

Федеральное государственное образовательное бюджетное
учреждение высшего образования
«Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации»

Факультет информационных технологий и анализа больших данных
Департамент анализа данных и машинного обучения

ПРОГРАММА

вступительного испытания
для поступающих на обучение по программам подготовки
научно-педагогических кадров в аспирантуре
по направлению 38.06.01 «Экономика»,
направленность 08.00.13 – «Математические и инструментальные
методы экономики»

Москва 2020

ОГЛАВЛЕНИЕ

1. Общие положения	3
2. Содержание программы вступительного испытания	4
3. Учебно-методическое и информационное обеспечение	15
4. Примеры заданий	17
5. Оценка результатов сдачи вступительных испытаний.....	24

Составители:

руководитель программы подготовки кадров высшей квалификации по направлению Экономика, направленность Математические и инструментальные методы экономики, д.э.н., доцент Коровин Д.И;

первый заместитель руководителя Департамента анализа данных и машинного обучения, к.ф.-м.н., доцент Феклин В.Г.

1. Общие положения

Программа вступительного испытания по направлению подготовки направление подготовки 38.06.01 «Экономика», направленность программы аспирантуры 08.00.13 – «Математические и инструментальные методы экономики» составлена на основе государственных образовательных стандартов высшего образования по программам специалитета и магистратуры, образовательных стандартов Финансового университета по программам магистратуры.

Целью вступительных испытаний является определение степени готовности поступающего к освоению основной образовательной программы аспирантуры по программе подготовки научно-педагогических кадров в аспирантуре по направлению 38.06.01 «Экономика», направленность программы аспирантуры «Математические и инструментальные методы экономики» и его способности к самостоятельной научно-исследовательской деятельности.

Задачами вступительных испытаний являются оценка уровня подготовленности поступающего и сформированности соответствующих профессиональных компетенций для освоения основной образовательной программы аспирантуры по указанному направлению.

2. Содержание программы вступительного испытания

Тема 1. Математический анализ

Множества и операции над ними. Понятие отображения. Действительные числа и их основные свойства. Ограниченные множества действительных чисел и их верхние и нижние грани. Теорема о вложенных отрезках. Числовые последовательности и их пределы. Лемма Больцано—Вейерштрасса и Бореля. Бесконечно большие и бесконечно малые последовательности. Числовые ряды и признаки их сходимости. Функции одного переменного. Равномерная непрерывность. Производная функции одного переменного. Теоремы Ролля и Лагранжа о конечном приращении. Правило Лопиталья. Локальные экстремумы функции. Исследование функций. Формула Тейлора. Интегрирование функции одного переменного. Неопределенный интеграл и его свойства. Определенный интеграл. Теорема о среднем. Производная интеграла по верхнему пределу и формула Ньютона-Лейбница. Замена переменных в определенном интеграле. Интегрирование по частям. Несобственные интегралы и признаки их сходимости. Функции нескольких переменных. Дифференцируемость: частные производные, полный дифференциал и его геометрический смысл. Градиент. Производная по направлению. Необходимые и достаточные условия локального экстремума функции, теорема о неявной функции.

Тема 2. Линейная алгебра

Определение векторного пространства. Свойства линейно зависимых и линейно независимых систем векторов. Понятие ранга системы векторов. Линейная оболочка системы векторов. Операции с подпространствами. Прямая сумма подпространств. Связь размерностей суммы и пересечения двух подпространств. Матрицы и операции с ними. Системы линейных алгебраических уравнений. Матрица системы, теорема о ранге матрицы, условия существования решения системы при любой правой части. Условие единственности решения для совместной системы. Множества решений однородной и неоднородной систем, их размерность. Общее решение совместной системы. Возможность задания любого аффинного многообразия в R^n как множества решений некоторой системы линейных уравнений. Свойства систем с квадратной матрицей. Общее понятие линейного оператора

Матрицы как линейные операторы в пространствах вида R^n . Образ и ядро линейного оператора, суперпозиция линейных операторов. Линейные преобразования векторных пространств. Собственные векторы и собственные числа. Характеристический многочлен матрицы. Алгебраическая и геометрическая кратности собственного числа. Линейная независимость системы собственных векторов, соответствующих разным собственным числам. Положительно определенные, отрицательно определенные и полуопределенные симметричные матрицы. Понятие билинейной формы. Скалярное произведение, его примеры в пространстве R^n . Ортогональное дополнение подпространства. Неравенство Коши-Буняковского-Шварца. Квадратичные формы, приведение к каноническому виду. Закон инерции квадратичных форм.

Тема 3. Обыкновенные дифференциальные уравнения

Система дифференциальных уравнений первого порядка. Теорема существования и единственности решения. Система линейных дифференциальных уравнений первого порядка. Вид общего решения. Линейное дифференциальное уравнение n -го порядка. Линейное однородное уравнение. Фундаментальная система решений. Определитель Вронского. Линейное неоднородное уравнение. Линейное дифференциальное уравнение с постоянными коэффициентами. Характеристическое уравнение. Вид общего решения однородного уравнения. Вид частного решения в случае задания правой части квазимногочленом. Разностные уравнения. Методы приближенного интегрирования обыкновенных дифференциальных уравнения. Понятие устойчивости и асимптотической устойчивости. Функция Ляпунова и её свойства. Теорема Ляпунова об устойчивости. Линеаризация уравнения в окрестности стационарной точки. Теорема Ляпунова об асимптотической устойчивости по первому приближению.

Тема 4. Теория вероятностей

Предмет и задачи теории вероятностей. Детерминированные и статистические закономерности в экономике и управлении. Понятие статистической устойчивости. Элементы комбинаторики. Правило суммы и правило произведения. Перестановки, размещения и сочетания без повторений. Перестановки, размещения и сочетания с повторениями. Случайные события, их виды. Операции над событиями как операции

над множествами. σ -алгебра событий. Вероятностное пространство. Аксиоматическое построение теории вероятностей. Обобщенная теорема сложения вероятностей. Условные вероятности. Независимость событий. Формула полной вероятности. Формула Байеса. Простейшие примеры применения теории вероятностей в экономике и управлении. Последовательность независимых испытаний. Формула Бернулли. Формула Пуассона. Понятие о зависимых испытаниях. Последовательности испытаний в экономике и управлении. Случайная величина и ее функция распределения. Свойства функции распределения. Дискретная случайная величина. Ряд распределения дискретной случайной величины. Функция распределения дискретной случайной величины. Числовые характеристики дискретной случайной величины: математическое ожидание, дисперсия, среднее квадратичное отклонение. Биномиальный, гипергеометрический, геометрический, отрицательный биномиальный и пуассоновский законы распределения и их применение в экономике. Абсолютно непрерывная случайная величина. Функция распределения и функция плотности распределения абсолютно непрерывной случайной величины. Свойства функции плотности распределения. Числовые характеристики непрерывной случайной величины: математическое ожидание, дисперсия, среднее квадратичное отклонение. Общее понятие случайной величины как измеримой функции. Понятие о математическом ожидании как интеграле Лебега. Теорема о разложении случайной величины. Примеры сингулярных случайных величин. Примеры смешанных случайных величин в экономике. Центральные моменты случайной величины. Производящая функция случайной величины. Характеристическая функция случайной величины. Свойства производящей функции. Асимметрия и эксцесс случайной величины. Квантили и процентные точки случайной величины. Медиана и мода случайной величины. Случайный вектор. Функция распределения случайного вектора, ее свойства Ковариация и коэффициент корреляции как меры близости связи между компонентами случайного вектора к линейной функциональной. Ковариационная матрица. Корреляционная матрица. Матрица взаимных ковариаций. Многомерный нормальный закон распределения. Многомерный равномерный закон распределения. Функция одной случайной величины. Функция

нескольких случайных величин. Формула композиции. Композиция равномерных случайных величин. Композиция нормальных случайных величин. Логарифмически нормальный закон распределения: механизм образования, примеры использования в социально-экономических задачах. Распределения χ^2 , Стьюдента и Фишера-Снедекора. Условные законы распределения. Условный ряд распределения (для дискретных случайных величин), условная плотность распределения (для непрерывных случайных величин). Условное математическое ожидание. Неравенство Чебышёва. Последовательность случайных величин. Сходимость почти наверное. Сходимость по вероятности. Сходимость по распределению. Массовые случайные явления в экономике. Теорема Чебышёва и оценка математического ожидания. Теорема Бернулли и оценка вероятности. Усиленный закон больших чисел. Обсуждение условий статистической устойчивости. Понятие о центральной предельной теореме. Теорема Леви. Теорема Ляпунова. Теорема Линдеберга.

Тема 5. Элементы математической статистики.

Предмет и задачи математической статистики. Типы признаков в экономике и управлении: интервальные, порядковые, ранговые, дихотомические. Генеральная и выборочная совокупности. Конкретная и случайная выборки. Вариационный ряд. Статистический ряд распределения. Интервальный вариационный ряд. Оценка числовых характеристик генеральной случайной величины с помощью выборочной случайной величины. Выборочное среднее как оценка математического ожидания. Относительная частота как оценка вероятности. Выборочная дисперсия как оценка дисперсии. Оценка функции распределения и плотности функции распределения генеральной случайной величины. Полигон частот. Гистограмма. Кумулятивная кривая. Соотношение между предельной ошибкой выборки, уровнем значимости (риском) и объемом выборки. Использование этого соотношения в организации выборочных обследований. Точечная оценка параметра генеральной совокупности. Свойства точечных оценок параметров: состоятельность, несмещенность и эффективность оценок параметров. Свойства выборочного среднего, выборочной дисперсии, исправленной выборочной дисперсии. Методы построения точечных оценок. Метод моментов. Метод максимального правдоподобия. Построение оценок параметров распределений случайных величин, применяемых в экономике и

управлении. Интервальная оценка параметра генеральной совокупности. Точные интервальные оценки вероятности и математического ожидания. Элементы эконометрики. Обобщенная линейная модель множественной регрессии. Обобщенный и реализуемый обобщенный метод наименьших квадратов. Метод взвешенных наименьших квадратов. Основы анализа временных рядов. Сглаживание. Выделение тренда сезонной составляющей. Модели авторегрессии и скользящего среднего (ARMA–модели). Модели нестационарных временных рядов. (ARIMA–модели). Модели бинарного выбора. Логит– и пробит–модели.

Тема 6. Математическое программирование и теория игр

Нелинейное программирование. Гладкие задачи оптимизации с ограничениями в виде равенств и неравенств. Необходимые условия локального экстремума первого порядка: правило множителей Лагранжа. Необходимые условия второго порядка, достаточные условия второго порядка локального экстремума. Выпуклые множества, выпуклые и вогнутые функции и их основные свойства. Теорема о минимаксе. Общая задача выпуклого программирования. Теорема Куна-Таккера. Линейное программирование: прямая и двойственная задачи. Теоремы двойственности. Экономическая интерпретация двойственной задачи и теорем двойственности. Транспортная задача в матричной и сетевой постановке, задача о кратчайшем пути, задача о максимальном потоке. Метод потенциалов для транспортной задачи в матричной постановке. Многокритериальная оптимизация: эффективные точки (точки Парето) в сильном и слабом смыслах, линейная свертка критериев. Матрица последствий и матрица сожалений, их экономическая интерпретация. Принятие решений в условиях полной неопределенности: критерии Вальда, Сэвиджа, Гурвица. Принятие решений в условиях частичной неопределенности: критерии максимизации ожидаемого дохода, минимизации ожидаемых сожалений. Байесовский подход к принятию решений и его экономические приложения. Математические модели конфликтных ситуаций. Антагонистическое поведение игроков. Матричная игра, ее геометрическая и экономическая интерпретация. Чистые и смешанные стратегии. Оптимальные стратегии. Основная теорема теории матричных игр. Матричная игра как модель сотрудничества и конкуренции. Некооперативное поведение игроков. Биматричная

игра, ее экономическая интерпретация. Чистые и смешанные стратегии. Максиминные стратегии. Кооперативное поведение игроков в биматричной игре. Множество Парето. Переговорное множество. Арбитражная схема Нэша. Исследование сотрудничества и конкуренции производителей на рынке одного товара с помощью непрерывного обобщения биматричной игры. Кооперативные игры многих лиц. Коалиции, дележи, ядро игры, решения по фон Нейману-Моргенштерну. Вектор Шепли и теорема Шепли. Нетранзитивность правила большинства и квалифицированного большинства. Теорема Эрроу.

Тема 7. Марковские процессы и элементы теории массового обслуживания

Дискретный случайный процесс с дискретным временем. Марковская цепь. Переходные вероятности. Нормированное условие. Размеченный граф состояний. Вероятности состояний и формулы их вычисления для однородной и неоднородной марковской цепи. Дискретный марковский случайный процесс с непрерывным временем. Плотности вероятностей перехода. Система дифференциальных уравнений Колмогорова. Пуассоновский поток. Связь пуассоновских потоков событий с дискретными марковскими случайными процессами с непрерывным временем. Потоки Пальма. Потоки Эрланга. Предельные вероятности. Предельные вероятности состояний однородной марковской цепи. Предельные вероятности состояний системы, в которой протекает дискретный однородный марковский процесс с непрерывным временем. Процесс гибели и размножения. Циклические процессы. Ветвящиеся циклические процессы. Приближенная замена немарковских процессов марковским методом псевдосостояний. Процесс гибели и размножения. Циклические процессы. Ветвящиеся циклические процессы. Приближенная замена немарковских процессов марковским методом псевдосостояний. Структура и классификация систем массового обслуживания (СМО). Организация СМО: характер потоков заявок, дисциплина обслуживания, число каналов, производительность каналов. Показатели эффективности работы СМО. Классификация систем массового обслуживания. Задачи анализа разомкнутой СМО с отказом. Условия существования стационарного режима работы СМО с отказом. Многоканальная СМО. Финальные вероятности. Вычисление показателей эффективности системы.

Тема 8. Динамическое программирование

Постановка и экономическая интерпретация задач целочисленного программирования. Методы отсечения. Общая характеристика комбинаторных методов решения задач целочисленного программирования. Метод ветвей и границ. Дискретное программирование. Фиктивные переменные. Специфика задач динамического программирования. Основные предположения о целевой функции. Параметр состояния, уравнение состояния. Принцип оптимальности Беллмана. Рекуррентное соотношение. Задача об оптимальном распределении инвестиций. Задача о наиболее рациональном использовании рабочей силы. Задача о замене оборудования. Динамическая задача управления запасами и ее решение методом динамического программирования. Сведение задачи динамического программирования к задаче о кратчайшем пути.

Тема 9. Принцип максимума Понтрягина

Простейшая задача вариационного исчисления в форме Лагранжа и ее экономический смысл. Функция Гамильтона. Условия оптимальности. Задача оптимального управления, ее экономическая интерпретация. Принцип максимума Понтрягина, доказательство принципа максимума с помощью формализма Лагранжа. Применение принципа максимума в моделях оптимального экономического роста. Оптимальный экономический рост в модели Солоу. Обобщение принципа максимума Понтрягина для задач оптимального управления распределенными системами.

Тема 10. Моделирование сфер потребления и производства

Основная задача микроэкономического анализа. Отношение предпочтения на множестве потребительских наборов и его свойства. Функции полезности. Закон Госсена. Кривые безразличия. Предельная норма замещения. Бюджетная линия. Математическая формализация и решение модели поведения потребителя. Исследование функции спроса потребителя. Свойства функции спроса. Реакция потребителя на изменение цен и дохода. Уравнение Слуцкого. Эффект дохода. Эффект замены. Классификация товаров в зависимости от значения коэффициентов Слуцкого. Классификация товаров в зависимости от знака частных производных функции спроса по доходу и ценам. Модели производственно-технологического

уровня. Общее представление. Материальные балансы. Производственные функции в широком смысле. Множество производственных возможностей. Производственные функции выпуска продукции. Общие свойства производственных функций выпуска продукции. Предельные и средние характеристики. Предельная и средняя эффективности. Экономическая область. Эластичность выпуска по отношению к изменению затрат ресурсов. Отдача от расширения масштабов производства. Эластичность производства. Возможность замещения ресурсов. Изокванты. Предельная норма замещения. Изоклинали. Эластичность замещения ресурсов. Основные виды производственных функций выпуска: Степенные производственные функции выпуска (функции Кобба-Дугласа). Производственные функции с постоянной эластичностью замещения ресурсов. Производственные функции с постоянными пропорциями. Линейная производственная функция. Производственные функции затрат ресурсов. Определение функции затрат и ее свойства. Связь средних затрат с предельными. Эластичность затрат по выпуску и ее связь с эластичностью производства. Функция затрат для однородной производственной функции выпуска. Модель поведения фирмы в условиях совершенной конкуренции. Исследование модели в зависимости от показателя степени однородности производственной функции. Модели поведения фирмы в условиях несовершенной конкуренции. Монополия и монополия. Конкуренция среди немногих. Олигополия. Олигополия. Модели дуополии.

Тема 11. Модели общего экономического равновесия

Модель общего экономического равновесия Вальраса. Постановка задачи в общем виде. Составление и решение системы уравнений модели. Функция избыточного спроса. Закон Вальраса. Система равновесных цен. Парето - оптимальность равновесия Вальраса. Межотраслевые модели. Статическая модель межотраслевого баланса. Линейная модель баланса межотраслевых материально-вещественных связей. Балансы трудовых ресурсов, основных производственных фондов и цен. Модель ценообразования на уровне стоимости. Баланс трудовых ресурсов. Баланс основных производственных фондов. Динамическая модель межотраслевого баланса. Открытая и замкнутая динамические модели.

Сбалансированная траектория развития для линейной модели с продуктивной матрицей прямых затрат. Равновесные цены. Обобщение статической модели межотраслевого баланса. Оптимизация выбора технологии производства при ограничениях на трудовые ресурсы и основные производственные фонды. Магистральные модели. Магистральная модель накопления основных производственных фондов в конце планового периода. Модель Неймана расширяющейся экономики.

Тема 12. Статистические методы в экономико-математическом моделировании

Повторяемость и массовость в экономических процессах, ограничения использования ретроспективной информации для прогнозирования, основные направления применения методов математической статистики в экономике, примеры классических моделей. Понятие эконометрической модели, этапы формализации, традиционные методы эконометрии – регрессионный анализ и анализ временных рядов, современные социально-экономические приложения – многомерный статистический анализ, границы применимости статистических моделей. Генеральная совокупность, выборка и способы ее организации, репрезентативность выборки, эмпирические функции распределения, выборочные моменты, порядковые статистики и вариационный ряд. Статистическое оценивание параметров экономических моделей: постановка задачи, статистики, свойства статистических оценок, состоятельность, несмещенность, эффективность, функция правдоподобия, метод моментов, интервальные оценки, общая логика Байесовского метода оценивания. Статистическая проверка гипотез: гипотезы о виде распределения, о значениях параметров генеральной совокупности, об однородности выборок, о виде модели, логическая схема статистического критерия, принцип отношения правдоподобия, характеристики статистического качества, критерии согласия, Пирсона, Стьюдента.

Тема 13. Информационное и компьютерное обеспечение экономико-математических моделей

Типы информационных систем (ИС) и информационных технологий (ИТ). Стратегическое влияние информационных технологий на бизнес. Стратегии предприятия в области информационных технологий. Классификация

информационных систем. Информационные системы и качество управления. Информационные системы в логистике, маркетинге, управлении производством, управлении кадрами, управлении финансами, управлении проектами. Информационные системы в банковской деятельности и в сфере услуг. Современные подходы к созданию информационных систем: технический, поведенческий, социотехнический. Развитие информационных систем и организационные изменения. Характеристики организации информационной эры. Эволюция межорганизационных информационных систем. Электронная коммерция. Функции организации и управления информационными технологиями. Оценка эффективности информационных систем. Модель анализа этических, социальных и политических последствий использования ИТ.

Тема 14. Системы поддержки принятия решений и инструментальные средства управления бизнес-процессами

Неструктурированные и слабо структурированные процессы принятия решений. Характеристики систем принятия решений (СПР). Элементы СПР. Построение СПР. Основные проблемы групповых процессов принятия решений. Системы поддержки групповых решений (СПГР). Характеристики СПГР. Функциональное управление и функционально-ориентированная организация. Определение процессного подхода к управлению. Понятие объекта и связи. Отражение процессного подхода в международных стандартах. Основные положения системного анализа. Рассмотрение организации как системы. Основные положения структурного анализа. Понятие процесса. Классификация процессов. Основные элементы процесса и его окружение. Характеристики бизнес-процесса. Эталонные и референтные модели.

Тема 15. Моделирование бизнес-процессов

Понятие о моделировании деятельности. Понятие метода моделирования процессов. Функциональное моделирование. Основные принципы структурного моделирования сложных систем. Функциональные и динамические модели экономических процессов. Классификация экономических моделей. Особенности бизнес-процессов, как объектов моделирования. Принципы функционального моделирования фирмы. Эволюция развития методологий описания. Основы

разработки моделей бизнес-процессов. Моделирование потоков данных. Цели и основные понятия моделирования данных. Назначение диаграмм потоков данных. Синтаксис и семантика диаграмм потоков данных. Основные методологии описания процессов. Методология SADT. Методология DFD. Методология ARIS. Методология UML. Стандарты IDEF. Сравнительный анализ методологий моделирования. Инструментальные системы для моделирования бизнеса. Требования к инструментальным системам для моделирования бизнеса.

Тема 16. Управление бизнес-процессами

Методы анализа процессов. Анализ временных характеристик процесса и параметров ресурсов. Анализ стоимостных характеристик процессов. Контроллинг и мониторинг процессов. Аттестация процессов. Бенчмаркинг. Совершенствование процессов. Бизнес-инжиниринг. Реинжиниринг (business process reengineering). Методы проведения бизнес-реинжиниринга: сбор информации от экспертов; моделирование бизнес-процессов; обсуждение проекта методом "мозгового штурма". Совершенствование процессов (business process improvement). Зрелые и незрелые организации. Зрелость процесса. Организация улучшений. Администрирование совершенствования процессов. Система сбалансированных показателей (Balanced Scorecard) как средство стратегического и оперативного управления. Управление операционными рисками. Понятие операционного риска, управление рисками. Управление процессами в системе менеджмента качества. Принципы менеджмента качества. Системы менеджмента качества. Информационная поддержка управления процессами. Технология Workflow.

Тема 17. Методологии управления производством

Объемно-календарное планирование (MPS). Планирование материальных запасов (MRP). Статистическое управление запасами (SIC). Планирование производственных мощностей (CRP). Планирование производственных ресурсов (MRPII). Управление ресурсами предприятия (ERP). Основные функции компьютерных MRPII систем: регистрация данных об изделиях, планирование деятельности, управление операциями, обслуживание клиентов, управление финансами и учет. Обобщенный алгоритм функционирования компьютерных MRPII систем: источники данных для планирования и управления производственными

процессами, процедуры планирования и управления производственными процессами. Задачи о нахождении эффективности внедрения систем управления производством.

3. Учебно-методическое и информационное обеспечение

Нормативные акты

1. Гражданский Кодекс Российской Федерации (часть четвертая) № 30-ФЗ от 18.12.2006 г. (в редакции последующих законов).
2. Закон Российской Федерации «О государственной тайне» № 5485-1 от 21.07.1993 г. (в редакции последующих законов).
3. Федеральный Закон Российской Федерации «О коммерческой тайне» от 29.07.2004 г. № 98-ФЗ (в редакции последующих законов).
4. Федеральный Закон Российской Федерации «Об информации, информационных технологиях и о защите информации» от 27.07.2006 г. № 149-ФЗ (в редакции последующих законов).
5. Федеральный Закон Российской Федерации «Об электронной цифровой подписи» от 10.01.2002 г № 1-ФЗ (в редакции последующих законов).

Литература

1. Фихтенгольц Г.М. Курс дифференциального и интегрального исчисления. В 3-х тт.: учебник / Г.М. Фихтенгольц. — СанктПетербург: Лань, 2019.
2. Кудрявцев Л.Д. Курс математического анализа. В 3 т. М., Юрайт, 2020.
3. Ильин В.А., Садовничий В.А., Сендов Б.Х. Математический анализ. Т. 1,2. М., Юрайт, 2019.
4. Солодовников А.С., Бабайцев В.А., Браилов А.В. Математика в экономике: Учебник для вузов: Ч. 1–3. – М.: Финансы и статистика, 2013.
5. Сборник задач по курсу «Математика в экономике». В 3-х ч. / под ред. В.А. Бабайцева и В.Б. Гисина. – М.: Финансы и статистика; ИНФРА-М, 2013.
6. Демидович Б.П. Сборник задач и упражнений по математическому анализу: учебное пособие / Б.П. Демидович. — СанктПетербург: Лань, 2019.
7. Воеводин В.В. Линейная алгебра. М., Лань, 2008.
8. Гельфанд И.М. Лекции по линейной алгебре. М., Добросвет КДУ, 2006.

9. Филлипов А.Ф. Введение в теорию дифференциальных уравнений. М. Ленард, 2015.
10. Гмурман В.Е. Теория вероятностей и математическая статистика: учебник / В.Е. Гмурман. – Москва: Юрайт, 2007, 2012. – 479 с. – То же [Электронный ресурс]. – 2018.
11. Сборник задач по теории вероятностей, математической статистике и теории случайных функций: учебное пособие / под общей ред. А.А.Свешникова. – Москва: Лань, 2013.
12. Соловьев В. И. Анализ данных в экономике. Теория вероятностей и прикладная статистика в Microsoft Excel : учебник / В. И. Соловьев. - Москва: КНОРУС, 2019.
13. Айвазян С. А. Эконометрика – 2 [Электронный ресурс]: продвинутый курс с приложениями в финансах: учебник. – Москва: Магистр, 2014. – Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=472607>.
14. Бывшев В.А. Эконометрика. – М.: Финансы и статистика, 2008
15. Методы оптимальных решений. Практикум : учебное пособие / под ред. В.А. Колемаева, В.И. Соловьева. – Москва : КНОРУС, 2017. – 194 с.
16. Лабскер Л.Г., Бабешко Л.О. Игровые методы в управлении экономикой и бизнесом. – М.: Дело, 2001.
17. Юдин Д.Б., Гольштейн Е.Г. Линейное программирование. М.: Наука, 1969.
18. Фиакко А.В., Мак-Кормик Г.Р. Нелинейное программирование. М.: Мир, 1972.
19. Поляк Б.Т. Введение в оптимизацию. М.: Наука, 1983.
20. Подиновский В.В., Ногин В.Д. Парето-оптимальные решения многокритериальных задач. М.: Наука, 1982.
21. Мулен Э. Теория игр с примерами из математической экономики. М.: Мир, 1985.
22. Акинин и др. Математические и инструментальные методы экономики. Издательство: КноРус , 2012,
23. Воркуев Б.Л.. Количественные методы исследования в микро и макроэкономике. Издательство: ТЕИС , 2010.
24. Бережная Е.В., Бережной В.И. Математические методы в моделировании

- экономических систем. – 2-е изд., перераб. и доп. М.: Финансы и статистика, 2006
- 25.Васильева Л.Н. Моделирование микроэкономических процессов и систем. – М.: Издательство: КноРус , 2012.
- 26.Моделирование систем и процессов : учебник для академического бакалавриата / В. Н. Волкова [и др.] ; под ред. В. Н. Волковой, В. Н. Козлова. — Москва: Юрайт, 2015.
- 27.Горбенко А.О. Информационные системы в экономике. М., БИНОМ. Лаборатория знаний, 2015.
- 28.Когнитивная бизнес-аналитика: Учебник / Под науч. ред. д-ра техн. наук, проф. Н.М. Абдикеева. –М.: ИНФРА-М, 2011.
- 29.Информационные системы в экономике: Учеб. пособие/ Под ред. Д.В. Чистова. – М.: ИНФРА-М, 2019.
- 30.Литвина Е. М., Дегтярев А. В., Пятовский С. Е. и др. Формализация и моделирование бизнес-процессов (структурный подход). Издательство: МАИ-ПРИНТ, 2010.
- 31.Саак А.Э., Пахомов Е.В., Тюшняков В.Н. Информационные технологии управления: Учебник для вузов. – СПб.: Питер, 2013.

4. Примеры заданий

Задание 1. Выберите правильные варианты ответа.

Вопрос: SCM – это система для

Варианты ответов:

- для управления взаимодействием с клиентами
- приложения для управления цепочками поставок
- приложения для управления операциями и производством
- для автоматизации бизнес-процессов и процессов управления данными, начиная с концептуального планирования и заканчивая производством изделия

Задание 2. Выберите правильные варианты ответа.

Вопрос: Полный цикл использования технологий Data Mining

Варианты ответов:

- постановка задачи, исследование данных, подготовка данных для анализа, анализ данных, интерпретация результатов.
- разработка стратегии, планирование, мониторинг и контроль, анализ.
- анализ, планирование, разработка, внедрение.
- разработка стратегии, формирование инициатив, выбор и усовершенствование бизнес-процессов.
- планирование, действие, проверка, корректировка

Задание 3. Выберите правильные варианты ответа.

Вопрос: Эконометрическая модель экономической системы отражает

Варианты ответов:

- динамику изменения какого-либо экономического показателя.
- взаимосвязь количественных характеристик экономического объекта.
- изменение процесса во времени.
- темпы роста и прироста экономического явления.

Задание 4. Выберите правильные варианты ответа.

Вопрос: Классический метод нахождения оценок коэффициентов регрессионной модели

Варианты ответов:

- метод наименьших квадратов (МНК)
- метод линеаризации
- метод дифференцирования
- построение тренда
- метод моментов
- метод максимума правдоподобия

Задание 5. Выберите правильные варианты ответа.

Вопрос: Случайные возмущения модели гомоскедастичны, когда

Варианты ответов:

- дисперсия остатков модели является константой
- равен нулю коэффициент детерминации модели
- коэффициенты модели некоррелированы
- равен единице коэффициент детерминации модели

Задание 6. Выберите правильные варианты ответа.

Вопрос: К видам имитационных методов относятся

Варианты ответов:

- дискретно-событийные методы;
- метод Монте-Карло
- корреляционные методы;
- регрессионные методы;
- динамическое программирование.

Задание 7. Решите задачу. Выберите правильный вариант ответа

Вопрос: Проверить выполнение условий Куна-Таккера в точке $(\frac{2}{\sqrt{5}}, \frac{4}{\sqrt{5}})$ для задачи математического программирования $x+2y \rightarrow \max, x^2+y^2 \leq 4, x \geq 0, y \geq 0$

Варианты ответов:

- все условия выполняются
- не выполняется только условие $\lambda \geq 0$
- не выполняется только условие дополняющей нежесткости
- все ответы не верны

Задание 8. Решите задачу

В матричной игре двух игроков с наборами чистых стратегий (A1, A2, A3) и (B1, B2, B3) укажите ситуации, равновесные по Нэшу

	B1	B2	B3
A1	2	3	5

	B1	B2	B3
A1	3	1	3

A2	4	2	3
A3	1	4	6

A2	1	5	3
A3	1	4	2

Варианты ответов:

- (A2, B2), (A3, B2), (A1, B3), (A3, B3).
- (A2, B3)
- (A2, B2)
- (A1, B3), (A3, B3).

Задание 9. Решите задачу

В матричной игре двух игроков с наборами чистых стратегий (A1, A2, A3) и (B1, B2, B3) укажите ситуации, оптимальные по Парето

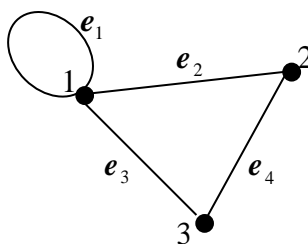
	B1	B2	B3
A1	2	3	5
A2	4	2	3
A3	1	4	6

	B1	B2	B3
A1	3	3	3
A2	1	5	3
A3	1	4	2

Варианты ответов:

- (A2, B2), (A3, B2), (A1, B3), (A3, B3).
- (A2, B3)
- (A2, B2)
- (A1, B3), (A3, B3).

Задание 10. Укажите матрицу инцидентности графа:



$$\text{a) } B = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 & 0 \\ 0 & 1 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 1 & 1 \end{pmatrix}$$

$$\text{b) } B = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 & 0 \\ 1 & 1 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 1 & 1 \end{pmatrix}$$

$$\text{c) } B = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 1 & 1 \\ 0 & 1 & 1 & 1 \end{pmatrix}$$

$$\text{d) } B = \begin{pmatrix} 1 & -1 & 1 & 0 \\ -1 & 1 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & -1 & -1 \end{pmatrix}$$

Варианты ответов:

- a)
- b)
- c)
- d)

Задание 11.

Задача линейного программирования на максимум имеет решения, если

Варианты ответов:

- множество допустимых планов не пусто, а целевая функция не ограничена сверху
- множество допустимых планов не пусто, а целевая функция ограничена сверху
- множество допустимых планов является пустым
- множество допустимых планов пусто, а целевая функция ограничена сверху

Задание 12. Выберите правильные варианты ответа.

Решение задачи методом динамического программирования на некотором шаге при произвольном состоянии после предыдущих шагов дает

Варианты ответов:

- оптимальное управление на данном шаге
- условно-оптимальное управление на данном шаге
- последовательность условно-оптимальных управлений
- решение задачи

Задание 13. Выберите правильный вариант ответа.

Построить доверительный интервал, в котором с вероятностью 0,9876 заключена генеральная средняя, если по результатам повторной выборки объема 100 получена выборочная средняя $\bar{x}=100$ и дисперсия $\sigma^2 = 64$.

Варианты ответов:

-(90;110)

-(95;105)

-(93;103)

-(98;102)

Задание 14.

Выберите правильные варианты ответа.

Стохастическая матрица марковской цепи

0,2	0,6	0	0,2
0,4	0,1	0,2	0,3
0,2	0,3	0,2	0,3
0	0,5	0	0,5

Вероятность перехода из четвертого состояния во второе за четыре шага

Варианты ответов:

-0,5

-0,125

-0,35

-0

Задание 15. Выберите правильные варианты ответа. Случайная величина, являющаяся суммой пяти случайных независимых величин, имеющих показательное распределение с одним параметром, имеет

Варианты ответов:

-нормальное распределение

-показательное распределение

-лог-нормальное распределение

- гамма-распределение

Задание 16. Приведен граф состояний системы массового обслуживания. Определите среднее число отклонённых заявок за период, если интенсивность получения заявок ($S_1 \rightarrow S_2$) равна 2 ед/период, интенсивность наступления моментов окончания обслуживания заявки ($S_2 \rightarrow S_1$) 3 ед/период.



Варианты ответов:

-4/5

-4

-5/4

-2

Задание 17.

Производственная функция имеет вид

$$X = 3K^{0.5}L^{0.3}$$

X- выпуск, L - труд, K- остальные ресурсы

Эластичность выпуска по отношению к изменению затрат ресурсов равна

Варианты ответов:

-3

-0.5

-0.3

-0.8

Задание 18. Множество эффективных распределений выигрыша, устойчивых к отклонениям любой коалиции игроков

Варианты ответов:

- множество Парето

- С-ядро

- множество состояний равновесных по Нэшу

- эффективное множество

Задание 19. Область программных продуктов, предназначенных для улучшения дизайна информационных систем это

Варианты ответов:

- MRPII
- система принятия решений (СПР).
- технология WorkFlow
- Методология UML
-

Задание 20. ERP система- это

Варианты ответов:

- организационная стратегия интеграции производства и операций, управления трудовыми ресурсами, финансового менеджмента и управления активами, ориентированная на непрерывную балансировку и оптимизацию ресурсов предприятия
- определение количественных показателей каждого выпускаемого изделия в привязке к временным отрезкам планирования в пределах всего срока планирования
- компьютерная система, решающая задачи предприятия
- все приведенные определения верны

5. Оценка результатов сдачи вступительных испытаний

Вступительное испытание осуществляется в форме компьютерного тестирования и оценивается из расчета 100 баллов. В тесте содержится 20 тестовых заданий. Выполнение любого из 20 тестовых заданий оценивается 5 баллами. Балльной оценкой результата сдачи вступительного испытания является сумма набранных баллов за правильные ответы тестовых заданий.