

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
НАЦИОНАЛЬНЫЙ ИССЛЕДОВАТЕЛЬСКИЙ
ТОМСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ (НИ ТГУ)

Институт прикладной математики и компьютерных наук

УТВЕРЖДЕНО:

Директор

А. В. Замятин

Рабочая программа дисциплины

Оценка состояний дважды стохастических потоков событий

по направлению подготовки

01.04.02 Прикладная математика и информатика

Направленность (профиль) подготовки:

Обработка данных, управление и исследование сложных систем

Форма обучения

Очная

Квалификация

Магистр

Год приема

2025

СОГЛАСОВАНО:

Руководитель ОП

Л.А. Нежелская

Председатель УМК

С.П. Сущенко

1. Цель и планируемые результаты освоения дисциплины

Целью освоения дисциплины является формирование следующих компетенций:

- ОПК-3 – Способен разрабатывать математические модели и проводить их анализ при решении задач в области профессиональной деятельности;
- ПК-1 – Способен изучить работу системы и подсистем, выявить требования к функциям системы и подсистем, обрабатывать запросы на изменения к функциям системы и подсистем.

Результатами освоения дисциплины являются следующие индикаторы достижения компетенций:

ИОПК-3.1 Разрабатывает математические модели в области прикладной математики и информатики.

ИПК-1.1 Осуществляет декомпозицию системы на подсистемы.

ИПК-1.2 Строит математическую модель системы или подсистемы, вводит целевую функцию системы или подсистемы, строит ограничения, соответствующие требованиям к системе или подсистеме.

ИПК-1.3 Модернизирует математическую модель системы или подсистемы на изменение требований к системе или подсистеме.

2. Задачи освоения дисциплины

– Освоить аппарат оценки состояний дважды стохастических потоков событий и привить навыки пользования этими методами при решении актуальных задач фундаментальной и прикладной математики.

– Научиться применять понятийный аппарат теории дважды стохастических потоков событий для решения практических задач профессиональной деятельности.

– Научиться разрабатывать математические модели, касающиеся решаемой задачи.

– Научиться производить анализ новой разработанной математической модели.

– Научиться критически оценивать разработанную модель.

– Научиться сравнивать новую разработанную модель с известными моделями.

3. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина относится к Блоку 1 «Дисциплины (модули)».

Дисциплина относится к обязательной части образовательной программы. Дисциплина входит в модуль «Введение в специализацию».

4. Семестр(ы) освоения и форма(ы) промежуточной аттестации по дисциплине

Третий семестр, зачет

5. Входные требования для освоения дисциплины

Для успешного освоения дисциплины требуются компетенции, сформированные в ходе освоения образовательных программ предшествующего уровня образования.

Для успешного освоения дисциплины необходимы знания по разделам математики: «Математический анализ», «Линейная алгебра и аналитическая геометрия», «Дифференциальные уравнения», «Теория вероятностей и случайные процессы», «Математическая статистика», «Методы оптимизации»

6. Язык реализации

Русский

7. Объем дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 з.е., 108 часов, из которых:

-лекции: 32 ч.

Объем самостоятельной работы студента определен учебным планом.

8. Содержание дисциплины, структурированное по темам

Тема 1. Классификация дважды стохастических потоков событий.

Введение. Простейший поток. Об истории возникновения дважды стохастических потоков событий. МАР-поток событий (МС-поток). Марковость процесса $\lambda(t)$; функция распределения длительности пребывания $\lambda(t)$ в заданном состоянии. Реализация процесса. Построение матрицы инфинитезимальных характеристик процесса. О физическом смысле инфинитезимальных характеристик. Синхронный поток событий. Определение потока. Марковские свойства процесса $\lambda(t)$ и его реализация. Асинхронный поток событий (ММРР-поток), обобщённый асинхронный поток, МАР-поток. Определение, марковость процесса, матрицы инфинитезимальных характеристик.

Полусинхронный поток событий. Обобщённый полусинхронный поток. Марковость процесса для обоих потоков. Матрицы инфинитезимальных характеристик процесса $\lambda(t)$. Модулированный поток событий и его свойства.

Тема 2. Оптимальное оценивание состояний дважды стохастических потоков событий при полной наблюдаемости потока.

Вывод рекуррентного соотношения для апостериорных вероятностей. Оптимальная оценка состояний асинхронного потока по наблюдениям за потоком событий. Вывод формулы пересчёта. Вывод дифференциального уравнения Риккати. Интегрирование уравнения Риккати. Явный вид апостериорных вероятностей. Исследование поведения функции апостериорной вероятности. Нахождение явного вида априорных вероятностей состояний. Алгоритм оптимального оценивания состояний.

Тема 3. Оптимальное оценивание состояний дважды стохастических потоков событий при наличии непродлевающегося мёртвого времени

Условия неполной наблюдаемости за дважды стохастическими потоками событий. Мёртвое время. Исходные предпосылки для вывода апостериорной вероятности первого состояния процесса $\lambda(t)$. Нахождение явных выражений для апостериорных вероятностей состояний на интервале ненаблюдаемости потока. Алгоритм оптимального оценивания в условиях мёртвого времени.

9. Текущий контроль по дисциплине

Текущий контроль по дисциплине проводится путем контроля посещаемости, контроля выполнения домашних заданий, проведения контрольных работ и фиксации результатов не менее одного раза в семестр, проведения коллоквиума по лекционному материалу.

Оценочные материалы текущего контроля размещены на сайте ТГУ в разделе «Информация об образовательной программе» - <https://www.tsu.ru/sveden/education/eduop/>.

10. Порядок проведения и критерии оценивания промежуточной аттестации

Зачет в третьем семестре проводится в письменной форме по билетам. Билет содержит 2 теоретических вопроса. Продолжительность зачета 1 час.

Примерный перечень теоретических вопросов:

1. Почему поток событий называется асинхронным?
2. Почему поток событий называется синхронным?
3. Можно ли полусинхронный поток назвать полуасинхронным?

4. Какой поток является частным случаем МАР-потока?
5. В чём отличие обобщённого асинхронного потока событий от асинхронного потока?
6. Назвать отличие обобщённого полусинхронного потока событий от полусинхронного потока.
7. Почему все рассмотренные потоки событий являются коррелированными?
8. Каким свойством должны обладать перечисленные выше потоки, чтобы стать некоррелированными?
9. Дать физическую интерпретацию инфинитезимальных характеристик сопровождающего случайного процесса.
10. Каким отличительным свойством обладает апостериорная вероятность?
11. Почему оценивание состояний потока по критерию максимума апостериорной вероятности является оптимальным?
12. Вывести рекуррентное соотношение для апостериорных вероятностей состояний дважды стохастического потока событий с произвольным числом состояний.
13. Дать физическую интерпретацию того факта, что апостериорная вероятность для всех рассматриваемых потоков является разрывной функцией времени.
14. При выполнении какого условия поведение апостериорной вероятности первого состояния синхронного потока не зависит от предыстории? Дать физическую интерпретацию этого явления.
15. Чем отличаются друг от друга понятия непродлевающееся мёртвое время и продлевающееся мёртвое время? Пояснить на временной диаграмме.
16. Каким образом ведёт себя среднее количество потерянных событий исходного потока в зависимости от длительности мёртвого времени?
17. При каком типе мёртвого времени (продлевающееся, непродлевающееся), имеющего фиксированную длительность, потери событий исходного потока окажутся в среднем большими?
18. Для какого потока — асинхронного или обобщённого асинхронного, функционирующего в условиях непродлевающегося мёртвого времени, потери событий исходного потока будут в среднем большими?
19. Для какого потока — полусинхронного или обобщённого полусинхронного, функционирующего в условиях непродлевающегося мёртвого времени, потери событий исходного потока в среднем будут большими?
20. С какой целью осуществляется имитационное моделирование дважды стохастических потоков событий, функционирующих как в условиях полной наблюдаемости, так и при наличии непродлевающегося мёртвого времени?

Пропуски занятий, несданный или неудовлетворительно написанный коллоквиум по лекционному материалу, написанная на «неудовлетворительно» контрольная работа влекут за собой необходимость ликвидации перечисленных задолженностей для получения допуска к зачёту.

Результаты зачёта определяются оценками «зачтено», «не зачтено» в соответствии с приведённой ниже таблицей.

Не зачтено	Не зачтено	Зачтено
Нет ответа ни на один из двух вопросов билета	Имеется ответ на один из двух вопросов билета	Имеются полные с доказательствами ответы на оба вопроса в билете

Оценочные материалы для проведения промежуточной аттестации размещены на сайте ТГУ в разделе «Информация об образовательной программе» - <https://www.tsu.ru/sveden/education/eduop/>.

11. Учебно-методическое обеспечение

а) Электронный учебный курс по дисциплине в среде электронного обучения iDO - <https://lms.tsu.ru/course/view.php?id=9067>

б) Оценочные материалы текущего контроля и промежуточной аттестации по дисциплине.

в) Методические указания по организации самостоятельной работы студентов.

12. Перечень учебной литературы и ресурсов сети Интернет

а) основная литература:

– Нежелская Л.А. Оценка состояний дважды стохастических потоков событий: учеб. пособие. – Томск: Издательство Томского государственного университета, 2020. – 210 с.

– Ивченко Г.И. Теория массового обслуживания / Г.И. Ивченко [и др.]. – М.: Наука, 1973. – 190 с.

– Хинчин А.Я. Работы по математической теории массового обслуживания. – М.: Физматгиз, 1963. – 236 с.

– Хазен Э.М. Методы оптимальных статистических решений и задачи оптимального управления. – М.: Советское радио, 1968. – 256 с.

– Вишневский В.М. Стохастические системы с коррелированными потоками. Теория и применение в телекоммуникационных сетях / В.М. Вишневский [и др.]. – М.: ТЕХНОСФЕРА, 2018. – 564 с.

– Горцев А.М. Оптимальная нелинейная фильтрация марковского потока событий с переключениями / А.М. Горцев, Л.А. Нежелская // Техника средств связи. Серия: Системы связи. – 1989. – Вып. 7. – С. 46–54.

– Горцев А.М. Асинхронный дважды стохастический поток с иницированием лишних событий / А.М. Горцев, Л.А. Нежелская // Дискретная математика. – 2011. – Т. 23. Вып. 2. – С. 59–65.

– Gortsev A.M. Optimal state estimation in MAP event flows with unextendable dead time / A.M. Gortsev, L.A. Nezhel'skaya, A.A. Solov'ev // Automation and Remote Control. – 2012. – Vol. 73, is. 8. – P. 1316–1326.

б) дополнительная литература:

– Нежелская Л.А. Оптимальная оценка состояний обобщенного MAP-потока событий с произвольным числом состояний / Л.А. Нежелская, А.В. Кеба // Автоматика и телемеханика. – 2021. – № 5. – С. 68–85.

– Горцев А.М. Полусинхронный дважды стохастический поток при продлеваемом мёртвом времени / А.М. Горцев, Л.А. Нежелская // Вычислительные технологии. – 2008. – Т. 13. № 1. – С. 31–41.

– Апанасович В.В. Статистический анализ случайных потоков в физическом эксперименте / В.В. Апанасович [и др.]. – Минск: Университетское, 1988. – 256 с.

в) ресурсы сети Интернет:

– Электронная библиотека (репозиторий) ТГУ [Электронный ресурс] / Электронная библиотека (репозиторий) ТГУ: [сайт]. – [Томск]. – URL:

<http://vital.lib.tsu.ru/vital/access/manager/Repository/vtls:000398231>

– Электронная библиотека (репозиторий) ТГУ [Электронный ресурс] / Электронная библиотека (репозиторий) ТГУ: [сайт]. – [Томск]. – URL:

<http://sun.tsu.ru/limit/2016/000447511/000447511.pdf>

– Электронная библиотека (репозиторий) ТГУ [Электронный ресурс] / Электронная библиотека (репозиторий) ТГУ: [сайт]. – [Томск]. – URL:

<http://vital.lib.tsu.ru/vital/access/manager/Repository/vtls:000563429>

– Электронная библиотека (репозиторий) ТГУ [Электронный ресурс] / Электронная библиотека (репозиторий) ТГУ: [сайт]. – [Томск]. – URL:

<http://vital.lib.tsu.ru/vital/access/manager/Repository/vtls:000528146>

– Электронная библиотека (репозиторий) ТГУ [Электронный ресурс] / Электронная библиотека (репозиторий) ТГУ: [сайт]. – [Томск]. – URL:

<http://vital.lib.tsu.ru/vital/access/manager/Repository/vtls:000481043>

13. Перечень информационных технологий

а) лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение:

– Microsoft Office Standart 2013 Russian: пакет программ. Включает приложения: MS Office Word, MS Office Excel, MS Office PowerPoint, MS Office On-eNote, MS Office Publisher, MS Outlook, MS Office Web Apps (Word Excel MS PowerPoint Outlook).

б) информационные справочные системы:

– Электронный каталог Научной библиотеки ТГУ –
<http://chamo.lib.tsu.ru/search/query?locale=ru&theme=system>

– Электронная библиотека (репозиторий) ТГУ –
<http://vital.lib.tsu.ru/vital/access/manager/Index>

– ЭБС Лань – <http://e.lanbook.com/>

– ЭБС Консультант студента – <http://www.studentlibrary.ru/>

– Образовательная платформа Юпайт – <https://urait.ru/>

– ЭБС ZNANIUM.com – <https://znanium.com/>

– ЭБС IPRbooks – <http://www.iprbookshop.ru/>

14. Материально-техническое обеспечение

Аудитории для проведения занятий лекционного типа.

Аудитории для проведения занятий семинарского типа, индивидуальных и групповых консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.

Помещения для самостоятельной работы, оснащенные компьютерной техникой и доступом к сети Интернет, в электронную информационно-образовательную среду и к информационным справочным системам.

Аудитории для проведения занятий лекционного и семинарского типа индивидуальных и групповых консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации в смешанном формате («Актру»).

15. Информация о разработчиках

Нежелская Людмила Алексеевна, доктор физико-математических наук, профессор, заведующий кафедрой прикладной математики НИ ТГУ.