

СК МК Случайные процессы

Направление подготовки: 01.03.02 Прикладная математика и информатика, бакалавриат

Дисциплина: Специальный курс (Случайные процессы)

Аннотация

Трудоемкость: 2 ECTS, 72 академических часа.

Форма итогового контроля: зачет.

Краткое содержание(Случайные процессы).

Учебная дисциплина содержит основы теории случайных процессов, включающие:

- основные понятия и положения теории случайных процессов:
- классы случайных процессов и их примеры: марковские, гауссовские, стационарные в узком и широком смысле, однородные процессы с независимыми приращениями, процессы с некоррелированными приращениями;
- методы изучения случайных процессов: комбинаторные, дифференциальные, спектральные;
- приложения теории случайных процессов

Взаимосвязь с другими дисциплинами специальности:

При изучении дисциплины используются понятия и методы теории вероятностей и математической статистики, геометрии, теории меры, функционального анализа.

Требования к исходным уровням знаний и умений студентов:

Студент должен владеть базовыми знаниями по теории вероятностей, математическому анализу, геометрии.