

ИНСТИТУТ ФИНАНСОВЫХ ТЕХНОЛОГИЙ И ЭКОНОМИЧЕСКОЙ БЕЗОПАСНОСТИ
КАФЕДРА ФИНАНСОВОГО МОНИТОРИНГА

ОДОБРЕНО УМС ИФТЭБ

Протокол № 545-2

от 31.05.2023 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ
МЕТОДЫ ИНТЕЛЛЕКТУАЛЬНОГО АНАЛИЗА ДАННЫХ

Направление подготовки
(специальность)

[1] 38.05.01 Экономическая безопасность

Семестр	Трудоемкость, кред.	Общий объем курса, час.	Лекции, час.	Практич. занятия, час.	Лаборат. работы, час.	В форме практической подготовки/В	СРС, час.	КСР, час.	Форма(ы) контроля, экз./зач./КР/КП
8	2	72	28	14	14		16	0	3
Итого	2	72	28	14	14	0	16	0	

АННОТАЦИЯ

Дисциплина посвящена изучению теоретических основ, методов и инструментария анализа данных.

В курсе рассматриваются основные цели и задачи анализа данных, состав и эволюция традиционных и формирования новых технологий анализа

Дисциплина направлена на формирование у студентов навыков анализа данных, освоения практической работы с классическими и современными методами анализа данных.

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Целью преподавания дисциплины является формирование базовых знаний о сущности данных как результатов измерения, методах и моделях исследования данных, освоение инструментария современных технологий анализа в практической деятельности

Задачи дисциплины:

- изучение основ теории измерения, методов и моделей описания взаимосвязей, выявления/конструирования новых паттернов, понятий, переменных в имеющихся данных, формирования научной базы и методологии решения различных задач, освоение теоретического материала по отдельным разделам дисциплины;
- получение практических навыков решения ряда наиболее распространенных задач в области анализа данных;
- формирование у обучающихся целостного представления об анализе данных, основных проблемах применения традиционных технологий исследования данных, системного подхода к изучению современных технологий анализа данных и решению конкретных задач в этой сфере.

2. МЕСТО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП ВО

Дисциплина опирается на компетенции, знания и навыки, полученные студентами при изучении таких дисциплин, как "Аналитическая геометрия", "Математический анализ", "Дискретная математика", "Линейная алгебра", "Теория вероятностей и математическая статистика", "Математическая статистика", "Численные методы", "Эконометрика (специальные главы)", "Многомерные статистические методы и прогнозирование". В свою очередь, знание данной дисциплины необходимо при изучении таких дисциплин, как «Интеллектуальный анализ данных», «Анализ рисков», «Прикладная аналитика», при прохождении учебной практики и производственной практики (НИР), а также для подготовки выпускной квалификационной работы (ВКР).

3. ФОРМИРУЕМЫЕ КОМПЕТЕНЦИИ И ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ

Универсальные и(или) общепрофессиональные компетенции:

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции
--------------------------------	--

Профессиональные компетенции в соответствии с задачами и объектами (областями знаний) профессиональной деятельности:

Задача профессиональной деятельности (ЗПД)	Объект или область знания	Код и наименование профессиональной компетенции; Основание (профессиональный стандарт-ПС, анализ опыта)	Код и наименование индикатора достижения профессиональной компетенции
информационно-аналитический			
поиск и оценка источников информации, анализ данных, необходимых для проведения экономических расчетов; мониторинг текущего экономического и финансового состояния хозяйствующих субъектов на предмет надежности ресурсного потенциала, стабильности и устойчивости их деятельности; мониторинг экономических процессов, сбор, анализ и оценка информации, имеющей значение для обеспечения экономической безопасности; выявление экономических рисков и угроз экономической безопасности; обработка массивов статистических данных, экономических показателей, характеризующих социально-экономические	общественные отношения в сфере обеспечения законности и правопорядка, экономической безопасности; события и действия, создающие угрозы экономической безопасности; свойства и признаки материальных носителей разыскной и доказательственной информации; поведение хозяйствующих субъектов, их затраты, риски и результаты экономической деятельности, функционирующие рынки, финансовые и информационные потоки, производственные процессы.	ПК-5 [1] - Способен строить стандартные теоретические и эконометрические модели; проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности <i>Основание:</i> Профессиональный стандарт: 08.018, 08.022, Анализ опыта: Управление финансовыми (страховыми, налоговыми и иными) рисками в системе экономической безопасности	3-ПК-5[1] - Знать методы построения теоретических и эконометрических моделей; анализа возможных экономических рисков, составления и обоснования прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности ; У-ПК-5[1] - Уметь строить стандартные теоретические и эконометрические модели; проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности; В-ПК-5[1] - Владеть навыками построения теоретических и эконометрических моделей; анализа возможных экономических рисков и их оценки, составления и обоснования прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности

процессы в соответствии с поставленной задачей, анализ, интерпретация, оценка полученных результатов и обоснование выводов; оценка экономической эффективности проектов; моделирование экономических процессов в целях анализа и прогнозирования угроз экономической безопасности; информационно-аналитическое обеспечение предупреждения, выявления, пресечения, раскрытия и расследования экономических и налоговых преступлений; мониторинг взаимосвязи экономических процессов и динамики правонарушений и преступлений;			
---	--	--	--

4. ВОСПИТАТЕЛЬНЫЙ ПОТЕНЦИАЛ ДИСЦИПЛИНЫ

Направления/цели воспитания	Задачи воспитания (код)	Воспитательный потенциал дисциплин
Профессиональное воспитание	Создание условий, обеспечивающих, формирование научного мировоззрения, культуры поиска нестандартных научно-технических/практических решений, критического отношения к исследованиям лженаучного толка (В19)	1.Использование воспитательного потенциала дисциплин/практик «Научно-исследовательская работа», «Проектная практика», «Научный семинар» для: - формирования понимания основных принципов и способов научного познания мира, развития исследовательских качеств студентов посредством их

		вовлечения в исследовательские проекты по областям научных исследований. 2.Использование воспитательного потенциала дисциплин "История науки и инженерии", "Критическое мышление и основы научной коммуникации", "Введение в специальность", "Научно-исследовательская работа", "Научный семинар" для: - формирования способности отделять настоящие научные исследования от лженаучных посредством проведения со студентами занятий и регулярных бесед; - формирования критического мышления, умения рассматривать различные исследования с экспертной позиции посредством обсуждения со студентами современных исследований, исторических предпосылок появления тех или иных открытий и теорий.
Профессиональное воспитание	Создание условий, обеспечивающих, формирование культуры финансовой безопасности (В44)	1.Использование воспитательного потенциала дисциплин профессионального модуля для формирование базовых навыков финансовой безопасности через изучение типологий финансовых махинаций, освоение механизмов обеспечения кибербезопасности в кредитно-финансовой сфере в соответствии с нормативными документами ЦБ РФ, изучение рисков и угроз в рамках процедур кредитования, инвестирования и других механизмов экономической деятельности. 2.Использование воспитательного потенциала дисциплин профессионального модуля для развития коммуникативных компетенций, навыков делового общения, работы в гибких командах в условиях быстроменяющихся внешних факторов за счет изучения учащимися возможностей, методов получения информации,

		ее обработки и принятии решения в условиях оценки многофакторных ситуаций, решения кейсов в области межличностной коммуникации и делового общения. 3.Использование воспитательного потенциала дисциплин профессионального модуля для формирования нравственных и правовых норм.
Профессиональное воспитание	Создание условий, обеспечивающих, формирование ориентации на неукоснительное соблюдение нравственных и правовых норм в профессиональной деятельности (В45)	1.Использование воспитательного потенциала дисциплин профессионального модуля для формирование базовых навыков финансовой безопасности через изучение типологий финансовых махинаций, освоение механизмов обеспечения кибербезопасности в кредитно-финансовой сфере в соответствии с нормативными документами ЦБ РФ, изучение рисков и угроз в рамках процедур кредитования, инвестирования и других механизмов экономической деятельности. 2.Использование воспитательного потенциала дисциплин профессионального модуля для развития коммуникативных компетенций, навыков делового общения, работы в гибких командах в условиях быстроменяющихся внешних факторов за счет изучения учащимися возможностей, методов получения информации, ее обработки и принятии решения в условиях оценки многофакторных ситуаций, решения кейсов в области межличностной коммуникации и делового общения. 3.Использование воспитательного потенциала дисциплин профессионального модуля для формирования нравственных и правовых норм.

5. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Разделы учебной дисциплины, их объем, сроки изучения и формы контроля:

№ п.п	Наименование раздела учебной дисциплины	Недели	Лекции/ Практи. (семинары) / Лабораторные работы, час.	Обязат. текущий контроль (форма*, неделя)	Максимальный балл за раздел**	Аттестация раздела (форма*, неделя)	Индикаторы освоения компетенции
-------	---	--------	--	---	-------------------------------	-------------------------------------	---------------------------------

* – сокращенное наименование формы контроля

** – сумма максимальных баллов должна быть равна 100 за семестр, включая зачет и (или) экзамен

Сокращение наименований форм текущего контроля и аттестации разделов:

Обозначение	Полное наименование
Т	Тестирование
ЛР	Лабораторная работа
КИ	Контроль по итогам

КАЛЕНДАРНЫЙ ПЛАН

Недели	Темы занятий / Содержание	Лек., час.	Пр./сем., час.	Лаб., час.
--------	---------------------------	------------	----------------	------------

Сокращенные наименования онлайн опций:

Обозначение	Полное наименование
ЭК	Электронный курс
ПМ	Полнотекстовый материал
ПЛ	Полнотекстовые лекции
ВМ	Видео-материалы
АМ	Аудио-материалы
Прз	Презентации
Т	Тесты
ЭСМ	Электронные справочные материалы
ИС	Интерактивный сайт

6. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

В курсе применяются следующие образовательные технологии:

- лекция — форма организации занятия, в которой укрупненная дидактическая единица передается в экстраактивном информационном режиме с применением средств мультимедиа;

- практическое занятие — форма организации занятия, в которой укрупненная или ограниченная дидактическая единица передается в интерактивном информационном режиме и сопровождается решением задач и обсуждением бизнес-ситуаций;
- лабораторная работа - форма организации занятия, в которой формируются умения и навыки применения инструментальных средств при решении задач;
- выборочный опрос - контроль знаний с помощью опроса по ключевым темам курса.

7. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Фонд оценочных средств по дисциплине обеспечивает проверку освоения планируемых результатов обучения (компетенций и их индикаторов) посредством мероприятий текущего, рубежного и промежуточного контроля по дисциплине.

Связь между формируемыми компетенциями и формами контроля их освоения представлена в следующей таблице:

Компетенция	Индикаторы освоения	Аттестационное мероприятие (КП 1)
-------------	---------------------	-----------------------------------

Шкалы оценки образовательных достижений

Шкала каждого контрольного мероприятия лежит в пределах от 0 до установленного максимального балла включительно. Итоговая аттестация по дисциплине оценивается по 100-балльной шкале и представляет собой сумму баллов, заработанных студентом при выполнении заданий в рамках текущего и промежуточного контроля.

Итоговая оценка выставляется в соответствии со следующей шкалой:

Сумма баллов	Оценка по 4-ех балльной шкале	Оценка ECTS	Требования к уровню освоению учебной дисциплины
90-100	5 – «отлично»	A	Оценка «отлично» выставляется студенту, если он глубоко и прочно усвоил программный материал, исчерпывающе, последовательно, четко и логически стройно его излагает, умеет тесно увязывать теорию с практикой, использует в ответе материал монографической литературы.
85-89	4 – «хорошо»	B	Оценка «хорошо» выставляется студенту, если он твёрдо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос.
75-84		C	
70-74		D	
65-69	3 – «удовлетворительно»	E	Оценка «удовлетворительно» выставляется студенту, если он имеет знания только основного материала, но не усвоил его деталей, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушения логической последовательности в изложении программного материала.
60-64			

Ниже 60	2 – «неудовлетворительно»	F	Оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, который не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки. Как правило, оценка «неудовлетворительно» ставится студентам, которые не могут продолжить обучение без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.
---------	------------------------------	---	---

8. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

ОСНОВНАЯ ЛИТЕРАТУРА:

1. ЭИ М 93 Анализ данных : учебник для вузов, Москва: Юрайт, 2023
2. ЭИ Н61 Анализ данных : учебное пособие для вузов, Москва: НИЯУ МИФИ, 2012
3. ЭИ М 63 Введение в анализ данных : учебник и практикум, Москва: Юрайт, 2023
4. ЭИ Н61 Анализ данных : учебное пособие для вузов, Ш. У. Низаметдинов, Москва: МИФИ, 2006

ДОПОЛНИТЕЛЬНАЯ ЛИТЕРАТУРА:

1. 519 Д43 Лабораторный практикум по курсу "Анализ данных" : Учеб. пособие, Дзэнгелевский А.Е., Низаметдинов Ш.У., М.: МИФИ, 1994
2. 519 А36 Прикладная статистика. Исследование зависимостей : справочное издание, С. А. Айвазян, И. С. Енюков, Л. Д. Мешалкин, М.: Финансы и статистика, 1985
3. 519 Н61 Анализ данных : учебное пособие для вузов, Ш. У. Низаметдинов, В. П. Румянцев, Москва: НИЯУ МИФИ, 2012
4. 519 Н61 Решение задач уменьшения размерности при описании сложных объектов : Учебное пособие, Ш.У. Низаметдинов, Москва: МИФИ, 1984
5. 004 Т98 Анализ данных на компьютере : учебное пособие для вузов, Ю. И. Тюрин , А. А. Макаров, Москва: Форум, 2011

ПРОГРАММНОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ:

1. Процессор электронных таблиц Microsoft Excel ()
2. R-система (<http://cran.r-project.org>)

LMS И ИНТЕРНЕТ-РЕСУРСЫ:

1. Сайт компании Statsoft (www.statsoft.ru)

2. Документальные ресурсы Научной библиотеки МИФИ (library.mephi.ru)
3. Электронная библиотека (www.elibrary.ru)
4. Библиотека по R-системе (<http://cran.r-project.org>)

<https://online.mephi.ru/>

<http://library.mephi.ru/>

9. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

1. Дисплейный класс ()

10. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ДЛЯ СТУДЕНТОВ

При изучении дисциплины необходимо усвоить основные положения теоретической части Программы. Следует руководствоваться материалами аудиторных занятий, примерами, разобранными преподавателем, а также информацией, имеющейся в рекомендованной литературе. Приведенные выше разделы дисциплины отражены в одноименных главах учебного пособия [1].

Целесообразно прорабатывать самостоятельно материалы каждого аудиторного занятия, чтобы прояснить для себя связь между темами Программы, четко представлять особенности методов и технологий, рассмотренных в темах. Важно также сопоставлять достоинства и недостатки, ограничения, которые вытекают из рассматриваемых методов при применении каждого из методов и подходов к решению практических задач.

Нужно уметь объяснить ход решения практических задач, используя материалы рассмотренных примеров.

При изучении дисциплины следует уделить внимание тщательному анализу комплекса примеров, имеющихся в материалах по дисциплине, и применять сделанные выводы при выборе задания для самостоятельной работы из числа предложенных преподавателем в виде тем индивидуальной проработки в рамках программы по дисциплине.

Проработка выбранной темы способствует ориентации студента при решении практических задач, и в дальнейшей самостоятельной работе по специальности.

Типовыми заданиями являются блоки вопросов к основным разделам дисциплины.

Для выполнения лабораторных работ в качестве исходных необходимо подобрать статистические данные из литературных источников и/или интернета и согласовать их с преподавателем. Отчет о лабораторной работе строится по форме, представленной в [2], и должен заканчиваться заключением, содержащим выводы по конкретной работе, а также резюме о возможности применения результатов предыдущей работы в данной.

Для выполнения самостоятельной работы следует использовать методические указания, основную и дополнительную литературу по курсу, а также следует пользоваться интрасетью кафедры, средствами портала университета.

При освоении дополнительных материалов следует концентрировать внимание на возможных ошибках при использовании теоретического материала в ходе разработки практических задач.

11. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ДЛЯ ПРЕПОДАВАТЕЛЕЙ

Лектору, а также преподавателям, ведущим практические и лабораторные занятия, рекомендуется использовать следующие учебные пособия, методические и справочные материалы.

а) основная литература:

Низаметдинов Ш.У., Румянцев В.П. Анализ данных. - М.:МИФИ, 2012.

б) дополнительная литература:

Айвазян С.А. и др. Прикладная статистика. Исследование зависимостей. - М.: Финансы и статистика, 1985.

Айвазян С.А. и др. Прикладная статистика. Классификация и снижение размерности. - М.: Финансы и статистика, 1985.

Демиденко Е.З. Линейная и нелинейная регрессии. М.: Финансы и статистика, 1981.

Тюрин, Ю.Н. Анализ данных на компьютере [Текст] : учебное пособие для вузов / Ю. И. Тюрин, А. А. Макаров. - изд. 4-е, перераб. - Москва : Форум, 2011, 2010. - 367 с. .

в) программное обеспечение и Интернет-ресурсы:

MS Excel,

Интернет-ресурсы:

1. Документальные ресурсы Научной библиотеки МИФИ (library.mephi.ru)

2. Электронная библиотека (www.elibrary.ru)

3. Библиотеки по машинному обучению.

Необходимо дать возможность студентам усвоить основные методы и подходы к описанию задач с использованием технологий, представленных в Программе.

Актуализация знаний студентов проводится при решении задач, обсуждении материалов в ходе практических занятий.

Желательно подробно и с максимальным количеством объяснений рассмотреть следующие темы программы по дисциплине:

Тема. Корреляционный анализ

Обратить внимание на возможность перехода от количественных шкал к качественным и оценить степень близости оценок коэффициентов корреляции в разных шкалах.

Тема. Регрессионный анализ

Пояснить студентам применение элементов дисперсионного анализа при анализе адекватности уравнение регрессии.

Тема 4. Факторный анализ.

Модель факторного анализа (ФА). Основная теорема ФА. Этапы ФА. Концепция простой структуры.

Тема 5. Кластерный анализ.

Меры близости и различия. Функционалы качества разбиения на кластеры. Алгоритмы классификации. Иерархический кластерный анализ. Проблемы индексации. Дендрограмма.

Особое внимание нужно уделить взаимосвязи материала Программы по дисциплине с ходом реальных проектов.

Желательно комплекс примеров связать с задачами отрасли, представить перспективу применения полученных знаний и навыков в самостоятельной работе вначале при освоении данной дисциплины, а в перспективе на рабочем месте.

По результатам обсуждения материала, выполнения практических заданий желательно сформулировать рекомендации по расширенному изучению тем Программы в случае, если студент проявил заинтересованность в изучении дисциплины.

Автор(ы):

Низаметдинов Шамиль Умерович, к.т.н., доцент