Минобрнауки России

Бузулукский гуманитарно-технологический институт (филиал)

федерального государственного бюджетного образовательного учреждения

высшего образования

**Оренбургский государственный университет**

Кафедра физики, информатики и математики

**Методические указания по освоению**

ДИСЦИПЛИНЫ

*«Б.1.Б.10.3 Теория вероятностей и математическая статистика»*

Уровень высшего образования

БАКАЛАВРИАТ

Направление подготовки

*38.03.01 Экономика*

(код и наименование направления подготовки)

*Финансы и кредит*

(наименование направленности (профиля) образовательной программы)

Тип образовательной программы

*Программа академического бакалавриата*

Квалификация

*Бакалавр*

Форма обучения

*Заочная*

Бузулук 2018

Теория вероятностей и математическая статистика: методические указания для обучающихся по освоению дисциплины / Л.Г. Шабалина; Бузулукский гуманитарно-технологический институт(филиал) ОГУ.– Бузулук : БГТИ (филиал) ОГУ, 2018.

Составитель Л.Г. Шабалина

Методические указания предназначены для студентов заочной формы обучения направления подготовки 38.03.01 Экономика.

Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины являются приложением к рабочей программе по дисциплине Теория вероятностей и математическая статистика.

|  |  |
| --- | --- |
|  |  |

#

Цель настоящего методического пособия – помочь студентам в освоении дисциплины «Теория вероятностей и математическая статистика».

Цельосвоения дисциплины: формирование теоретических знаний о массовых случайныхявлениях и присущих им закономерностях, а также практических навыков применения методов, приемов и способов научного анализа данных для определения обобщающих эти данные характеристик.

**Задачи:**

* освоение методов исследования закономерностей массовых случайных явлений и процессов;
* освоение математических методов систематизации и обработки статистических данных;
* освоение современных статистических пакетов, реализующих алгоритмы математической статистики;
* приобретение навыков содержательной интерпретации результатов.

Студенты заочной формы обучения изучают данную дисциплину в 3-м и 4-м семестре.

Вид итогового контроля - экзамен и дифференцированный зачет.

Основной формой обучения в условиях заочной формы обучения является самостоятельная работа с учебником и учебными пособиями.

Для освоения данной дисциплины студентам заочной формы обучения читаются лекции, проводятся практические и лабораторные занятия.

**Лекции.** В ходе изучения дисциплины необходимо вести конспектирование учебного материала, обращать внимание на определения, формулировки, раскрывающие содержание тех или иных явлений и процессов, научные выводы и практические рекомендации. Желательно оставить в рабочих конспектах поля, на которых делать пометки из рекомендованной литературы, дополняющие материал прослушанной лекции, а также подчеркивающие особую важность тех или иных теоретических положений.

Следует обращать внимание на акценты, выводы, которые делает лектор, отмечая наиболее важные моменты в лекционном материале, например, с помощью разноцветных маркеров или ручек, подчеркивая термины и определения. При необходимости можно разработать собственную систему сокращений, аббревиатур и символов.

Необходимо задавать преподавателю уточняющие вопросы с целью уяснения теоретических положений. Целесообразно дорабатывать свой конспект лекции, делая в нем соответствующие записи из литературы, рекомендованной преподавателем и предусмотренной учебной программой.

Успешное освоение компетенций, формируемых данной учебной дисциплиной, предполагает оптимальное использование обучающимся времени самостоятельной работы. Для понимания материала учебной дисциплины и качественного его усвоения рекомендуется после прослушивания лекции и окончания учебных занятий, при подготовке к занятиям следующего дня просмотреть текст лекции, отметить материал конспекта лекций, который вызывает затруднения для понимания, попытаться найти ответы на затруднительные вопросы, используя рекомендуемую литературу, разобрать рассмотренные примеры, воспроизвести на листе бумаги доказательства теорем; в течение недели выбрать время для работы с литературой по учебной дисциплине.

**Лабораторные занятия.** Лабораторная работа – небольшой научный отчет, обобщающий проведенную студентом работу, которую представляют для защиты преподавателю. К лабораторным работам предъявляется ряд требований, основным из которых является полное, исчерпывающее описание всей проделанной работы, позволяющее судить о полученных результатах, степени выполнения заданий и профессиональной подготовке студентов.

Целью лабораторных работ является усвоение принципов информационных технологий управления различного типа, а также освоение программного обеспечения, используемого для создания автоматизированных систем управления.

Перед выполнением лабораторных работ следует повторить материал соответствующей лекции и изучить теоретическую часть методических указаний к данной лабораторной работе, на основании чего получить допуск к ее выполнению. Во время лабораторных работ выполнять учебные задания с максимальной степенью активности. Выполнение лабораторных работ заканчивается составлением отчета с выводами, характеризующими полученный результат и защита работы перед преподавателем.

Зашита отчета по лабораторной работе заключается в предъявлении преподавателю полученных результатов в виде файлов и напечатанного отчета и демонстрации полученных навыков в ответах на вопросы преподавателя. При сдаче отчета преподаватель может сделать устные и письменные замечания, задать дополнительные вопросы, попросить выполнить отдельные задания, часть работы или всю работу целиком.

**Практические занятия.** Для того чтобы практические занятия приносили максимальную пользу, необходимо помнить, что упражнение и решение задач проводятся по вычитанному на лекциях материалу и связаны, как правило, с детальным разбором отдельных вопросов лекционного курса. Следует подчеркнуть, что только после усвоения лекционного материала с определенной точки зрения (а именно с той, с которой он излагается на лекциях) он будет закрепляться на практических занятиях как в результате обсуждения и анализа лекционного материала, так и с помощью решения проблемных ситуаций, задач. При этих условиях студент не только хорошо усвоит материал, но и научится применять его на практике, а также получит дополнительный стимул (и это очень важно) для активной проработки лекции.

При самостоятельном решении задач нужно обосновывать каждый этап решения, исходя из теоретических положений курса. Если студент видит несколько путей решения проблемы (задачи), то нужно сравнить их и выбрать самый рациональный. Полезно до начала вычислений составить краткий план решения проблемы (задачи). Решение проблемных задач или примеров следует излагать подробно, вычисления располагать в строгом порядке, отделяя вспомогательные вычисления от основных. Решения при необходимости нужно сопровождать комментариями, схемами, чертежами и рисунками.

Следует должен помнить, что решение каждой учебной задачи должно доводиться до окончательного логического ответа, которого требует условие, и по возможности с выводом. Полученный ответ следует проверить способами, вытекающими из существа данной задачи. Полезно также (если возможно) решать несколькими способами и сравнить полученные результаты. Решение задач данного типа нужно продолжать до приобретения твердых навыков в их решении.

**Работа с учебными пособиями.** Самостоятельная работа по учебным пособиям является главным видом работы студента.

Студентам рекомендуется следующее:

* изучать курс систематически в течение всего учебного процесса. Изучение дисциплины в сжатые сроки перед экзаменом не даст глубоких и прочных знаний;
* выбрав какое-либо учебное пособие в качестве основного по определенной части курса, использовать его при изучении всей части курса или, по крайней мере, раздела. Замена одного пособия другим в процессе изучения может привести к утрате логической связи между отдельными вопросами. Но если основное пособие не дает полного и ясного ответа на некоторые вопросы программы, необходимо обращаться к другим учебным пособиям;
* при чтении учебного пособия составлять конспект;

**Самостоятельная работа студентов** проводится с целью:

* систематизации и закрепления полученных теоретических знаний и практических умений студентов;
* углубления и расширения теоретических знаний;
* формирования умений использовать нормативную, правовую, справочную документацию и специальную литературу;
* развития познавательных способностей и активности студентов, творческой инициативы, самостоятельности, ответственности и организованности;
* формирования самостоятельности мышления, способностей к саморазвитию, самосовершенствованию и самореализации;
* развития исследовательских умений.

Для достижения указанной цели студенты на основе плана самостоятельной работы должны решать следующие задачи:

* обзор основных источников по теме лекции: нормативных правовых актов, литературы, периодических изданий;
* изучить основные понятия, представленные в словаре терминов;
* ответить на контрольные вопросы;
* выполнить контрольную работу.

Самостоятельная работа включает такие формы работы, как:

* самоподготовку (проработка и повторение лекционного материала и материала учебников и учебных пособий;
* подготовка к лабораторным и практическим занятиям;
* выполнение контрольных работ;
* решение кейс-задач;
* подготовка к зачету, экзамену.

**Тестирование.** Цель тестирования в ходе учебного процесса обучающихся состоит не только в систематическом контроле знаний, но и в развитии умения студентов логически мыслить, выделять, анализировать и обобщать наиболее существенные моменты.

При самостоятельной подготовке к тестированию студенту необходимо:

* проработать информационный материал по теме (темам);
* проконсультироваться с преподавателем по вопросу выбора дополнительной литературы;
* заранее выяснить все условия тестирования (количество тестов, время, отведенное на тестирование, система оценки результатов);
* приступая к работе с тестами, необходимо внимательно и до конца прочитать вопрос и предлагаемые варианты ответов;
* если обучающийся не знает ответа на вопрос или не уверен в правильности, следует пропустить его, а потом к нему вернуться;
* в процессе решения желательно применять несколько подходов в решении задания, это позволяет максимально гибко оперировать методами решения, находя оптимальный вариант;
* необходимо обязательно оставить время для проверки ответов, чтобы избежать механических ошибок.

В соответствии с учебными планами 38.03.01 «Экономика» студенты заочной формы обучения дисциплину «Теория вероятностей и математическая статистика» изучают два семестра. В каждом семестре планом предусмотрена контрольная работа.

**Контрольная работа** оформляется в тетради в рукописном варианте. Обязательно записывать условия задач. Желательно задачи решать последовательно. Решение всех задач и пояснений к ним должны быть достаточно подробными. Все вычисления необходимо делать полностью. Для замечаний преподавателя нужно на каждой странице оставлять поля.

Перед выполнением каждой контрольной работы студент должен изучить соответствующие разделы рекомендуемой литературы и может воспользоваться примерами решений типовых задач, содержащихся в методических указаниях по формам работ.

 **Решение кейс-задачи** имеет своей целью повышение качества специалистов, способных творчески применять в практической деятельности теоретические знания. Этапы решения кейс задачи, подлежащие оценке:

* формулировка и анализ проблем, заложенных в кейсе;
* демонстрация адекватных аналитических методов при работе с информацией;
* использование дополнительных источников информации для решения кейса;
* выполнение всех необходимых расчетов;
* обоснованность выводов, весомость аргументов;
* формулировка собственных выводов, которые отличают данное решение кейса от других решений.

**Промежуточная аттестация.** При подготовке к промежуточной аттестации обучающимся рекомендуется:

* внимательно изучить перечень вопросов и определить, в каких источниках находятся сведения, необходимые для ответа на них;
* освоить теоретические положения дисциплины, разобрать определения всех понятий, постановку задач, математические и инструментальные средства их решения, рассмотреть примеры и самостоятельно решить несколько типовых задач из каждой темы;
* составить план ответа на каждый вопрос, выделив ключевые моменты.

**Варианты заданий на выполнение и примеры их решения приведены в методических указаниях:**

* Теория вероятностей и математическая статистика:Методические указания к лабораторным занятиям (4 семестр) / Бузулукский гуманитарно-технологический институт (филиал) ОГУ. – Бузулук: БГТИ (филиал) ОГУ, 2017 – 46 с.
* Теория вероятностей и математическая статистика:Методические указания к контрольным работам (3,4 семестр) / Бузулукский гуманитарно-технологический институт (филиал) ОГУ. – Бузулук: БГТИ (филиал) ОГУ, 2017 -62 с.
* Теория вероятностей и математическая статистика:Методические указания к практическим занятиям (3 семестр) / Бузулукский гуманитарно-технологический институт (филиал) ОГУ. – Бузулук: БГТИ (филиал) ОГУ, 2017 – 20 с.

**Критерии оценки**

Студент допускается к собеседованию по контрольной работе при условии выполнения 75%-100% условий и требований, сформулированных в ней. На момент собеседования в контрольную работу должны быть внесены изменения с учетом замечаний преподавателя.

Экзамен устный по билетам, в которых два теоретических вопроса и задача. Подготовка к ответу – 30 минут. Сдача дифференцированного зачета в форме тестирования. Всего 40 вопросов. Если количество правильных ответов менее 20, назначается пересдача.

Оценка **«отлично»** выставляется в том случае, если студент глубоко и прочно усвоил программный материал курса, последовательно, четко, с необходимыми пояснениями и доказательствами излагает ответы на вопросы, свободно применяет теоретические знания при решении задач, без затруднений отвечает на дополнительные вопросы.

Оценка **«хорошо»** выставляется в том случае, если студент твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, допуская при этом непринципиальные неточности, правильно применяет теоретические знания при решении задач, не испытывает явных затруднений и не допускает существенных неточностей при ответах на дополнительные вопросы.

Оценка **«удовлетворительно»** выставляется в том случае, если студент имеет знания только основного материала, но не усвоил деталей, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушения логической последовательности в изложении программного материала. Испытывает затруднения при решении задач.

Оценка **«неудовлетворительно»** выставляется в том случае, если студент не знает значительной части программного материала, допускает принципиальные ошибки при решении задач, слабо владеет терминами, формирующими понятийно-терминологический аппарат лекционного курса.

##  Порядок формирования оценок по дисциплине

## Блок А.

*Тестовый контроль*. Заключатся в тестировании. Всего 40 вопросов. Если количество правильных ответов менее двадцати, назначается пересдача.

**Блок Б.**

*Решение задач на практическом занятии*.

*Выполнение лабораторных работ. Защита отчета по работе.*

*Выполнение контрольных работ* в отдельной тетради в рукописном

**Блок С.**

*Решение кейс-задач*

**Задача 1**

Курсовая стоимость ценной бумаги равна 1000 рублей. Она может в течение недели подорожать на 4% с вероятностью 0,9 или подешеветь на 4 % с вероятностью 0,1. Предполагается, что еженедельные изменения цен независимы. Прошло две недели.

**Подзадача 1.** Установите соответствие между случайными событиями и вероятностями этих событий…..

* 1. Курс ценной бумаги упадет
	2. Курс ценной бумаги вырастет
	3. Курс ценной бумаги не изменится

Ответы:

* 1. 0,19
	2. 0,81
	3. 0
	4. 0,01
	5. 0,18

**Подзадача 2.** Максимально возможный курс ценной бумаги будет принадлежать интервалам (в руб.) …..

Ответы:

* 1. (1081,5;1082,5)
	2. (1081,0;1082,0)
	3. (1080,5;1081,5)
	4. (1080,0;1081,0)

**Подзадача 3**. Математическое ожидание курсовой стоимости ценной бумаги равно….

Ответы:

1. 1065,024
2. 1065,00
3. 1064,976
4. 1000,00

**Задача 2**

Компания рассматривает проект по строительству трех домов, по одному в разных районах города. Средства для строительства дают сами будущие жильцы. Вероятность набрать необходимые средства для постройки одного дома составляет 0,9. Каждый построенный дом окупает 50 % всех затрат компании по проекту, равных 500 млн. руб.

**Подзадача 1**. Предположим, что собранных средств будет достаточно для строительства k домов. Установите соответствие между значениями k и вероятностями соответствующих событий.

1. k=1
2. k=2
3. k=3

Ответы:

1. 0,027
2. 0,243
3. 0,729
4. 0,9
5. 0,81

**Подзадача 2**. Если обозначить через X-количество построенных компанией домов, то случайную величину S-прибыль компании (в млн руб.) -можно определить, как…

1. S=250\*X-500
2. S=500\*X-250
3. S=250\*X
4. S=500\*X

**Подзадача 3** Ожидаемая прибыль компании равна \_\_\_\_\_\_\_\_\_ млн. руб.

 **Учебно-методическое обеспечение дисциплины**

**1 Основная литература**

1 Колемаев, В.А. Теория вероятностей и математическая статистика: учебник / В.А. Колемаев, В.Н. Калинина. - Москва: Юнити-Дана, 2015. - 352 с.: табл. - Библиогр. в кн. - ISBN 5-238-00560-1; [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=436721>

2 Основы математической статистики: Учебник / Г.А. Соколов. - 2-e изд. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2014. - 368 с.: 60x90 1/16 + (Доп. мат. znanium.com). - (Высшее образование: Бакалавриат). (переплет) ISBN 978-5-16-006729-2 - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/405699>

**2 Дополнительная литература**

1 Гмурман,В.Е. Теория вероятностей и математическая статистика: Учебное пособие / В.Е.Гмурман.-12-е изд., перераб.-М.: Высшее образование. 2006.-479 с.-5-9692-0031-Х.

2 Мхитарян, В. С. Теория вероятностей и математическая статистика [Электронный ресурс]: учеб. пособие / В. С. Мхитарян, Е. В. Астафьева, Ю. Н. Миронкина, Л. И. Трошин; под ред. В. С. Мхитаряна. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: Московский финансово-промышленный университет «Синергия», 2013. - (Университетская серия). - ISBN 978-5-4257-0106-0. - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/451329>

**3 Периодические издания**

1 Экономист: журнал. - Москва : Издательство Экономист, 2018

 2 Финансы: журнал. - Москва : ООО Книжная редакция Финансы, 2018

**4 Интернет-ресурсы**

1 http://www. [exponenta.ru](http://www.exponenta.ru) – «Образовательный математический сайт Exponenta.ru».

2 http://www.ksu.ru/infres/volodin/ (И.Н.Володин, Казанский ГУ, лекции по теории вероят-ностей и математической статистике)

3 http://www.intuit.ru/department/economics/basicstat/ (Видеокурс «Основы математической статистики»)

4 http://www.nsu.ru/mmf/tvims/chernova/tv/ (Н.И.Чернова, НГУ, семестровый курс лекций о теории вероятностей для студентов экономического факультета)

5 http://www.nsu.ru/mmf/tvims/chernova/ms/index.html (Н.И.Чернова, НГУ, семестровый курс лекций по математической статистике для студентов экономического факультета)

**5 Программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы современных информационных технологий**

1 Операционная система Microsoft Windows 7 Academic

2 Офисные приложения Microsoft Office 2010 Academic

3 Яндекс-браузер. – Режим доступа: <https://yandex.ru/>

4 Общероссийский математический портал. – Режим доступа: <http://www.mathnet.ru/>

5 Большая российская энциклопедия. - Режим доступа: <https://bigenc.ru/>

6 СПС «КонсультантПлюс». – Режим доступа: <http://www.consultant.ru/>

7 Федеральная служба государственной статистики. – Режим доступа: <http://www.gks.ru/wps/wcm/connect/rosstat_main/rosstat/ru/>

8 Федеральный образовательный портал. – Режим доступа – <http://www.edu.ru>

 **Материально-техническое обеспечение дисциплины**

Учебная аудитория лекционного типа: стационарный мультимедиа-проектор и проекционный экран, переносной ноутбук, кафедра, посадочные места для обучающихся, рабочее место преподавателя, учебная доска

 Компьютерный класс, используемый для проведения лабораторных занятий, оборудован: стационарный мультимедиа-проектор и проекционный экран, оборудование для организации локальной вычислительной сети, программное обеспечение, перечисленное в п.5.5, перечни Интернет-ссылок (п.5.4) на электронные источники (на которые разрешен доступ из аудитории) для получения дополнительной информации по дисциплине. Средства пожаротушения, система сигнализации, кондиционер, медицинская аптечка, жалюзи и распашные решетки, персональные компьютеры, рабочее место преподавателя и студентов, учебная доска.

Помещения для самостоятельной работы: комплекты ученической мебели, компьютеры с подключением к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду ОГУ, электронные библиотечные системы.

Учебные аудитории для проведения групповых консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации: комплекты ученической мебели, компьютеры с подключением к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду ОГУ, электронные библиотечные системы.