Дипломна работа  
Тема: Разработка на система за извършване и анализ на Монте Карло симулации  
Изготвил: Сиво Владимиров Даскалов

**ТЕХНИЧЕСКИ УНИВЕРСИТЕТ ВАРНА**

**Факултет „ФИТА”**

**Катедра “Компютърни науки и технологии”**

Р-л катедра “СИТ”: …………… Декан ФИТА:……….………..

/ доц. д-р инж. Елена Рачева / / доц. д-р инж. Н. Николов /

**З А Д А Н И Е**

**ЗА ДИПЛОМНА РАБОТА**

на студента Сиво Владимиров Даскалов

фак.№ 61262112

1. Тема на проекта:

“Разработка на система за извършване и анализ на Монте Карло симулации"

1. Срок за предаване: 01.07.2016 год.
2. Изходни данни за проекта:
   1. Структура на алгебрични изрази, работа със случайни величини и разпределения, принципи за извършване на Монте Карло симулации. Изграждане на динамичен дървовиден потребителски интерфейс. Изграждане на сървърен модул за извършване на симулации.
   2. Използвани технологии: Java, NetBeans, Maven, JUnit, Swing, Git, JAXB и XML
3. Съдържание на обяснителната записка:
   1. Въведение – Необходимост от решаване на дипломната задача. Технически и програмни средства за изграждане на системи за извършване на симулации. Изисквания към симулационни системи. Постановка на дипломното задание.
   2. Въведение – Теоретична част
      1. Стохастични величини, разпределения и операции с тях. Дървовидно представяне и симулация на алгебрични структури със стохастични величини. Изграждане на симулационна структура.
      2. Методи за създаване на обектно-ориентирани изчислителни модули. Паралелна реализация на симулационни изчисления.
   3. Описание на програмното решение
      1. Организация и структура на решението, описание на модулите, обосновка на взетите имплементационни решения.
      2. Описание на бизнес-логиката и представяне на резултатите.
      3. Описание на комуникацията между клиентска и сървърна част
   4. Ръководство за потребителя и програмиста.
   5. Заключение, оценка, тестване, предложения за развитие.
4. Обем на чертежите:
   1. Приложение А: Схеми, диаграми, екрани, таблици
   2. Приложение Б: Листинг на програмното осигуряване
5. Дата на задаване: 30.05.2016 год.

Ръководител:………………..

/ доц. д-р инж. А Антонов /

Студент:…………………….

/ Сиво Владимиров Даскалов /

Съдържание

[1. Изходни данни 4](#_Toc454486283)

[1.1. Представяне на алгебрични изрази 4](#_Toc454486284)

[1.2. Работа със случайни (стохастични) величини и разпределения 5](#_Toc454486285)

[1.3. Принципи на Монте Карло методите 7](#_Toc454486286)

[1.4. Модел клиент - сървър 8](#_Toc454486287)

[1.5. Използвани технологии 9](#_Toc454486288)

[1.5.1. Java 9](#_Toc454486289)

[1.5.2. NetBeans 9](#_Toc454486290)

[1.5.3. Maven 9](#_Toc454486291)

[1.5.4. JUnit 9](#_Toc454486292)

[1.5.5. Git 9](#_Toc454486293)

[1.5.6. JAXB и XML 9](#_Toc454486294)

[1.5.7. Swing 9](#_Toc454486295)

# Изходни данни

## Представяне на алгебрични изрази

Алгебричните изрази могат да бъдат представени дървовидно както е показано на Фигура 1.1‑1. Листата на дървото представляват константи или реферират стойността на променлива. Останалите възли от дървото представят алгебрична операция извършвана върху стойностите на децата му. Изчислената стойност на корена на дървото представя стойността на целия алгебричен израз.



Фигура ‑ Дървовидно представяне на алгебрични изрази

## Работа със случайни (стохастични) величини и разпределения

В теорията на вероятностите и статистиката случайните величини са променливи, чиито стойности представляват резултатите от даден случаен експеримент. Когато стойностите на случайната величина не са дискретни, а образуват непрекъснато множество, тя се нарича непрекъсната случайна величина. Реализация на променлива е стойността на променливата, която е била наблюдавана при провеждане на стохастичния експеримент.

Математическата функция, която описва възможните стойности на стохастична променлива, се нарича нейно вероятностно разпределение. Разпределението назначава вероятност за настъпване на всяко измеримо подмножество от възможните стойности на случайния експеримент.

В приложната теория на вероятностите разпределение на непрекъсната случайна величина се задава най-често чрез функция на плътност на вероятността. На Фигура 1.2‑1 са показани функции на плътност на вероятността за нормалното разпределение.



Фигура ‑ Функции на плътност на вероятността за нормалното разпределение

Разпределение може да бъде зададено още и чрез комулираща функция на разпределението, която показва вероятността случайната величина X да получи стойност по-малка или равна на x.



Фигура ‑ Комулиращи функции на разпределението за нормалното разпределение

## Принципи на Монте Карло методите

Монте Карло методите са клас изчислителни алгоритми, които използват случайни числа и вероятности за решаването на даден проблем. Тези алгоритми се използват често в математиката, физиката и управлението на финансовия риск в случаи, в които е трудно или невъзможно използването на други подходи.

Трудността произтича от наличието на множество взаимосвързани степени на свобода в дадената система. Пример за подобна зависимост от сферата на финансите е оценката на сегашната стойност на портфолио. Настоящата стойност на портфолиото пряко зависи от множество бъдещи стойности на валутни курсове, лихвени криви и цени, всяка от които поради неизвестността на бъдещето е стохастична величина.

Нека съществува детерминистичен модел, който приемайки определени входни параметри изчислява стойността на величина представляваща интерес. В случай че входните параметри представляват стохастични величини е невъзможно преизчисляването на модела за всяка възможна комбинация от извадки на стохастичните му параметри.

Монте Карло симулацията представлява итеративното преизчисляване на детерминистичния модел за множество извадки на стохастичните променливи от които той зависи. Често се извършват над 10000 преизчислявания с различни комбинации от реализации на променливите. След симулацията серията от получени стойности за изчисляваната величина се анализира с цел извличане на полезна информация за очаквана стойност и разпределение на неизвестната величина.

## Модел клиент - сървър

Моделът клиент – сървър е архитектура реализираща разпределено приложение. Целта е да се разделят двете части на приложението (клиентска и сървърна) и с това да се постигне възможността за изпълняването им на отделни машини. Основните най-често срещани характеристики на клиента и сървъра са представени в Таблица 1.4‑1.

Таблица ‑ Често срещани характеристики на клиент и сървър

|  |  |
| --- | --- |
| **Клиент** | **Сървър** |
| Подава заявки | Чака заявки (пасивност) |
| Изчаква отговор | Обработва заявки и връща отговор |
| Свързва се до един сървър | Получава заявки от множество клиенти |
| Взаимодейства пряко с крайните потребители чрез графичен интерфейс | Не контактува директно с крайния потребител |

Изнасянето на тежки изчисления към специално пригоден за изпълнението им сървър позволява реализирането на „тънки” клиенти за устройства без силен хардуер. По този начин се намалят системните изисквания на приложението за крайния потребител. Еднотипната функционалност на сървъра бива използвана едновременно от множество клиенти, които могат да бъдат и разнотипни. Комуникацията между двете страни се извършва по предварително дефиниран протокол като освен него клиентът трябва да знае локацията на сървъра.



Фигура ‑ Организация на приложение използващо модела клиент - сървър

## Използвани технологии

### Java

### NetBeans

### Maven

### JUnit

### Git

### JAXB и XML

### Swing