

**МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**  
**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ**  
**УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ**  
**«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ТРАНСПОРТА»**  
**(РУТ (МИИТ))**

**АННОТАЦИЯ К**  
**РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

**Введение в стохастический анализ**

Направление подготовки: 01.03.02 – Прикладная математика и информатика

Направленность (профиль): Математические модели в экономике и технике

Форма обучения: Очная

**Общие сведения о дисциплине (модуле).**

Целями освоения дисциплины «Введение в стохастический анализ» являются:

- фундаментальная подготовка в области теории случайных процессов;
- формирование у обучающегося компетенций в области стохастического анализа, необходимых при решении различных задач, возникающих в экономике, финансах, промышленности.

Задачей освоения данной дисциплины является:

- овладение современным математическим аппаратом для дальнейшего использования в приложениях.

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 3 з.е. (108 академических часа(ов)).