

**Федеральное государственное автономное образовательное
учреждение высшего образования
«Московский физико-технический институт
(национальный исследовательский университет)»**

УТВЕРЖДЕНО

**Директор физтех-школы
прикладной математики и
информатики**

А.М. Райгородский

Рабочая программа дисциплины (модуля)

по дисциплине:	Анализ временных рядов
по направлению:	Прикладная математика и информатика
профиль подготовки:	Прикладная математика и информатика Физтех-школа Прикладной Математики и Информатики кафедра машинного обучения и цифровой гуманитаристики
курс:	1
квалификация:	магистр

Семестр, формы промежуточной аттестации: 1 (осенний) - Экзамен

Аудиторных часов: 45 всего, в том числе:

лекции: 30 час.

семинары: 15 час.

лабораторные занятия: 0 час.

Самостоятельная работа: 60 час.

Подготовка к экзамену: 30 час.

Всего часов: 135, всего зач. ед.: 3

Количество контрольных работ, заданий: 2

Программу составил: Р.Г. Нейчев, старший преподаватель

Программа обсуждена на заседании кафедры машинного обучения и цифровой гуманитаристики 24.04.2024

Аннотация

Курс посвящен анализу временных рядов, уделяя основное внимание методам моделирования и прогнозирования с помощью как статистических, так и основанных на машинном обучении методов. Освещаются основные типы моделей временных рядов, такие как AR, MA, ARMA и ARIMA, а также более сложные подходы, включая векторные авторегрессии (VAR). Отдельное внимание уделяется подходам на основе методов глубокого обучения.

Курс также охватывает методы проверки стационарности, различные техники сглаживания и декомпозиции временных рядов. Особое внимание уделяется практическому применению рассматриваемых методов для создания эффективных прогностических моделей. Курс предполагает наличие базовых знаний в области статистики и программирования.

1. Цели и задачи

Цель дисциплины

- познакомить с основными свойствами временных рядов и случайных процессов;
- предоставить практический опыт использования статистических методов для анализа временных рядов;
- развить навыки применения современных подходов для прогнозирования временных рядов.

Задачи дисциплины

- научить студентов оценивать свойства временных рядов (стационарность, периодичность и пр.);
- предоставить набор методов для прогнозирования временных рядов с учетом их свойств;
- обеспечить существенный опыт работы с временными рядами.

2. Перечень формируемых компетенций

Освоение дисциплины направлено на формирование следующих компетенций:

Код и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции
ОПК-2 Способен совершенствовать и реализовывать новые математические методы решения прикладных задач	ОПК-2.1 Имеет представление о современном состоянии математических исследований в рамках тематической области своей профессиональной деятельности
	ОПК-2.2 Способен оценить актуальность и практическую значимость прикладных математических исследований в своей профессиональной области
	ОПК-2.3 Владеет профессиональной терминологией, используемой в современной научно-технической литературе, обладает навыками устного и письменного изложения результатов научной деятельности в рамках профессиональной коммуникации
ПК-1 Готов к включению в профессиональное сообщество; способен проводить под научным руководством локальные исследования на основе существующих методов в конкретной области профессиональной деятельности	ПК-1.1 Знает принципы построения научной работы, методы сбора и анализа полученного материала, способы аргументации; владеет навыками подготовки научных обзоров, публикаций, рефератов и библиографий по тематике проводимых исследований на русском и английском языке
	ПК-1.2 Умеет решать научные задачи с пониманием существующих подходов к верификации модели программного обеспечения в связи с поставленной целью и в соответствии с выбранной методикой
	ПК-1.3 Имеет практический опыт выступлений на научной аргументации при анализе объекта научной профессиональной деятельности

ПК-2 Понимает и способен применить в научно-исследовательской и прикладной деятельности современный математический аппарат и алгоритмы, основные законы естествознания, современные языки программирования и программное обеспечение; операционные системы и сетевые технологии	ПК-2.1 Знает основы научно-исследовательской деятельности в области информационно-коммуникационных технологий владеет знанием основ философии и методологии науки; знанием методов научных исследований и навыками их проведения
	ПК-2.2 Имеет практически опыт использования существующих методов и алгоритмов решения задач цифровой обработки сигналов, использования сети Интернет, аннотирования, реферирования, библиографического разыскания и описания, опыт работы с научными источниками
	ПК-2.3 Умеет применять полученные знания в области фундаментальных научных основ теории информации и решать стандартные задачи в собственной научно-исследовательской деятельности

3. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю)

В результате освоения дисциплины обучающиеся должны

знать:

- постановку задач классификации и регрессии на основе временных данных;
- методы решения этих задач.

уметь:

- формулировать подходящие критерии качества для указанных выше задач;
- реализовывать решение на основе статистических или основанных на машинном обучении методов с учетом ограничений на сложность.

владеть:

- основными программными системами для работы с временными рядами вместе с другими инструментами анализа данных.

4. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

4.1. Разделы дисциплины (модуля) и трудоемкости по видам учебных занятий

№	Тема (раздел) дисциплины	Трудоемкость по видам учебных занятий, включая самостоятельную работу, час.			
		Лекции	Семинары	Лаборат. работы	Самост. работа
1	Основы временных рядов и стационарность.	6	3		12
2	Прогнозирование и сглаживание.	6	3		12
3	Расширенные модели и интервальные прогнозы.	6	3		12
4	Машинное обучение и глубокое обучение для временных рядов.	6	3		12
5	Трансформеры и обнаружение смены режима.	6	3		12

Итого часов	30	15		60
Подготовка к экзамену	30 час.			
Общая трудоёмкость	135 час., 3 зач.ед.			

4.2. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам)

Семестр: 1 (Осенний)

1. Основы временных рядов и стационарность.

Вводные понятия временных рядов, включая авторегрессионные (AR) и скользящие средние (MA) процессы. Обсуждение функции автокорреляции (ACF) и стационарности, включая тесты на стационарность, такие как расширенный тест Дики-Фуллера.

2. Прогнозирование и сглаживание.

Различные методы прогнозирования, включая ARIMA и его оценки, а также методы сглаживания, как MA сглаживание и экспоненциальное сглаживание. Включает в себя изучение декомпозиции временных рядов, такой как STL, и сравнение ETS и ARIMA.

3. Расширенные модели и интервальные прогнозы.

Обзор предиктивных интервалов и более сложных моделей, таких как ARCH, VAR и нелинейная авторегрессия. Рассмотрение моделирования структурных изменений и сложных сезонностей с использованием таких инструментов, как Prophet, Neural Pro.

4. Машинное обучение и глубокое обучение для временных рядов.

Применение машинного обучения, включая извлечение признаков, кросс-валидацию и представление обучения специально для временных рядов. Введение в глубокие обучающие модели, такие как RNN, LSTM и CNN, с демонстрациями на PyTorch и других платформах.

5. Трансформеры и обнаружение смены режима.

Подробное изучение трансформеров, включая способы повышения их эффективности, их применение к временным рядам. Также рассматриваются методы обнаружения изменений в распределении данных для временных рядов.

5. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

Учебная аудитория, оснащенная компьютером и мультимедийным оборудованием (проектор, звуковая система).

6.Перечень рекомендуемой литературы

Основная литература

Литература на кафедре:

1. Машинное обучение [Текст]/Х. Бринк, Дж. Ричардс, М. Феверолф, Real-World Machine Learning, -СПб., Питер, 2017

2. Python и машинное обучение [Текст] = Python Machine Learning : крайне необходимое издание по новейшей предсказательной аналитике для более глубокого понимания методологии машинного обучения / С. Рашка; пер. с англ. А. В. Логунова .— М. : ДМК Пресс, 2017 .— 418 с.: ил. - Предм. указ.: с. 408-417. - 200 экз. - ISBN 978-5-97060-409-0 (в пер.) .— Полный текст (Доступ из сети МФТИ / Удаленный доступ).

Дополнительная литература

Литература на кафедре:

1. Математические основы машинного обучения и прогнозирования [Текст] / В. В. Вьюгин ; Моск. физ.-техн. ин-т (гос. ун-т), Лаб. структурных методов анализа данных в предсказательном моделировании (ПреМоЛаб), Ин-т проблем передачи информации им. А. А. Харкевича РАН - М.МЦНМО,2013

7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", необходимых для освоения дисциплины (модуля)

<http://github.com/girafe-ai>

8. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень необходимого программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)

Мультимедийные технологии можно использовать на лекциях и практических занятиях, в том числе на презентациях.

9. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

Студент, изучающий дисциплину, должен с одной стороны, овладеть общим понятийным аппаратом, а с другой стороны, должен научиться применять теоретические знания на практике. В результате изучения дисциплины студент должен знать основные определения, понятия, аксиомы.

Успешное освоение курса требует напряжённой самостоятельной работы студента. В программе курса приведено минимально необходимое время для работы студента над темой. Самостоятельная работа включает в себя:

- чтение и конспектирование рекомендованной литературы;
- проработку учебного материала (по учебной и научной литературе), подготовку ответов на вопросы, предназначенных для самостоятельного изучения, доказательство отдельных утверждений, свойств;
- подготовку к экзамену.

Руководство и контроль за самостоятельной работой студента осуществляется в форме индивидуальных консультаций.

Важно добиться понимания изучаемого материала, а не механического его запоминания. При затруднении изучения отдельных тем, вопросов, следует обращаться за консультациями к лектору.

ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

по направлению:	Прикладная математика и информатика
профиль подготовки:	Прикладная математика и информатика Физтех-школа Прикладной Математики и Информатики кафедра машинного обучения и цифровой гуманитаристики
курс:	<u>1</u>
квалификация:	магистр
Семестр, формы промежуточной аттестации: 1 (осенний) - Экзамен	
Разработчик:	Р.Г. Нейчев, старший преподаватель

1. Компетенции, формируемые в процессе изучения дисциплины

Код и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции
ОПК-2 Способен совершенствовать и реализовывать новые математические методы решения прикладных задач	ОПК-2.1 Имеет представление о современном состоянии математических исследований в рамках тематической области своей профессиональной деятельности
	ОПК-2.2 Способен оценить актуальность и практическую значимость прикладных математических исследований в своей профессиональной области
	ОПК-2.3 Владеет профессиональной терминологией, используемой в современной научно-технической литературе, обладает навыками устного и письменного изложения результатов научной деятельности в рамках профессиональной коммуникации
ПК-1 Готов к включению в профессиональное сообщество; способен проводить под научным руководством локальные исследования на основе существующих методов в конкретной области профессиональной деятельности	ПК-1.1 Знает принципы построения научной работы, методы сбора и анализа полученного материала, способы аргументации; владеет навыками подготовки научных обзоров, публикаций рефератов и библиографий по тематике проводимых исследований на русском и английском языке
	ПК-1.2 Умеет решать научные задачи с пониманием существующих подходов к верификации модели программного обеспечения в связи с поставленной целью и в соответствии с выбранной методикой
	ПК-1.3 Имеет практический опыт выступлений на научной аргументации при анализе объекта научной профессиональной деятельности
ПК-2 Понимает и способен применить в научно-исследовательской и прикладной деятельности современный математический аппарат и алгоритмы, основные законы естествознания, современные языки программирования и программное обеспечение; операционные системы и сетевые технологии	ПК-2.1 Знает основы научно-исследовательской деятельности в области информационно-коммуникационных технологий; владеет знанием основ философии и методологии науки; знанием методов научных исследований и навыками их проведения
	ПК-2.2 Имеет практический опыт использования существующих методов и алгоритмов решения задач цифровой обработки сигналов, использования сети Интернет, аннотирования, реферирования, библиографического разыскания и описания, опыт работы с научными источниками
	ПК-2.3 Умеет применять полученные знания в области фундаментальных научных основ теории информации и решать стандартные задачи в собственной научно-исследовательской деятельности

2. Показатели оценивания компетенций

В результате изучения дисциплины «Анализ временных рядов» обучающийся должен:

знать:

- постановку задач классификации и регрессии на основе временных данных;
- методы решения этих задач.

уметь:

- формулировать подходящие критерии качества для указанных выше задач;
- реализовывать решение на основе статистических или основанных на машинном обучении методов с учетом ограничений на сложность.

владеть:

- основными программными системами для работы с временными рядами вместе с другими инструментами анализа данных.

3. Перечень типовых (примерных) вопросов, заданий, тем для подготовки к текущему контролю

1. Слабая и сильная стационарность временных рядов. Тренд, сезонность, циклы.
2. Определение AR процесса, условия стационарности. АКФ, ее графическое представление.
3. Определение MA процесса, условия стационарности.
4. SARIMAX, базовые элементы, первоначальная оценка гиперпараметров с использованием АКФ, ЧАКФ. Выбор модели.
5. Необходимые и желаемые свойства остатков.
6. Экспоненциальное сглаживание: идея, базовые элементы, выбор модели.
7. Модели ARCH и GARCH. Модель VAR. Кусочно-линейная NLAR. Facebook Prophet.
8. Признаки для машинного обучения. Кросс-валидация для временных рядов.
9. Рекуррентные нейронные сети, преимущества и недостатки. Преимущества и недостатки LSTM.
10. Сверточные нейронные сети для временных рядов, преимущества и недостатки, сравнение с RNN.
11. Механизм внимания. Трансформеры, преимущества и недостатки. Стратегии снижения временной и пространственной сложности механизма внимания. Трансформеры для временных рядов.

4. Перечень типовых (примерных) вопросов и тем для проведения промежуточной аттестации обучающихся

Список вопросов к экзамену:

1. Что такое AR процесс, условия стационарности?
2. Дайте определение АКФ и её графическое представление.
3. Какие существуют признаки для машинного обучения?
4. Дайте определение для Кросс-валидации для временных рядов.
5. Как определить необходимые и желаемые свойства остатков?
6. Основные свойства временных рядов.
7. Рекуррентные нейронные сети, их преимущества и недостатки.
8. Что такое Трансформеры?
9. Что такое графическое представление АКФ?
10. Какие существуют виды свойств остатков?

Примеры экзаменационных билетов:

Билет №1

1. Назовите основные свойства временных рядов.
2. Опишите основные проблемы механизма внимания в задаче моделирования временных рядов.

Билет №2

1. Каким образом можно применить градиентные методы для задач с недифференцируемой целевой функцией?
2. Почему при минимизации квадратичного отклонения задача прогнозирования временных рядов может решаться неоптимальным способом?

Критерии оценивания

Оценка «отлично (10)» выставляется студенту, который проявил всестороннее, систематическое и глубокое знание материала образовательной программы, самостоятельно выполнил все задачи, предусмотренные программой, глубоко изучил основную и дополнительную литературу, рекомендованную программой. , активно работает в классе и понимает основные научные концепции по изучаемой дисциплине, проявил творческий подход и научный подход в понимании и представлении материала образовательной программы, ответ на который характеризуется использованием богатых и адекватных терминов, а также последовательным и логичным изложением материала;

Оценка «отлично (9)» дается студенту, который продемонстрировал всестороннее систематическое знание материала образовательной программы, самостоятельно выполнил все задачи, предусмотренные программой, глубоко усвоил основную литературу и знаком с рекомендуемой дополнительной литературой. по программе, активно проработал на занятиях, показал системность знаний по дисциплине, достаточную для дальнейшего изучения, а также умение самостоятельно расширять ее, ответ которой отличается точностью используемых терминов, а изложение материала в нем последовательное и логичное;

Оценка «отлично (8)» выставляется студенту, который проявил полное знание материала образовательной программы, не допускает существенных неточностей в своем ответе, самостоятельно выполнил все задания, предусмотренные программой, изучил основную литературу, рекомендованную учебной программой. программа, активно проработанная на занятиях, показала системность его знаний по дисциплине, достаточных для дальнейшего изучения, а также способность самостоятельно их расширять;

Оценка «хорошо (7)» выставляется студенту, который проявил достаточно полное знание материала образовательной программы, не допускает существенных неточностей в ответе, самостоятельно выполнил все задания, предусмотренные программой, изучил основную рекомендованную литературу по программе, активно работал на занятиях, проявил системность своих знаний по дисциплине, достаточных для дальнейшего изучения, а также способность самостоятельно их усиливать;

Оценка «хорошо (6)» выставляется студенту, который проявил достаточно полное знание материала образовательной программы, не допускает существенных неточностей в своем ответе, самостоятельно выполнил основные задачи, предусмотренные программой, изучил основную литературу. рекомендован программой, показал систематичность своих знаний по дисциплине, достаточную для дальнейшего изучения;

Оценка «хорошо (5)» дается студенту, продемонстрировавшему знание материала основной образовательной программы в объеме, необходимом для дальнейшего обучения и будущей работы по профессии, который, не проявляя достаточной активности на уроках, тем не менее самостоятельно выполнял, овладел основными задачами, предусмотренными программой, освоил основную литературу, рекомендованную программой, допустил ошибки в их выполнении и ответе во время тестирования, но имеет необходимые знания для исправления этих ошибок самостоятельно;

Оценка «удовлетворительно (4)» дается студенту, обнаружившему знание материала основной образовательной программы в объеме, необходимом для дальнейшего обучения и будущей работы по профессии, который, не проявляя достаточной активности на уроках, тем не менее самостоятельно выполнял, выполнил основные задачи, предусмотренные программой, изучил основную литературу, но допустил ошибки в их выполнении и в своем ответе во время теста, но имеет необходимые знания для исправления этих ошибок под руководством преподавателя;

Оценка «удовлетворительно (3)» выставляется обучающемуся, проявившему знание материала основной образовательной программы в объеме, необходимом для дальнейшего обучения и будущей работы по профессии, не проявившего активности на занятиях, самостоятельно выполнившего основные задания, предусмотренные законодательством. программа, но допускающая ошибки в их выполнении и в ответе во время теста, но обладающая необходимыми знаниями для устранения под руководством преподавателя наиболее существенных ошибок;

Оценка «неудовлетворительно (2)» дается студенту, который показал пробелы в знаниях или недостаток знаний по значительной части материала основной образовательной программы, не выполнил самостоятельно основные задачи, требуемые программой, допустил принципиальные ошибки в выполнении предусмотренных программой задач, не имеющего возможности продолжить учебу или начать профессиональную деятельность без дополнительной подготовки по данной дисциплине;

Оценка «неудовлетворительно (1)» ставится студенту при отсутствии ответа (отказ от ответа), либо когда представленный ответ совсем не соответствует сути вопросов, содержащихся в задании.

5. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

Во время приёма экзамена при подготовке билета можно пользоваться любыми материалами. При непосредственном ответе ничем пользоваться нельзя. Необходимо обратить внимание на теоретический минимум. Незнание ответов на вопросы из теоретического минимума автоматически влечёт неудовлетворительную оценку за экзамен.