


Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф-Рабочая программа дисциплины		

УТВЕРЖДЕНО
решением Ученого совета ФМИАТ
от « 16 » мая 2023 г., протокол № 4/23
Председатель Волков М. А.
« 16 » мая 2023 г.



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина	Пределные теоремы для семимартингалов
Факультет	Математики, информационных и авиационных технологий
Кафедра	Кафедра прикладной математики
Курс	4

Направление (специальность): **01.03.02 Прикладная математика и информатика**

Направленность (профиль/специализация): Имитационное моделирование и анализ данных


Форма обучения: очная

Дата введения в учебный процесс УлГУ: 1 сентября 2023 г.

Программа актуализирована на заседании кафедры: протокол № 10 от 21.05.2024 г.
Программа актуализирована на заседании кафедры: протокол № от 20 г.
Программа актуализирована на заседании кафедры: протокол № от 20 г.

Сведения о разработчиках:

ФИО	Кафедра	Должность, ученая степень, звание
Хрусталеv Сергей Александрович	ПМ	Доцент, к.ф.-м.н.

СОГЛАСОВАНО
Заведующий выпускающей кафедрой прикладной математики
 _____/ <u>Бутов А.А.</u> /_____ Подпись / ФИО «16» мая 2023 г.

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф-Рабочая программа дисциплины		

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:

Целью изучения дисциплины «Пределные теоремы для семимартингалов» является глубокое знакомство студентов с методами теории случайных процессов, связанных с диффузионными процессами, мартингалами, семимартингалами. Достижение этой цели обеспечивает выпускнику получение высшего профессионально профилированного образования и обладание перечисленными ниже общими и предметно-специализированными компетенциями, а также способствуют формированию и развитию уровня мышления, необходимого для решения комплексных задач, возникающих в процессе работы в избранной сфере деятельности.

В процессе обучения решаются следующие **Задачи** дисциплины:

- изучить теорию слабой сходимости вероятностных мер на метрических пространствах,
- усвоить методы оценивания и свойства диффузионных процессов, мартингалов, семимартингалов

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП:

Дисциплина Б1.В.1.ДВ.05.02 «Пределные теоремы для семимартингалов» входит в вариативную часть цикла дисциплин (модулей) Б1 Основной Профессиональной Образовательной Программы бакалавриата по направлению подготовки 01.03.02 Прикладная математика и информатика и является дисциплиной по выбору.

Данная дисциплина базируется на входных знаниях, умениях, навыках и компетенциях студента, полученных им при изучении предшествующих учебных дисциплин, указанных в Приложении к данной рабочей программе (в фондах оценочных средств – далее ФОС, пункт 1).

Результаты освоения дисциплины будут необходимы для дальнейшего процесса обучения в рамках поэтапного формирования компетенций при изучении последующих дисциплин (указаны в ФОС, пункт 1).

3. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОСНОВНОЙ ПРОФЕССИОНАЛЬНОЙ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Код и наименование реализуемой компетенции	Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с индикаторами достижения компетенций
УК-1 Способность осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения поставленных задач	В результате освоения дисциплины студент должен: Знать: теорию слабой сходимости вероятностных мер на метрических пространствах. Уметь: применять методы доказательства сходимости семимартингалов, оценивать их свойства. Владеть: навыками решения задач оценки сходимости семимартингалов к стохастическим процессам.

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф-Рабочая программа дисциплины		

ПК-2 Способность к разработке и применению алгоритмических и программных решений в области системного и прикладного программного обеспечения	В результате освоения дисциплины студент должен: Знать: теорию слабой сходимости вероятностных мер на метрических пространствах. Уметь: применять методы доказательства сходимости семимартингалов, оценивать их свойства. Владеть: навыками решения задач оценки сходимости семимартингалов к стохастическим процессам.
--	---

4. ОБЩАЯ ТРУДОЕМКОСТЬ ДИСЦИПЛИНЫ

4.1. Объем дисциплины в зачетных единицах (всего) 5

4.2. Объем дисциплины по видам учебной работы (в часах)

Вид учебной работы	Количество часов (форма обучения очная)	
	Всего по плану	В т.ч. по семестрам
		8
1	2	3
Контактная работа обучающихся с преподавателем в соответствии с УП	24	24
Аудиторные занятия:	24	24
Лекции	12	12
Семинары и практические занятия	-	-
Лабораторные работы, практикумы	12	12
Самостоятельная работа	120	120
Форма текущего контроля знаний и контроля самостоятельной работы: тестирование, контр. работа, коллоквиум, реферат и др. (не менее 2 видов)	Устный опрос реферат	Устный опрос реферат
Курсовая работа	-	-
Виды промежуточной аттестации (экзамен, зачет)	экзамен	экзамен (36)
Всего часов по дисциплине	180	180

В случае необходимости использования в учебном процессе частично/исключительно дистанционных образовательных технологий в таблице через слеш указывается количество часов работы ППС с обучающимися для проведения занятий в дистанционном формате с применением электронного обучения.

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф-Рабочая программа дисциплины		

4.3. Содержание дисциплины (модуля.) Распределение часов по темам и видам учебной работы:

Форма обучения очная

Название разделов и тем	Всего	Виды учебных занятий				Самостоятельная работа	Форма текущего контроля знаний
		Аудиторные занятия			Занятия в интерактивной форме		
		Лекции	Практические занятия, семинары	Лабораторные работы, практикумы			
1	2	3	4	5	6	7	8
Раздел 1. Введение							
Тема 1.1. Предмет дисциплины. Исторические сведения о развитии этого раздела математики. Роль и место дисциплины «предельные теоремы для семимартингалов» в системе математического образования.	12	1		1		10	Устный опрос, реферат
Раздел 2. Слабая сходимость в метрических пространствах							
Тема 2.1. Различные виды сходимостей, их соотношение.	12	1		1		10	Устный опрос, реферат
Тема 2.2. Свойства слабой сходимости мер, сходимость по распределению.	12	1		1		10	Устный опрос, реферат
Тема 2.3. Слабая сходимость и отображения.	12	1		1		10	Устный опрос, реферат
Тема 2.4. Относительная компактность и плотность семейства вероятностных мер, теорема Прохорова.	12	1		1		10	Устный опрос, реферат
Тема 2.5. Метод характеристических функций.	12	1		1		10	Устный опрос, реферат

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф-Рабочая программа дисциплины		

Раздел 3. Семимартингалы							
Тема 3.1. Семимартингалы с независимыми приращениями.	12	1		1		10	Устный опрос, реферат
Тема 3.2. Триплет характеристик семимартингала.	12	1		1		10	Устный опрос, реферат
Тема 3.3. Интегрируемость характеристик семимартингала.	12	1		1		10	Устный опрос, реферат
Тема 3.4. Процессы с условно независимыми приращениями.	12	1		1		10	Устный опрос, реферат
Тема 3.5. Каноническое представление многомерных семимартингалов.	12	1		1		10	Устный опрос, реферат
Тема 3.6. Диффузионная аппроксимация.	12	1		1		10	Устный опрос, реферат
Контроль	36						
Итого	180	12		12		120	

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Раздел 1. Введение

Тема 1.1. Предмет дисциплины. Исторические сведения о развитии этого раздела математики. Роль и место дисциплины «предельные теоремы для семимартингалов» в системе математического образования.

Раздел 2. Слабая сходимость в метрических пространствах

Тема 2.1. Различные виды сходимостей, их соотношение.

Тема 2.2. Свойства слабой сходимости мер, сходимость по распределению.

Тема 2.3. Слабая сходимость и отображения.

Тема 2.4. Относительная компактность и плотность семейства вероятностных мер, теорема Прохорова.

Тема 2.5. Метод характеристических функций.

Раздел 3. Семимартингалы

Тема 3.1. Семимартингалы с независимыми приращениями.

Тема 3.2. Триплет характеристик семимартингала.

Тема 3.3. Интегрируемость характеристик семимартингала.

Тема 3.4. Процессы с условно независимыми приращениями.

Тема 3.5. Каноническое представление многомерных семимартингалов.

Тема 3.6. Диффузионная аппроксимация.

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф-Рабочая программа дисциплины		

6. ТЕМЫ ПРАКТИЧЕСКИХ И СЕМИНАРСКИХ ЗАНЯТИЙ

Данный вид работы не предусмотрен УП.

7. ЛАБОРАТОРНЫЕ РАБОТЫ, ПРАКТИКУМЫ

1. Различные виды сходимостей, их соотношение.
2. Свойства слабой сходимости мер, сходимость по распределению.
3. Слабая сходимость и отображения.
4. Относительная компактность и плотность семейства вероятностных мер, теорема Прохорова.
5. Метод характеристических функций.
6. Семимартингалы с независимыми приращениями.
7. Триплет характеристик семимартингала.
8. Интегрируемость характеристик семимартингала.
9. Процессы с условно независимыми приращениями.
10. Каноническое представление многомерных семимартингалов.
11. Диффузионная аппроксимация.

8. ТЕМАТИКА КУРСОВЫХ, КОНТРОЛЬНЫХ РАБОТ, РЕФЕРАТОВ

Темы рефератов:

1. Различные виды сходимостей, их соотношение.
2. Свойства слабой сходимости мер, сходимость по распределению.
3. Слабая сходимость и отображения.
4. Относительная компактность и плотность семейства вероятностных мер, теорема Прохорова.
5. Метод характеристических функций.
6. Семимартингалы с независимыми приращениями.
7. Триплет характеристик семимартингала.
8. Интегрируемость характеристик семимартингала.
9. Процессы с условно независимыми приращениями.
10. Каноническое представление многомерных семимартингалов.
11. Диффузионная аппроксимация.

9. ПЕРЕЧЕНЬ ВОПРОСОВ К ЭКЗАМЕНУ (ЗАЧЕТУ)

1. Опциональная σ -алгебра.
2. Локализация.
3. Класс мартингалов M .
4. Класс возрастающих процессов. Свойство доминирования Ленгляра.
5. Класс M_2 .
6. Построение стохастического интеграла.
7. Семимартингалы с независимыми приращениями.
8. Триплет характеристик семимартингала.
9. Гауссовский мартингал.
10. Интегрируемость характеристик семимартингала.


Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф-Рабочая программа дисциплины		

11. Каноническое представление многомерных семимартингалов.
12. Процессы с условно независимыми приращениями.
13. Контигуальность и полная асимптотическая делимость.
14. Интеграл Хелингера.
15. Обобщенный диффузионный процесс.
16. Семимартингалы и квазимартингалы.
17. Процесс плотности.
18. Стохастический интеграл по локальному мартингалу и семимартингалу.
19. Характеристические функции.
20. Прием Крамера-Уолда.
21. Слабая сходимость и отображения.
22. Предельный переход под знаком интеграла.
23. Диффузионная аппроксимация.
24. Применение диффузионной аппроксимации.
25. Диффузионная аппроксимация в векторном случае.
26. Слабая сходимость к распределению точечного процесса с непрерывным компенсатором.
27. Слабая сходимость инвариантных мер

10. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА ОБУЧАЮЩИХСЯ

Форма обучения очная

Название разделов и тем	Вид самостоятельной работы	Объем в часах	Форма контроля
Тема 1.1. Предмет дисциплины. Исторические сведения о развитии этого раздела математики. Роль и место дисциплины «предельные теоремы для семимартингалов» в системе математического образования.	проработка учебного материала, реферат	10	Проверка реферата, устный опрос
Тема 2.1. Различные виды сходимостей, их соотношение.	проработка учебного материала, реферат	10	Проверка реферата, устный опрос
Тема 2.2. Свойства слабой сходимости мер, сходимость по	проработка учебного материала, реферат	10	Проверка реферата, устный

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф-Рабочая программа дисциплины		

распределению.			опрос
Тема 2.3. Слабая сходимость и отображения.	проработка учебного материала, реферат	10	Проверка реферата, устный опрос
Тема 2.4. Относительная компактность и плотность семейства вероятностных мер, теорема Прохорова.	проработка учебного материала, реферат	10	Проверка реферата, устный опрос
Тема 2.5. Метод характеристических функций.	проработка учебного материала, реферат	10	Проверка реферата, устный опрос
Тема 3.1. Семимартингалы с независимыми приращениями.	проработка учебного материала, реферат	10	Проверка реферата, устный опрос
Тема 3.2. Триплет характеристик семимартингала.	проработка учебного материала, реферат	10	Проверка реферата, устный опрос
Тема 3.3. Интегрируемость характеристик семимартингала.	проработка учебного материала, реферат	10	Проверка реферата, устный опрос
Тема 3.4. Процессы с условно независимыми приращениями.	проработка учебного материала, реферат	10	Проверка реферата, устный опрос
Тема 3.5. Каноническое представление многомерных семимартингалов.	проработка учебного материала, реферат	10	Проверка реферата, устный опрос
Тема 3.6. Диффузионная аппроксимация.	проработка учебного материала, реферат	10	Проверка реферата, устный опрос

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф-Рабочая программа дисциплины		

11. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

а) Список рекомендуемой литературы

основная:

1. Круглов, В. М. Случайные процессы в 2 ч. Часть 1. Основы общей теории : учебник для академического бакалавриата / В. М. Круглов. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 276 с. — (Авторский учебник). — ISBN 978-5-534-01748-9. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/433593>
2. Каштанов, В. А. Случайные процессы : учебник и практикум для прикладного бакалавриата / В. А. Каштанов, Н. Ю. Энатская. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 156 с. — (Бакалавр. Прикладной курс). — ISBN 978-5-534-04482-9. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/437567>
3. Вентцель Елена Сергеевна. Теория вероятностей : учебник для вузов / Вентцель Елена Сергеевна. - 10-е изд., стер. - Москва : Академия, 2005. - 572 с.

Дополнительная

1. Семаков С.Л., Элементы теории вероятностей и случайных процессов [Электронный ресурс] / Семаков С.Л. - М. : ФИЗМАТЛИТ, 2011. - 232 с. - ISBN 978-5-9221-1345-8 - Режим доступа: <http://www.studentlibrary.ru/book/ISBN9785922113458.html>
2. Кремер, Н. Ш. Теория вероятностей : учебник и практикум для академического бакалавриата / Н. Ш. Кремер. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 271 с. — (Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-9888-7. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/433670>
3. Пухальский А.А., Большие отклонения стохастических динамических систем [Электронный ресурс]: Теория и приложения. / Пухальский А.А. - М. : ФИЗМАТЛИТ, 2005. - 512 с. - ISBN 5-9221-0660-0 — URL: <http://www.studentlibrary.ru/book/ISBN5922106600.html>
4. Палий, И. А. Теория вероятностей. Задачник : учебное пособие для академического бакалавриата / И. А. Палий. — 3-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 236 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-04641-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/438835>
5. Карлин С. Основы теории случайных процессов / С. Карлин; пер. с англ. В. В. Калашникова; под ред. И. Н. Коваленко. - М. : Мир, 1971. - 536 с.

Учебно-методическая

1. Бутов Александр Александрович. Теория случайных процессов и ее дополнительные главы : учеб. пособие. Ч. 1 : Введение в стохастическое исчисление / Бутов Александр Александрович; УлГУ, ФМИиАТ. - Ульяновск : УлГУ, 2016. - URL <http://lib.ulsu.ru/MegaPro/Download/MObject/1043>
2. Бутов А. А. Теория случайных процессов : учеб. пособие / А. А. Бутов, К. О. Раводин; УлГУ, ФМИИТ. - Ульяновск : УлГУ, 2009. - URL : <http://lib.ulsu.ru/MegaPro/Download/MObject/823/Butov2.pdf>

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф-Рабочая программа дисциплины		

3. Хрусталева С. А. Методические указания для самостоятельной работы студентов по дисциплине «Предельные теоремы для семимартингалов» для студентов бакалавриата по направлению 01.03.02 «Прикладная математика и информатика» / С. А. Хрусталева; УлГУ, Фак. математики, информ. и авиац. технологий. - Ульяновск : УлГУ, 2019. - Загл. с экрана; Неопубликованный ресурс. - Электрон. текстовые дан. (1 файл : 286 КБ). - URL: <http://lib.ulsu.ru/MegaPro/Download/MObject/5547>

Согласовано:

Специалист ведущий НБ УлГУ
Должность сотрудника научной библиотеки

Боброва Н.А.
ФИО


подпись

_____ / _____ 2023
дата

б) Программное обеспечение

1. СПС Консультант Плюс
2. Система «Антиплагиат.ВУЗ»
3. ОС Microsoft Windows
4. MicrosoftOffice 2016
5. «МойОфис Стандартный»

в) Профессиональные базы данных, информационно-справочные системы

1. Электронно-библиотечные системы:

1.1. Цифровой образовательный ресурс IPRsmart : электронно-библиотечная система : сайт / ООО Компания «Ай Пи Ар Медиа». - Саратов, [2023]. – URL: <http://www.iprbookshop.ru>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст : электронный.

1.2. Образовательная платформа ЮРАЙТ : образовательный ресурс, электронная библиотека : сайт / ООО Электронное издательство «ЮРАЙТ». – Москва, [2023]. - URL: <https://urait.ru>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. - Текст : электронный.

1.3. База данных «Электронная библиотека технического ВУЗа (ЭБС «Консультант студента») : электронно-библиотечная система : сайт / ООО «Политехресурс». – Москва, [2023]. – URL: <https://www.studentlibrary.ru/cgi-bin/mb4x>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. – Текст : электронный.

1.4. Консультант врача. Электронная медицинская библиотека : база данных : сайт / ООО «Высшая школа организации и управления здравоохранением-Комплексный медицинский консалтинг». – Москва, [2023]. – URL: <https://www.rosmedlib.ru>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. – Текст : электронный.

1.5. Большая медицинская библиотека : электронно-библиотечная система : сайт / ООО «Букап». – Томск, [2023]. – URL: <https://www.books-up.ru/ru/library/>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. – Текст : электронный.

1.6. ЭБС Лань : электронно-библиотечная система : сайт / ООО ЭБС «Лань». – Санкт-Петербург, [2023]. – URL: <https://e.lanbook.com>. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. – Текст : электронный.

1.7. ЭБС Znanium.com : электронно-библиотечная система : сайт / ООО «Знаниум». - Москва, [2023]. - URL: <http://znanium.com>. – Режим доступа : для зарегистрир. пользователей. - Текст : электронный.

2. КонсультантПлюс [Электронный ресурс]: справочная правовая система. / ООО «Консультант Плюс» - Электрон. дан. - Москва : КонсультантПлюс, [2023].

3. Базы данных периодических изданий:

3.1. eLIBRARY.RU: научная электронная библиотека : сайт / ООО «Научная Электронная Библиотека». – Москва, [2023]. – URL: <http://elibrary.ru>. – Режим доступа : для авториз.

Министерство науки и высшего образования РФ Ульяновский государственный университет	Форма	
Ф-Рабочая программа дисциплины		

– для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата: в печатной форме; в форме электронного документа; в форме аудиофайла; индивидуальные задания и консультации.

В случае необходимости использования в учебном процессе частично/исключительно дистанционных образовательных технологий, организация работы ППС с обучающимися с ОВЗ и инвалидами предусматривается в электронной информационно-образовательной среде с учетом их индивидуальных психофизических особенностей.

Разработчик


подпись

доцент

должность

ХрусталеvС.А.

ФИО