**АННОТАЦИИ РАБОЧИХ ПРОГРАММ ДИСЦИПЛИН (МОДУЛЕЙ)**

ООП ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ – ПРОГРАММЫ МАГИСТРАТУРЫ

Направление подготовки 01.04.02 «Прикладная математика и информатика»

Направленность программы (магистерская программа)

**«Статистический анализ и прогнозирование рисков»**

**Английский язык**

Задачи дисциплины:

-совершенствовать навыки чтения и понимания научной литературы по профессиональной тематике на английском языке;

-помочь развитию логического мышления учащихся, умения выделить основную и второстепенную информацию, аргументировать и резюмировать прочитанное;

-научить студентов магистратуры принципам написания реферата, академического эссе и аннотаций профессионального текста на английском языке;

-обучить представлению результатов исследования в виде презентаций и дискуссий профессиональной направленности на английском языке;

- совершенствовать навыки понимания публичной речи;

- познакомить студентов магистратуры с современными требованиями цитирования, оформления ссылок на источники и библиографического списка в собственных научных работах и статьях на английском языке;

- повысить общеобразовательный, культурный и политический кругозор студентов.

**Правоведение**

Содержание дисциплины охватывает круг вопросов, связанных с теорией государства и права, юридической ответственностью, конституционное государственное право, административное право, гражданское право и трудовое право. Целью курса является формирование у студентов общего представления о правовой науке, о правах и свободах человека и гражданина, овладение основными отраслями права, выработка навыков пользования нормативными актами. Задачи курса: ознакомить студентов с основными принципами правоведения, сформировать у них правовое сознание; привить им навыки анализа государственно-правовых явлений, в повышении уровня их правовой культуры в целом, научить составлению и использованию нормативных и правовых документов, относящихся к будущей профессиональной деятельности, умению предпринимать необходимые меры по восстановлению нарушенных прав.

**Суперкомпьютерное моделирование и технологии**

Суперкомпьютерное моделирование является определяющим фактором развития научно-технического прогресса. Решение прорывных задач современности невозможно без использования суперкомпьютеров. Курс посвящен изучению базовых основ суперкомпьютерного моделирования. В курсе рассматриваются вопросы современного состояния развития суперкомпьютерных технологий, включая суперкомпьютерные аппаратно-программные платформы, математические модели решаемых на суперкомпьютерных задач и алгоритмов их решения, параллельные технологии реализации таких задач на суперкомпьютерах. Неотъемлемой частью курса является выполнение студентами практических заданий на суперкомпьютерах МГУ и высокопроизводительных вычислительных системах ряда научных организаций. Особенностью курса является широкое участие в его проведении специалистов из различных научных областей, связанных с применением суперкомпьютерных технологий. Этот подход позволяет обеспечить квалифицированный междисциплинарный подход, являющийся основой суперкомпьютерного моделирования.

**Современная философия и методология науки**

Целью дисциплины является формирование у слушателя целостного видения науки, понимания им специфики научной деятельности, характера исторического развития науки, ее взаимодействия с другими сферами человеческой деятельности. В курсе представлены основные темы философии науки, являющейся одной из важнейших составляющих современной философии. Рассматриваются основные положения учения о науке как познавательной деятельности, как социальном институте, как виде человеческой деятельности, как элементе культуры.

**История и методология прикладной математики и информатики**

В рамках курса рассматриваются основные факты, события и идеи многовековой истории развития математики в целом и одного из ее важнейших направлений – «прикладной» - вычислительной математики, зарождения и развития вычислительной техники и программирования. Показывается роль математики и информатики в истории развития цивилизации. Дается характеристика научного творчества наиболее выдающихся ученых – генераторов научных идей. Особое внимание уделяется развитию математики и информатики в России.

Курс нацелен на формирование математического мировоззрения будущих магистров, выстраивание общего контекста математического мышления как культурной формы деятельности, определяемой как структурными особенностями математического знания, так и местом математики в системе наук.

**Анализ риска**

Курс направлен на формирование у студентов понимания общих подходов к постановке и решению задач актуарной математики, относящихся к области теории риска. Подробно обсуждаются основные принципы формирования страховых портфелей и тарифов в зависимости от рисковых ситуаций страховщика. Исследуются вопросы, связанные с нахождением вероятности разорения и ее асимптотических аппроксимаций. Особое внимание уделяется факторизационной статической модели страхования, в основе которой лежит разложение индивидуальных исков страхователей на независимые компоненты. Подобный подход позволяет существенно расширить и обобщить классические постановки прикладных актуарных задач в целях получения адекватных решений

**Анализ временных рядов**

В рамках курса рассматриваются основные классические и современные методы анализа временных рядов. Среди рассматриваемых методов: линейный и нелинейный регрессионный анализ, линейные стационарные модели временных рядов авторегрессии и скользящего среднего, модели рядов с гетероскадастичностью, модели многомерных нестационарных временных рядов, теория коинтеграции, Байесовские модели временных рядов, теория копул, применение нейронных сетей для анализа временных рядов. Весь теоретический материал курса сопровождается выполнением программ на языке R и интерактивными примерами с анимацией, позволяющим улучшить усвоение материала. Все материалы курса: тексты лекции, интерактивные фреймы с анимацией находятся на факультетском сервере и доступны при наличии доступа в сеть факультета. Ссылка на вводную лекцию и через нее доступ ко всем материалам курса [http://pc586s.cs.msu.ru:3838/Doynikov/Time\_Series\_Analysis/Lecture0.html](http://pc586s.cs.msu.ru:3838/Doynikov/Time_Series_Analysis/Lecture0.html.%20)

**Современные методы обработки сигналов и изображений**

В рамках курса рассматриваются различные задачи анализа и обработки сигналов и изображений. Основное внимание уделяется статистическим методам анализа временных выборок, методам спектрального Фурье-анализа, методам вейвлет-анализа. Излагается теория линейной фильтрации. Обсуждаются методы подавления шума и сжатия данных. Отдельное внимание уделяется методам решения обратных задач обработки и анализа изображений. Излагаются элементы теории преобразования Радона и методы реконструкции томографических изображений.

**Методы интеллектуального анализа данных**

В курсе рассматриваются современные алгоритмы и методы интеллектуального анализа данных для решения поиска ассоциативных правил, тематического моделирования, кластеризации, классификации и прогнозирования. В первой части курса, посвященной изучению методов обучения без учителя, рассматриваются: задача поиска ассоциативных правил и основные применяемые для этого алгоритмы - apriori и fp-tree; задача выявления скрытых структур в данных на основе тематического моделирования, в частности метод главных компонент, кластеризация переменных, самоорганизующиеся отображения, неотрицательная матричная факторизация; задача кластеризации данных на основе иерархических, метрических и вероятностных методов. Также обсуждаются методы предобработки данных для эффективного решения данных задач. Вторая часть курса посвящена изучению методов прогнозирования, используемых в системах интеллектуального анализа данных, связанные с этим проблемы, алгоритмы и терминология. Рассматриваются следующие вопросы: понятие проклятия размерности и проблема переобучения; вопросы и критерии для оценки и выбора моделей с использованием валидации и кросс-валидации; алгоритмы и методы необходимой предобработки данных для решения задачи прогнозирования. Далее рассматриваются наиболее популярные и современные алгоритмы и модели машинного обучения и прикладной статистики для решения задач прогнозирования в системах интеллектуального анализа данных, в частности: линейные регрессионные модели; пошаговые методы отбора переменных, регуляризация, преобразование пространства признаков для решения задач прогнозирования; нелинейные регрессионные модели, сплайны, локальная взвешенная регрессия; нейронные сети, их типовые архитектуры RBF и MLP, алгоритмы ранней остановки обучения, методы оптимизации для обучения нейронных сетей; а метод опорных векторов для бинарной классификации, виды ядерных функций, алгоритмы оптимизации для обучения модели на основе опорных векторов; деревья решений, алгоритмы и критерии поиска разбиения при их построении, вопросы управление процессом роста и обрубания ветвей деревьев для борьбы с переобучением; ансамбли моделей на основе бустинга и бэгинга, случайный лес и градиентный бустинг. Демонстрация примеров использования изучаемых методов и процедур проводится преподавателями на каждой лекции и каждом семинаре. Также данная дисциплина поддерживается практическими заданиями (практическими самостоятельными работами), позволяющими студентам овладеть навыками построения прогнозных и описательных моделей интеллектуального анализа данных, а также навыками анализа результатов и оценки работы реализованных моделей. Обсуждение практических самостоятельных работ, а также их защита, проводятся на семинарах. Дополнительно, на семинарах студенты выполняют небольшие практические задания по тематике последней на момент данного семинара лекции. Темы семинаров соответствуют темам лекций. Семинары направлены на укрепление знаний, полученных на лекциях.

**Прикладной многомерный статистический анализ**

В рамках данного курса будут рассмотрены основные задачи многомерного статистического анализа. А именно, будет дано описание математических моделей и методов таких разделов математической статистики как корреляционный анализ, регрессионный анализ, дисперсионный анализ, дискриминантный анализ, кластерный анализ. Предложенные методы и алгоритмы иллюстрируются с помощью более-менее реальных примеров.

**Прикладные задачи теории случайных процессов**

В рамках курса рассматриваются основные понятия и методы теории случайных процессов, которые используются в качестве математических моделей широкого круга явлений. Существенно используются многие разделы курсов «теория вероятностей и математическая статистика», «математический анализ», «алгебра и геометрия», «функциональный анализ». Особое внимание уделяется постановкам и методам решения задач для основных классов случайных процессов, в том числе: урновые модели; геометрическое, равномерное, показательное распределения, а также формированию умений и навыков использовать математический аппарат теории случайных процессов для решения прикладных задач.

**Оценки точности асимптотических вероятностных моделей**

Одним из ключевых моментов при построении математических моделей стохастических ситуаций является выбор модели для описания распределения имеющихся данных. При этом у выбранной модели желательно наличие не только хорошего согласия с эмпирическими данными, но и некоторого теоретического обоснования. Такие теоретические обоснования могут давать разнообразные предельные теоремы теории вероятностей, позволяющие в качестве модельного распределения выбирать его асимптотическую  аппроксимацию, возникающую в той или иной предельной теореме.  Однако для выбора адекватной асимптотической аппроксимации необходимо уметь оценивать её точность, то есть скорость сходимости в соответствующей предельной теореме.

Данный курс как раз и посвящен построению оценок скорости сходимости в предельных теоремах для сумм независимых случайных величин, в том числе - в классической центральной предельной теореме, занимающей центральное место в теории вероятностей.

**Асимптотические методы математической статистики**

В рамках курса рассматриваются различные задачи асимптотической статистики. Основное внимание уделяется статистическим методам анализа и обработки реальных статистических данных, в случае когда их число велико. Излагаются основы асимптотической статистки и многомерного анализа. Обсуждаются современные методы сокращения данных без потери существенной информации. Отдельное внимание уделяется методам решения задач проверки гипотез и оценивания неизвестных параметров. Излагаются элементы теории аппроксимации распределений статистик асимптотическими разложения типа Эджворта и Корниша-Фишера.

**Вероятностные модели финансовой математики**

Целью дисциплины является выработка у студентов глубокого понимания основных характеристик современных финансовых рынков и современных финансовых инструментов и принципов торговли этими инструментами и инвестирования.

Задачами дисциплины являются изучение математических методов моделирования динамики цен акций и производных финансовыхинструментов (опционов) в дискретном и непрерывном времени, включая знаменитую теорию Блэка-Шоулса арбитражного ценообразования опционов, теорию инвестиционных портфелей Марковица, теорию кредитных ценных бумаг (кредитные дефолтные свопы), а также методов оценки рисков.

**Математическое и статистическое программирование**

В курсе рассматриваются основные вопросы программирования для решения задач статистического анализа данных с использованием аналитической платформы SAS. В первой части курса, посвященной обучению программированию для решения задач подготовки данных и формирования отчетности, рассматриваются: основные принципы работы шага обработки данных; работа со структурированными наборами данных и массивами; форматы и типы данных языка SAS Base; процедуры преобразования форматов и типов; работа с внешними сложно структурированными наборами данных; алгоритмы и методы для организации поиска по ключу с помощью индексов, форматов, хэш-объектов; методы разработки и использования пользовательских процедур и функций; программирование с использованием макросов, макропеременных и макроподстановок; использованием языка SQL; формирование отчетов и работа подсистемой вывода; графические возможности и процедуры. Вторая часть курса посвящена изучению методов разработки программ для статистического анализа данных с использованием соответствующих библиотек аналитической платформы SAS. Рассматриваются следующие вопросы: процедуры и методы для проверки статистических гипотез; модели и процедуры для дисперсионного анализа данных; построение линейных регрессионных моделей; проблема мультиколлинеарности; методы пошагового отбора переменных, регуляризации, преобразования пространства признаков; процедуры поиска главных компонент и кластеризации переменных; процедуры и инструменты для поиска выбросов; процедуры построения нелинейных регрессий; анализ таблиц сопряженности; логистическая регрессия; обобщенные линейные модели, пуассоновская и гамма регрессии; методы cравнения и оценки моделей на тестовом наборе данных. Демонстрация примеров использования изучаемых методов и процедур проводится преподавателями на каждой лекции и каждом семинаре. Также данная дисциплина поддерживается практическими заданиями (практическими самостоятельными работами), позволяющими студентам овладеть навыками написания программ для статистической обработки данных, а также навыками анализа результатов работы реализованных алгоритмов. Обсуждение практических самостоятельных работ, а также их защита, проводятся на семинарах. Дополнительно, на семинарах студенты выполняют небольшие практические задания по тематике последней на момент данного семинара лекции.