

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

«СТОХАСТИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ»

для направления подготовки 02.03.01 – «Математика и компьютерные науки»
(бакалавриат), 6 семестр

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Формирование научного представления о случайных процессах, а также о методах их исследования.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП

Дисциплина «Стохастический анализ» относится к базовой части ОПОП подготовки бакалавров по направлению 02.03.01 – «Математика и компьютерные науки», логически и содержательно связана с другими математическими и естественнонаучными дисциплинами. Курс базируется на общих курсах теории вероятностей и математической статистики, использует методы теории функций. В свою очередь, является основой для ряда дисциплин, (например, стохастических дифференциальных уравнений) как развивающих методы теории случайных процессов, так и использующих эти методы для решения реальных прикладных задач (например, задач актуарной и финансовой математики).

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Освоение дисциплины направлено на формирование следующих профессиональных компетенций: способности

- передавать результат проведенных физико-математических и прикладных исследований в виде конкретных рекомендаций, выраженных в терминах предметной области изучавшегося явления (ПК-6);
- понимать, совершенствовать и применять современный математический аппарат (ПК-2).

4. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Изучаемые разделы: основные понятия теории меры и теории вероятностей, основные определения теории случайных процессов, обзор основных методов теории случайных процессов и важнейших классов случайных процессов, и пр.

Виды учебной работы: лекции, практические занятия, СРС.

5. ВИД АТТЕСТАЦИИ: Текущий контроль успеваемости производится в форме рейтинг-контролей. В конце семестра предусмотрен экзамен.

6. КОЛИЧЕСТВО ЗАЧЕТНЫХ ЕДИНИЦ: Общая трудоемкость дисциплины составляет 5 зачётных единицы, 180 часов.

Составитель доцент каф. ФАиП _____ Л.А. Буланкина

Заведующий кафедрой ФАиП _____ А.А. Давыдов

Председатель

учебно-методической комиссии направления _____ А.А. Давыдов

/ Директор института _____ Н.Н. Давыдов

Дата: _____

Печать института

