліни	<i>Вибіркова</i>
Форма навчання	<i>очна(денна)</i>
Рік підготовки, семестр	<i>II курс, осінній семестр</i>
Обсяг дисципліни	<i>4 кредити ЕКТС</i>
Семестровий контроль/ контрольні заходи	<i>іспит</i>
Розклад занять	
Мова викладання	<i>Українська</i>
Інформація про керівника курсу / викладачів	<i>Лектор: к.ф.-м.н., доцент Орловський Ігор Володимирович, i.v.orlovsky@gmail.com Практичні / Семінарські: к.ф.-м.н., доцент Орловський Ігор Володимирович, i.v.orlovsky@gmail.com</i>
Розміщення курсу	<i>I</i>

Програма навчальної дисципліни

1. Опис навчальної дисципліни, її мета, предмет вивчення та результати навчання

Цілі дисципліни	<p>Метою навчальної дисципліни є формування у студентів здатностей:</p> <ul style="list-style-type: none"> - до необхідної інтуїції та ерудиції у питаннях застосування математики, виховання у аспірантів прикладної математичної культури; - використовувати методи лінійної алгебри, математичного аналізу, теорії ймовірностей у задачах мікроекономіки; - уміння аналізувати одержані результати, здатності до узагальнення, постановки цілі та вибору шляхів її розв'язання, володіння культурою мислення; - самостійно використовувати і вивчати літературу з математики та мікроекономіки, здатності до розвитку гнучкості мислення, творчої самостійності та дій.
Предмет навчальної дисципліни	<p>Основні класи випадкових процесів: відповідно до часового аргументу (дискретний, неперервний, багатовимірний); а також відповідно до кореляційних властивостей (стаціонарні, з ортогональними значеннями, мартингали).</p>
Компетентності	<p>ЗК1: Здатність проводити критичний аналіз, оцінку і синтез нових та складних ідей ЗК3: Здатність креативно (творчо) мислити, розробляти та реалізовувати проекти, включаючи власні дослідження ЗК5: Здатність до пошуку, оброблення та аналізу інформації з різних джерел ФК1: Здатність самостійно виконувати науково-дослідну діяльність у галузі математики та статистики з використанням сучасних теорій, методів та інформаційно-комунікаційних технологій і дотриманням належної академічної доброчесності ФК2: Здатність адаптувати і узагальнювати результати сучасних досліджень в галузі математики та статистики для вирішення наукових і практичних проблем ФК3: Здатність проводити теоретичні й експериментальні дослідження, математичне й комп'ютерне моделювання для перевірки математичних гіпотез та отримання результатів ФК4: Здатність до оцінки адекватності математичної моделі об'єкту за допомогою аналітичного дослідження та імітаційного моделювання;</p>
Програмні результати навчання	<p>РН1 Знати сучасні тенденції, напрямки, наукові концепції та закономірності розвитку світової та вітчизняної науки, основні математичні та статистичні наукові школи, їх теоретичні та прикладні розробки РН2 Володіти найбільш передовими концептуальними та методологічними знаннями в галузі науково-дослідної та професійної діяльності і на межі предметних галузей РН3 Знати та дотримуватися основних засад академічної доброчесності у науковій і освітній (педагогічній) діяльності РН10 Уміти застосовувати знання основ аналізу та синтезу в різних предметних областях, критичного осмислення й розв'язання науково-дослідних проблем РН12 Уміти формулювати і перевіряти гіпотези; використовувати для обґрунтування висновків належні докази, зокрема, результати теоретичного аналізу, експериментальних досліджень і математичного та/або комп'ютерного моделювання, наявні літературні дані РН13 Уміти організувати і проводити науково-дослідну, інноваційну та</p>

	<p>освітню діяльність в обраній науковій спеціальності – математиці та статистиці</p> <p>РН14 Уміти розв’язувати теоретичні та прикладні математичні проблеми з використанням базових знань математики та статистики та базових загальних знань з різних природничих та соціальних наук</p> <p>РН15 Уміти приймати рішення у своїй професійній діяльності, демонструвати авторитетність, високий ступінь самостійності</p> <p>РН17 Уміти адаптувати, інтерпретувати та узагальнювати результати сучасних математичних та статистичних досліджень для розв’язання теоретичних та прикладних проблем</p>
--	--

2. Пререквізити та постреквізити дисципліни (місце в структурно-логічній схемі навчання за відповідною освітньою програмою)

Освітній компонент “СУЧАСНІ КОНЦЕПЦІЇ ЗАЛЕЖНОСТІ ДЛЯ ВИПАДКОВИХ ПРОЦЕСІВ” є одним із завершальних курсів професійної підготовки докторів філософії спеціальності “Математика”.

3. Зміст навчальної дисципліни

Кредитний модуль включає наступні теми

Розділ 1. Типи слабкої залежності випадкових об’єктів.

Тема 1.1. Перемішування

Тема 1.2. Міксінгали

Тема 1.3. Властивість асоціативності

Розділ 2. Показники слабкої залежності

Тема 2.4. Коефіцієнти η , κ , ζ , θ , τ

Тема 2.5. Коефіцієнти α , β , φ

Тема 2.6. Проективні міри залежності

Розділ 3. Моделі залежності

Тема 3.7. Зсуви Бернуллі

Тема 3.8. Марковські послідовності

Тема 3.9. Динамічні системи

Тема 3.10. LARCH процеси

Тема 3.11. Білінійні процеси

Розділ 4. Граничні теореми та застосування

Тема 4.12. Підсилений закон великих чисел для залежних випадкових величин

Тема 4.13. Процедури стохастичної оптимізації

Тема 4.14. Слабко залежні шуми

Тема 4.15. Лінійна регресія

Тема 4.16. Граничні теореми для випадкових мір

Заплановано **практичні заняття** для поглибленого вивчення окремих розділів курсу. На практичних заняттях аспіранти навчаються розв’язувати задачі з відповідних тем курсу.

4. Навчальні матеріали та ресурси

1. J.Dedecker, P.Doukhan, G.Lang, J. Leon, S.Louhichi, C.Prieur. Weak dependence // Springer, Berlin, 2007, 323 pp.

2. Клесов О.І. Граничні теореми для кратних сум випадкових величин // ТВіМС, Київ, 2014. – 404 стор. (переклад англійською: O.I.Klesov, Limit Theorems for Multi-Indexed Sums of Random Variables, Springer, Cham, 2014, 430 pp.)
3. W. Stout. Almost sure convergence // Academic Press, New York, 1994, 393 pp.
4. P.Doukhan. Stochastic Models for Time Series // Springer, Cham, 2018, 215 pp.

Навчальний контент

5. Методика опанування навчальної дисципліни (освітнього компонента)

№ з/п	Назва теми лекції та перелік основних питань (перелік дидактичних матеріалів, посилання на літературу)
1.1	Перемішування <i>Рекомендована література:</i> [1], глава 1, розділи 1, 2
1.2.	Міксінгали <i>Рекомендована література:</i> [1], глава 1, розділи 3, 4
1.3.	Властивість асоціативності <i>Рекомендована література:</i> [4], глава 8
2.4.	Коефіцієнти $\eta, \kappa, \zeta, \theta, \tau$ <i>Рекомендована література:</i> [1], глава 2, розділ 1
2.5.	Коефіцієнти α, β, φ <i>Рекомендована література:</i> [1], глава 2, розділ 2
2.6.	Моменти та кумулянти <i>Рекомендована література:</i> [4], глава 12
3.7.	Зсуви Бернуллі <i>Рекомендована література:</i> [1], глава 3, розділ 1
3.8.	Марковські послідовності <i>Рекомендована література:</i> [4], глава 7, розділ 3
3.9.	Динамічні системи <i>Рекомендована література:</i> [1], глава 3, розділ 3.
3.10.	LARCH процеси <i>Рекомендована література:</i> [4], глава 7, розділ 2.
3.11.	Стійкі стаціонарні процеси <i>Рекомендована література:</i> [3], глава 3, розділи 5.
4.12.	Підсилений закон великих чисел для залежних випадкових величин <i>Рекомендована література:</i> [2], глава 4.
4.13.	Процедури стохастичної оптимізації <i>Рекомендована література:</i> [1], глава 6, розділ 2.
4.14.	Слабко залежні шуми <i>Рекомендована література:</i> [2], глава 4.
4.15.	Лінійні процеси <i>Рекомендована література:</i> [4], глава 6
4.16.	Граничні теореми для випадкових мір <i>Рекомендована література:</i> [2], глава 11.

5. Практичні заняття.

№	Назва теми заняття та перелік основних питань (перелік дидактичних засобів,
---	---

з/п	посилання на літературу та завдання на СРС)
1.1-1.3	Перемішування та міксінгали Завдання СРС: [3], глава 3, розділ 3
2.4-2.6	Коефіцієнти залежності Завдання СРС: [3], глава 3, розділ 5.
3.7-3.11	Моделі залежності впадкових величин та процесів Завдання СРС: [3], глава 3, розділи 6, 7
4.12-4.16	Граничні теореми для залежних випадкових величин Завдання СРС: [2], глава 4; [4], глава 11
	МКР

6. Самостійна робота студента/аспіранта

Вивчення дисципліни включає наступні види самостійної роботи:

- підготовка до лекційних та практичних занять
- виконання розрахунково-графічної роботи,
- виконання модульної контрольної роботи.
- підготовка до МКР та екзамену

Політика та контроль

7. Політика навчальної дисципліни (освітнього компонента)

Рекомендовані методи навчання: вивчення основної та допоміжної літератури за тематикою лекцій, розв'язування задач на практичних заняттях та при виконанні домашніх робіт. Аспіранту рекомендується вести докладний конспект лекцій. Важливим аспектом якісного засвоєння матеріалу, відпрацювання методів та алгоритмів вирішення основних завдань дисципліни є самостійна робота. Вона містить читання літератури, огляд літератури за темою, підготовку до занять та до іспиту.

Академічна доброчесність

Політика та принципи академічної доброчесності визначені у розділі 3 Кодексу честі Національного технічного університету України «Київський політехнічний інститут імені Ігоря Сікорського». Детальніше: <https://kpi.ua/code>

Норми етичної поведінки

Норми етичної поведінки студентів і працівників визначені у розділі 2 Кодексу честі Національного технічного університету України «Київський політехнічний інститут імені Ігоря Сікорського». Детальніше: <https://kpi.ua/code>

8. Види контролю та рейтингова система оцінювання результатів навчання (PCO)

На першому занятті здобувачі ознайомлюються із рейтинговою системою оцінювання (PCO) дисципліни, яка побудована на основі Положення про систему оцінювання результатів навчання https://document.kpi.ua/files/2020_1-273.pdf

Зокрема, рейтинг здобувача з освітнього компонента формується як сума балів поточної успішності навчання – стартового рейтингу (максимально **50** балів) та екзаменаційних балів (максимально **50** балів).

Поточний контроль: фронтальний (усний\письмовий), МКР; індивідуальне завдання.

Календарний контроль: проводиться двічі на семестр як моніторинг поточного стану виконання вимог си́лабусу результати якого відображаються в системі Електронний кампус <https://campus.kpi.ua>.

Рейтингова система оцінювання включає всі види тестування: контрольні роботи, виконання індивідуального завдання, відповідь на екзамені. Кожний здобувач отримує свій підсумковий рейтинг по дисципліні.

Рейтинг здобувача з кредитного модуля складається з балів, які він отримує за:

- роботу на практичних заняттях
- написання модульної контрольної роботи;
- виконання індивідуального завдання (РГР);
- відповіді на екзамені (письмової екзаменаційної роботи).

Відповіді під час практичних занять

Ваговий бал 1 (може бути відкорегований в залежності від кількості запланованих занять)

- якщо задача повністю розв'язана, то здобувач отримує максимальну кількість запланованих балів;
- якщо відповідь правильна, але у розв'язку є неточності, то здобувач отримує 0,5 запланованих балів;
- якщо незадовільна відповідь, метод розв'язування задачі неправильний – 0 балів;

Максимальний бал 10.

Модульна контрольна робота

Ваговий бал 20

Критерії оцінювання

- повна відповідь на всі завдання (більше 90% матеріалу) 18 – 20 балів;
- неповна відповідь на завдання (від 50 до 90% матеріалу) - 10 – 17 балів;
- відповідь містить менше 50 % необхідної інформації – 0-9 балів;

Максимальний бал 20

Індивідуальне завдання (Розрахунково-графічна робота)

Ваговий бал 20

Критерії оцінювання

- повна відповідь на всі завдання (більше 90% матеріалу) 18 – 20 балів;
- неповна відповідь на завдання (від 50 до 90% матеріалу) - 10 – 17 балів;
- відповідь містить менше 50 % необхідної інформації – 0-9 балів;

Виконання РГР може бути замінено на підготовку тез на наукову конференцію.

Максимальний бал 20

Умови допуску до екзамену.

Умовою допуску до екзамену є стартовий рейтинг не менше 30 балів. Здобувач, який в кінці навчального семестру мають менше балів до екзамену не допускаються і повинні виконати додаткові завдання до першого перскладання.

Форма семестрового контролю – іспит

На екзамені студенти виконують письмову контрольну роботу. Кожне завдання містить два теоретичних запитання (завдання) і одне практичне. Кожне теоретичне запитання (завдання) оцінюється у 15 балів, а практичне у 20 балів за такими критеріями:

- «відмінно», повна відповідь, не менше 90% потрібної інформації, що виконана згідно з вимогами до рівня «умінь», (повне, безпомилкове розв'язування завдання) – 14-15; 18-20 балів;
- «добре», достатньо повна відповідь, не менше 75% потрібної інформації, що виконана згідно з вимогами до рівня «умінь» або є незначні неточності (повне розв'язування завдання з незначними неточностями) – 11-13; 16-17 балів;
- «задовільно», неповна відповідь, не менше 60% потрібної інформації, що виконана згідно з вимогами до рівня «умінь» та деякі помилки (завдання виконане з певними недоліками) – 9-10; 10-15 балів
- «незадовільно», відповідь не відповідає умовам до «задовільно» – 0 балів.

Сума стартових балів та балів за екзамен переводиться до екзаменаційної оцінки згідно з таблицею:

100...95	Відмінно
94...85	Дуже добре
84...75	Добре
74...65	Задовільно
64...60	Достатньо
Менше 60	Незадовільно
Стартовий рейтинг менше 30 балів	Не допущено

У випадку дистанційної форми навчання у РСО відбуваються наступні зміни:

- Контрольні заходи проводяться дистанційно із застосуванням електронної пошти, Telegram, Zoom та освітньої платформи Moodle, зокрема у вигляді тестових контрольних робіт.
- Максимальну суму вагових балів контрольних заходів протягом семестру R_C встановлюється на рівні 50 балів.
- Допусковий бал до екзамену R_D встановлюється на рівні 30 балів.
- Сума балів R_I , набрана протягом семестру згідно затвердженого РСО, повідомляється на останньому практичному занятті.
- У разі не отримання студентом допускового балу, йому надається можливість підвищити R_I шляхом проведення додаткових контрольних заходів до допускового
- Рівень набуття передбачених навчальною програмою компетентностей визначається на підставі проведених заходів поточного контролю.
- Екзаменаційна оцінка може бути виставлена «автоматом» за формулою шляхом перерахунку стартових балів за 100-бальною шкалою:

$$R = 60 + \frac{40(R_I - R_D)}{R_C - R_D}$$

Переводиться до екзаменаційної оцінки згідно з таблицею

100...95	Відмінно
94...85	Дуже добре
84...75	Добре
74...65	Задовільно
64...60	Достатньо
Менше 60	Незадовільно

Робочу програму навчальної дисципліни (силабус):

Складено доцентом кафедри МА та ТЙ, к.ф-м.н., доцентом Орловським Ігорем Володимировичем
Ухвалено кафедрою математичного аналізу та теорії ймовірностей (протокол № 13 від 19.06.2024р.)

Погоджено Методичною комісією ФМФ (протокол № 10 від 25.06.2024 р.)