

ДЕРЖАВНИЙ ТОРГОВЕЛЬНО-ЕКОНОМІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ

СИСТЕМА УПРАВЛІННЯ ЯКІСТЮ

Система забезпечення якості освітньої діяльності та якості вищої освіти
сертифікована на відповідність ДСТУ ISO 9001:2015 / ISO 9001:2015

Кафедра статистики та економетрії

ЗАТВЕРДЖЕНО

вченою радою ДТЕУ

(пост. П. 10 від « 30 » 03 2023 р.)

Ректор



Анатолій МАЗАРАКІ

**ТЕОРІЯ ЙМОВІРНОСТЕЙ ТА МАТЕМАТИЧНА
СТАТИСТИКА/
PROBABILITY THEORY AND MATHEMATICAL
STATISTICS**

**ПРОГРАМА /
COURSE SUMMARY**

Київ 2023

**Розповсюдження і тиражування без офіційного дозволу ДТЕУ
заборонено**

Автори: В.В. РЯЗАНЦЕВА, кандидат фізико-математичних наук,
доцент, С.С. КАРТАШОВА, доктор біол. наук, канд. фіз. –
матем. наук, професор, С.В. БІЛОУСОВА, канд. фіз. –
матем. наук, доцент

Розглянуто та затверджено на засіданні кафедри статистики та
економетрії 8 лютого 2023р., протокол № 12

Рецензенти: О.К. ЩЕТІНІНА, доктор фіз. – матем. наук, професор,
зав. кафедри вищої та прикладної математики,
В.В.КОЗЛОВ, кандидат технічних наук, доцент кафедри
комп'ютерних наук та інформаційних систем

**ТЕОРІЯ ЙМОВІРНОСТЕЙ ТА МАТЕМАТИЧНА
СТАТИСТИКА/
PROBABILITY THEORY AND MATHEMATICAL
STATISTICS**

**ПРОГРАМА /
COURSE SUMMARY**

ВСТУП

Програма дисципліни «Теорія ймовірностей та математична статистика» призначена для здобувачів першого рівня вищої освіти ОС «Бакалавр», галузі знань 12 «Інформаційні технології», спеціальності 126 «Інформаційні системи та технології».

Програму підготовлено відповідно до вимог Стандарту вищої освіти України та відповідної освітньо-професійної програми підготовки бакалаврів.

Програма складається з таких розділів:

1. Мета, завдання та предмет дисципліни.
2. Передумови вивчення дисципліни як вибіркової компоненти освітньої програми.
3. Результати вивчення дисципліни.
4. Зміст дисципліни.
5. Список рекомендованих джерел.

1. МЕТА, ЗАВДАННЯ ТА ПРЕДМЕТ ДИСЦИПЛІНИ

Метою вивчення дисципліни «Теорія ймовірностей та математична статистика» є формування базових знань достатніх для адекватного застосування теоретико - ймовірнісних методів та використання моделювання випадкових процесів при розв'язанні конкретних економічних задач прикладного характеру, а також забезпечення неперервності освіти.

Завданням вивчення дисципліни «Теорія ймовірностей та математична статистика» є:

- навчити обчислювати ймовірності подій, користуючись різними означеннями ймовірностей та стандартними формулами;
- ознайомити з основними дискретними та неперервними розподілами;
- вміти знаходити числові характеристики випадкових величин; ознайомити зі стандартними задачами математичної статистики;
- навчити будувати точкові та інтервальні оцінки невідомих параметрів в задачах параметричної та непараметричної статистики;
- навчити здійснювати перевірку статистичних гіпотез та інтерпретувати отримані результати;

- здобути практичні навички побудови математико-статистичних моделей випадкових явищ та процесів, навчити користуватися сучасними прикладними пакетами статистичних програм, що призначені для аналізу статистичної інформації.

Предметом вивчення дисципліни є математичні моделі, що описують випадкові процеси та явища.

2. ПЕРЕДУМОВИ ВИВЧЕННЯ ДИСЦИПЛІНИ ЯК ВИБІРКОВОЇ КОМПОНЕНТИ ОСВІТНЬОЇ ПРОГРАМИ.

Знання та вміння, набуті протягом вивчення шкільного предмету «Математика».

3. РЕЗУЛЬТАТИ ВИВЧЕННЯ ДИСЦИПЛІНИ

Дисципліна «Теорія ймовірностей та математична статистика» як обов'язкова компонента освітньо-професійної програми, забезпечує оволодіння студентами загальними та фаховими компетентностями і досягнення ними програмних результатів навчання за відповідною освітньо-професійною програмою:

Інформаційні системи та технології (ОС бакалавр)

Номер в освітній програмі	Зміст компетентності	Номер теми, що розкриває зміст компетентності
<i>Загальні компетентності за освітньо-професійною програмою</i>		
КЗ 1	Здатність до абстрактного мислення, аналізу та синтезу.	1,2,3,4,5,6,7,8,9,10, 11, 12, 13, 14
КЗ 2	Здатність застосовувати знання у практичних ситуаціях.	9, 10, 11, 12, 13, 14
КЗ 5	Здатність вчитися і оволодівати сучасними знаннями.	1,2,3,4,5,6,7,8,9,10, 12, 14
<i>Фахові компетентності за освітньо-професійною програмою</i>		
КС 11	Здатність до аналізу, синтезу і оптимізації інформаційних систем та технологій з використанням математичних моделей і методів.	10, 11, 12, 13, 14
КС 13	Здатність проводити обчислювальні експерименти, порівнювати результати експериментальних даних і отриманих рішень.	9, 10, 11, 12, 13, 14
<i>Програмні результати навчання за освітньо-професійною програмою</i>		
ПР 1.	Знати лінійну та векторну алгебру, диференціальне та інтегральне числення, теорію функцій багатьох змінних, теорію рядів, диференціальні рівняння для функції	1,2,3,4,5,6,7,8,9,10, 11, 12, 13, 14

	однієї та багатьох змінних, операційне числення, теорію ймовірностей та математичну статистику в обсязі, необхідному для розробки та використання інформаційних систем, технологій та інфокомунікацій, сервісів та інфраструктури організації.	
--	--	--

4 . ЗМІСТ ДИСЦИПЛІНИ

Тема 1. Основні поняття теорії ймовірностей

Стохастичний експеримент його роль та місце при моделюванні соціально-економічних та природничих процесів. Предмет теорії ймовірностей. Частотна інтерпретація ймовірності, статистична стійкість. Математична модель стохастичного експерименту. Простір елементарних подій. Алгебри та σ - алгебри випадкових подій. Елементи теорії міри. Аксиоматичний підхід до побудови ймовірнісного простору (аксіоматика А.М. Колмогорова). Ймовірність на дискретному просторі елементарних наслідків стохастичного експерименту. Теорема суми для n випадкових подій, визначених на одному ймовірнісному просторі.

Список рекомендованих джерел:

Основний: 1, 2, 3, 4

Додатковий: 1

Інтернет-ресурси: 1, 2

Тема 2. Класичний, статистичний та геометричний підходи до означення ймовірностей.

Класичне означення ймовірностей. «Схема урн» для визначення загального числа елементарних наслідків в стохастичних експериментах, які задовольняють класичному означенню: вибір з поверненням та без повернення. Елементи комбінаторного аналізу: основне правило комбінаторики, принципи редукції та незалежного вибору, основні комбінаторні формули (число розміщень, сполучень і перестановок). Обчислення класичних ймовірностей з використанням функцій COMBIN та FACT в середовищі MS Excel. Гіпергеометричний розподіл та його узагальнення. Статистичне означення ймовірностей та їх властивості. Поняття про міру Лебега. Геометричне означення ймовірностей. Задача про зустріч. Практичне застосування різних підходів до побудови ймовірнісного простору: задача Бюффона, парадокс Бертрана. Візуалізація результатів побудови ймовірнісного простору засобами MS Office.

Список рекомендованих джерел:

Основний: 1, 3, 4

Додатковий: 1,3

Тема 3. Умовна ймовірність та поняття про незалежність подій.

Формули повної ймовірності та Байєсса.

Умовна ймовірність та теорема добутку для залежних подій. Поняття попарної незалежності випадкових подій. Незалежність випадкових подій у сукупності та теорема добутку для них. Повна група подій, або гіпотез. Формула повної ймовірності та формули Байєсса. Приклади розв'язання та оформлення рішення типових задач в середовищі MS Excel. Принципи використання байєсовського підходу при послідовній процедурі прийняття рішень.

Список рекомендованих джерел:

Основний: 1, 2, 3, 4

Додатковий: 1,2,3

Інтернет-ресурси: 1, 2

Тема 4. Моделі повторних випробувань. Граничні теореми

Муавра-Лапласа, Бернуллі та Пуассона.

Модель незалежних повторних випробувань як прямий добуток ймовірнісних просторів. Випробування за схемою Бернуллі. Розподіл числа успіхів при проведенні n незалежних випробувань. Біноміальний розподіл в середовищі MS Excel: функція BINOM.DIST ($B(n,p)$). Найвірогідніше число успіхів та його ймовірність. Наближені методи обчислення біноміальних ймовірностей та їх точність. Локальна теорема та інтегральна теорема Муавра-Лапласа. приклади задач та розрахунки за допомогою функції NORM.DIST в MS Excel. Теорема Бернуллі для оцінки дійсної ймовірності через статистичну частоту. Приклади використання при визначенні мінімально достатнього обсягу вибірових досліджень із залученням ППП EPI-INFO. «Рідкісні» події. Формула Пуассона: приклади задач та розрахунки за допомогою функції POISSON.DIST в MS Excel. Номер першого успішного випробування в серіях незалежних стохастичних експериментах за схемою Бернуллі. Геометричний розподіл.

Список рекомендованих джерел:

Основний: 1, 2, 3, 4

Додатковий: 1,2,3

Інтернет-ресурси: 1,

Тема 5. Дискретні випадкові величини, їх закони розподілу та числові характеристики.

Означення випадкових величин та їх класифікація. Закон розподілу дискретної випадкової величини. Таблиця та полігон розподілу, їх представлення в середовищі MS Excel. Числові характеристики розподілу ймовірностей: математичне очікування, дисперсія, середнє квадратичне відхилення, початкові та центральні моменти, їх властивості та способи обчислення засобами MS Excel з використанням пакету «Аналіз даних». Основні закони дискретних розподілів та їх числові характеристики (вироджений, гіпергеометричний розподіл, від'ємний біноміальний розподіл, розподіл Бернуллі, розподіл Пуассона, геометричний розподіл): формальне визначення та графічне представлення в MS Excel за допомогою функцій BINOM.DIST, NEGBINOM.DIST, HYPGEOM.DIST та ін. Приклади застосування дискретних розподілів в типових фахових задачах.

Список рекомендованих джерел:

Основний: 1, 2, 3, 4

Додатковий: 1,2,3

Інтернет-ресурси: 1, 2

Тема 6. Неперервні та абсолютно неперервні випадкові величини. Функція та щільність розподілу ймовірностей. Числові характеристики.

Означення неперервних випадкових величин. Функція розподілу ймовірностей випадкової величини та її властивості. Поняття про інтеграл Лебега-Стільтьєсса. Абсолютно неперервні випадкові величини. Щільність розподілу та її властивості. Перетворення випадкових величин. Щільність розподілу функцій від абсолютно неперервних випадкових величин. Числові характеристики абсолютно неперервних випадкових величин та їх властивості. Характеристична та виробляюча функції. Квантилі. Приклади розв'язання типових задач на побудову функції та щільності розподілу, обчислення їх характеристик засобами MS Excel.

Список рекомендованих джерел:

Основний: 1, 2, 3

Додатковий: 1,3

Інтернет-ресурси: 1

Тема 7. Найважливіші абсолютно неперервні розподіли, їх властивості та числові характеристики.

Рівномірний закон розподілу ймовірностей та його числові характеристики. Показниковий (експоненціальний) закон розподілу. Властивість відсутності післядії. Гамма-розподіл. Нормальний закон розподілу ймовірностей, його стандартне представлення та правило трьох σ . Розподіл Вейбулла. Логарифмічно-нормальний розподіл. Візуальний супровід розв'язання типових задач з використанням функцій RAND, EXPON.DIST, GAMMA.DIST, NORM.DIST, PHI, WEIBULL.DIST, LOGNORM.DIST в середовищі MS Excel.

Список рекомендованих джерел:

Основний: 1, 2, 3, 4

Додатковий: 1,2,3

Інтернет-ресурси: 1, 2

Тема 8. Випадкові вектори та закони їх розподілів: сумісні, маргінальні, умовні.

Випадкові вектори та сумісний закон розподілу ймовірностей його компонент. Маргінальні функції розподілу компонент випадкового вектора. Дискретні та абсолютно неперервні розподіли. Маргінальні щільності розподілу компонент випадкового вектору. Умовні закони розподілу ймовірностей випадкового вектору. Системи незалежних випадкових величин. Умовні та маргінальні числові характеристики. Коваріаційна та кореляційна матриця. Розподіли Хі-квадрат, Стьюдента та Фішера, їх зв'язок зі стандартним нормальним розподілом. Багатовимірний нормальний розподіл. Біржовий парадокс. Приклади розв'язання типових задач засобами MS Excel.

Список рекомендованих джерел:

Основний: 1, 4

Інтернет-ресурси: 2

Тема 9. Випадкові послідовності. Граничні теореми.

Нерівності Маркова та Чебишева. Збіжність послідовностей випадкових величин за ймовірністю та майже напевно. Закони великих чисел та умови їх виконання. Слабка збіжність чи збіжність за розподілом. Центральна гранична теорема. Теорема Ляпунова для послідовностей незалежних однаково розподілених випадкових величин. Застосування граничних теорем при формуванні теоретичної бази математичної статистики.

Список рекомендованих джерел:

Основний: 1, 2, 3, 4

Додатковий: 1,2

Інтернет-ресурси: 1

Тема 10. Елементи теорії випадкових процесів та теорії масового обслуговування.

Визначення випадкового процесу та його характеристики. Стационарні та ергодичні випадкові процеси. Функція кореляції та її властивості. Гауссовські випадкові процеси. Марківські процеси. Ланцюги Маркова з дискретним часом. Визначення та класифікація станів за асимптотичною властивістю перехідних ймовірностей. Ланцюги Маркова з неперервним часом. Диференціальні рівняння Колмогорова. Граничні (фінальні) ймовірності станів. Час переходу з одного стану в інший для ланцюгів Маркова з неперервним часом. Процеси загибелі та розмноження. Поняття про випадковий потік подій. Найпростіший потік та пуассонівський процес. Основні поняття теорії масового обслуговування. Марківські системи масового обслуговування. Системи масового обслуговування з відмовами. Поняття про метод статистичних випробувань (метод Монте-Карло).

Список рекомендованих джерел:

Основний: 3

Інтернет-ресурси: 2

Тема 11. Основні поняття математичної статистики: вибіркові спостереження та вибіркові оцінки.

Основні положення вибіркового методу. Вибірковий розподіл. Емпірична функція розподілу та гістограма. Вибіркові моменти. Статистичні оцінки та їх властивості. Збіжність статистичних оцінок - емпіричних характеристик за даними спостережень до теоретичних аналогів. Властивості емпіричної функції розподілу. Властивості гістограми. Властивості вибірових моментів. Груповані дані вибірових спостережень. Застосування модуля «Описові статистики» пакету «Аналіз даних» в середовищі MS Excel при обчисленні статистичних оцінок.

Список рекомендованих джерел:

Основний: 1, 2, 3, 4

Додатковий: 1

Інтернет-ресурси: 1

Тема 12. Методи параметричної та непараметричної оцінки параметрів.

Точкові оцінки щодо параметричної сукупності розподілів. Методи знаходження оцінок: метод моментів та максимальної вірогідності. Порівняння точкових оцінок. Інтервальні оцінки. Загальний алгоритм побудови довірчих границь (інтервальних оцінок) певного рівня значущості для точкових оцінок. Інтервальні оцінки для нормальної статистичної моделі, їх практична побудова для наявних даних статистичних спостережень за допомогою функцій CONFIDENCE.NORM та CONFIDENCE.T в середовищі MS Excel.

Список рекомендованих джерел:

Основний: 1, 3, 4

Інтернет-ресурси: 1

Тема 13. Методи перевірки статистичних гіпотез.

Загальний алгоритм перевірки статистичних гіпотез. Типи помилок при перевірці гіпотез та потужність критерію. Критерії узгодженості: критерій Колмогорова-Смірнова та Пірсона. Перевірка гіпотез про однорідність та незалежність. Критерій Стьюдента щодо перевірки гіпотез про значення середніх для нормальної статистичної моделі у випадку рівних (нерівних) дисперсій. Критерій χ^2 -квадрат про єдину дисперсію для нормальної статистичної моделі. Критерій Фішера про рівність (нерівність) двох дисперсій для нормальної статистичної моделі. Перетворення Фішера для перевірки гіпотез про взаємну незалежність. Основи однофакторного та двофакторного дисперсійного аналізу: групові, між групові середні та дисперсії, коефіцієнт варіації та інформативності. Непараметричні критерії перевірки статистичних гіпотез: медіанний, пар, знаків. Коефіцієнти рангової кореляції Спірмена та Кендала. Розв'язання типових задач на перевірку статистичних гіпотез щодо наявних даних спостережень із застосуванням пакету «Аналіз даних» в середовищі MS Excel.

Список рекомендованих джерел:

Основний: 1, 2, 4

Додатковий: 1

Тема 14. Елементи регресійного аналізу. Поняття про факторний та кластерний аналіз даних статистичних спостережень.

Основи однофакторного та двофакторного дисперсійного аналізу: групові, між групові середні та дисперсії, коефіцієнт варіації та інформативності.

Регресійні моделі як інструмент аналізу і прогнозуванню економічних явищ. Парна лінійна та нелінійна регресія: побудова інтервальних оцінок та перевірка моделі на адекватність даним спостережень за допомогою пакета «Аналіз даних» в середовищі MS EXCEL. Множинна лінійна регресія. Основні положення та сфери застосування факторного та кластерного аналізу. Особливості практичного застосування пакетів прикладних статистичних програм (Statistica, Statgraphic, Epi-Info тощо) та модуля «Аналіз даних» в середовищі MS EXCEL при аналізі даних спостережень.

Список рекомендованих джерел:

Основний: 3, 4

Додатковий: 1

5. СПИСОК РЕКОМЕНДОВАНИХ ДЖЕРЕЛ

Основний

1. Кушлик-Дивульська О.І., Горбачук В.М. *Теорія ймовірностей та математична статистика: підручник. Київ: КПІ імені Ігоря Сікорського, 2023. 351 с.*
2. Жалдак М.І., Кузьміна Н.М., Михалін Г.О. *Теорія ймовірностей і математична статистика: Підручник для студентів фізико-математичних та інформатичних спеціальностей педагогічних університетів. Видання четверте, доповнене. Київ: НПУ імені М.П. Драгоманова, 2020. 750 с.*
3. Вигоднер І.В., Білоусова Т.П., Ляхович Т.П. *Теорія ймовірностей та математична статистика: навчальний посібник для студентів денної і заочної форми навчання. Херсон: «ОЛДІ-ПЛЮС», 2019. 336 с.*
4. Бакун В.В. *Теорія ймовірностей, випадкові процеси та математична статистика: підручник. Київ : КПІ ім. Ігоря Сікорського, 2022. – 286 с.*

Додатковий

1. Швець В. Т. *Теорія ймовірностей, математична статистика та випадкові процеси: навчальний посібник. Одеса: ОНТУ, 2021 - 234 с.*
2. Селезньова Н.П., Рудик Т.О., Суліма О.В., Киричук Ю.В., Назаренко Н.М. та інші. *Спеціальні питання вищої математики. Елементи теорії ймовірностей. Теорія і практикум: навч. посіб. Київ: КПІ ім. Ігоря Сікорського, 2021. 78 с.*

3. Ємець О. О., Парфьонова Т.О Теорія ймовірностей і математична статистика (Частина 1): навчально-методичний посібник для самостійного вивчення навчальної дисципліни студентами денної форми навчання спеціальності 122 Комп'ютерні науки освітня програма «Комп'ютерні науки» ступеня бакалавра. Полтава: ПУЕТ, 2023. 55 с.

Інтернет-ресурси

1. Пістунів І.М., Турчанінова І.Ю. Теорія ймовірності та математична статистика для економістів. З елементами електронних таблиць: Навч. Посібн. Дніпро: НТУ «ДП», 2023. 174 с. URL: http://pistunovi.inf.ua/TU_ma_MC2.pdf.
2. Покровський Є.О, Покровський С.Є., Савчук О.В.. Теорія ймовірностей і математична статистика = Theory of Probability and Mathematical Statistics [Електронний ресурс] : навч. посіб. для студ. спеціальностей 121 «Інженерія програмного забезпечення», 126 «Інформаційні системи та технології» Київ: КПІ ім. Ігоря Сікорського, 2021. 231 с. URL: https://ela.kpi.ua/bitstream/123456789/41905/1/TPMS_Pokrovskiyi_Savchuk.pdf.

**Примітка. Курсивом позначені джерела, наявні в бібліотеці КНТЕУ*