

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

Факультет прикладной математики и информатики

Кафедра информационных систем управления

Аннотация к дипломной работе

Разработка стратегий для биржевой игры

Пивоварчик Александр Витальевич

Научный руководитель – доцент, кандидат физико-математических наук

Кашкевич Сергей Иванович

Минск 2018

РЕФЕРАТ

Дипломная работа, 45 стр., 6 рис., 7 источников.

Ключевые слова: БИРЖЕВАЯ ТОРГОВЛЯ, NFT, СВЕРХМАЛЫЙ ВРЕМЕННОЙ ИНТЕРВАЛ, ОПТИЧЕСКИЙ РАЗВЕТВИТЕЛЬ, ПЛИС.

Объект исследования – задача минимизации времени задержки между входящим сигналом рынка и исходящим торговым поручением.

Цель работы – изучить существующие подходы к минимизации времени задержки и измерению соответствующего временного интервала; на основе полученных знаний построить стенд для измерения сверхмалых временных интервалов и провести его испытания.

Методы исследования - изучение предметной области, рассмотрение существующих подходов, практические эксперименты.

В результате исследования был построен стенд для измерения сверхмалых временных интервалов и проведены измерения времени задержки тестового приложения.

Область применения – автоматизированные системы для биржевой торговли.

РЭФЕРАТ

Дыпломная праца, 45 с., 6 мал., 7 крыніц.

Ключавыя словы: БІРЖАВАЯ ТАРГОЎЛЯ, ВЫСОКАЧАСТОТНАЯ ТАРГОУЛЯ, ЗВЫШМАЛЫ ВРАМЯНЫ ІНТЭРВАЛ, АПТЫЧНЫ РАЗГАЛІНЬВАТЕЛЬ, ПЛІС.

Аб'ект даследавання - задача мінімізацыі часу затрымкі паміж уваходным сігналам рынку і гандлёвым даручэннем.

Мэта працы - вывучыць існуючыя падыходы да мінімізацыі часу затрымкі і вымярэнні адпаведнага часовага інтэрвалу; на аснове атрыманых ведаў пабудаваць стэнд для вымярэння звышмалых часовых інтэрвалаў і правесці яго выпрабаванні.

Метады даследавання - вывучэнне прадметнай вобласці, разгляд існуючых падыходаў, практычныя эксперыменты.

У выніку даследавання быў пабудаваны стэнд для вымярэння звышмалых часовых інтэрвалаў і праведзены вымярэння часу затрымкі тэставага прыкладання.

Вобласць прымянення - аўтаматызаваныя сістэмы для біржавага гандлю.

ABSTRACT

Graduate work, 45pp., 6 figures, 7 sources.

Keywords: TRADING, HIGH FREQUENCY TRADING, ULTRA-SMALL TIME INTERVALS, OPTICAL SPLITTER, FPGA.

Object of research - the problem of minimizing the delay between the incoming market signal and the outgoing trade order

The work purpose - to study the existing approaches to minimizing the delay time and measuring the corresponding time interval; based on the knowledge gained, build a bench for measuring ultra-small time intervals and conduct its tests

Research methods - study of the subject area, consideration of existing approaches, practical experiments

As a result of the research, a stand to measure ultra-small time intervals is built and measurements of the delay time of the test application is done.

Scope - automated trading systems.