

9/7

Бр. 6/23
31.03.2014. год.
Београд, Студентски трг 16
тел. 20 27 801

МОЛБА
ЗА ОДОБРАВАЊЕ ТЕМЕ МАСТЕР РАДА

Молим да се одобри израда мастер рада под називом:

“Могућности примене масивно паралелног израчунавања у имплементацији Монте Карло симулација”

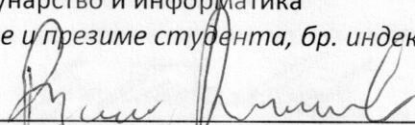
чији су значај и специфични циљ следећи:

Развој информационих технологија, као и њихово увођење у процес трговања хартијама од вредности доводе до настанка новог облика трговања које се зове алгоритамско трговање. Само алгоритамско трговање можемо свести на неколико корака: Скенирање података са тржишта (берзе), обрада података (израчунавање реалних цена хартија од вредности и сл.), слање захтева за трговање (куповина и продаја) централном рачунару. Како се показало у пракси брзина комуникације са централним рачунаром је круцијална за стицање профита, па се сви учесници труде да оптимизују и убрзају извршавање сва три корака.

У пракси се за процењивање кретања цене хартија од вредности у времену, обично примењује Монте Карло симулација, која уместо описивања случајне појаве помоћу аналитичких веза, до резултата долази симулирањем помоћу случајних бројева. Скуп добијених реализација представља статистички материјал, који се одговарајућим статистичким методама обрађује и интерпретира.

У овом раду биће анализирани могућности оптимизације израчунавања процене реалне вредности хартија од вредности помоћу масивно паралелне имплементација Монте Карло симулације на платформи “CUDA”.

Вук Петковић, 1064/2013, Математика -
Рачунарство и информатика
(име и презиме студента, бр. индекса, модул)



(својеручни потпис студента)

Ментор Саша Малков

Чланови комисије

- 1. _____
- 2. _____

(датум подношења молбе)

Катедра _____ даје подршку предложеној теми

(шеф катедре)

(датум одобравања молбе)