

Методи Монте-Карло

Волощенко О.П. АКС – 3 -2

Гузенко С.В.

Для моделювання різних фізичних, економічних та інших ефектів широко розповсюдженні методи, які називають *методами Монте-Карло*, що завдячують своєю назвою європейському центру азартних ігор і мають за основу випадкові події.

Основною ідеєю цих методів є створення відповідної послідовності випадкових чисел, яка може змоделювати той чи інший ефект, наприклад, сигнал у фізичному експерименті, випадкову динаміку біржових індексів і т.п. Деякі типові задачі, які відносяться до методів Монте-Карло можна розв'язати за допомогою програми Mathcad, оскільки в ній закладена відповідна кількість генераторів псевдовипадкових чисел для кожного закону розподілу.