愚老爹 的網誌 （到舊版）

作家

愚老爹

- 加入好友
- 推薦部落格
- 訂閱關注
- 留言給他

個人小檔案

部落格推薦	0
等級	8
點閱人氣	1,032,241
本日人氣	52
文章創作	697
相簿數	11

搜尋

文章分類

- 讀書會(28)
- 商業管理(40)
- 專案管理(59)
- 品牌/社群(1)
- 愚夫農事(3)
- 創業園地(13)
- 綠色環保(7)
- MIS人生(9)
- 數位科技(16)
- 親親寶貝(52)
- 旅遊雜記(21)
- 心情雜記(178)
- 健康與休閒(34)
- 職場心情(174)
- 不分類(62)

月曆

文章排行榜

最新發表 | 最新回應 | 最新推薦
熱門瀏覽 | 熱門回應 | 熱門推薦

- 有刺激才有動力
- 成功的路一點都不孤單
- 親子廚房
- 幸福是靠自己去爭取的
- 小孩身上看到父母親的縮影
- 速成課堂

精選文章

- 職場五德
- 精英教育
- 一門終生的課 6
- 偉大的母親
- 一門終生的課 5

我推薦的文章

- 螺帽的故事
- 慈湖走走
- 旅程
- 止咳良方烤橘子
- 你捎來的情書
- 也是一番自我拘索
- 多吃菇蕈有益健康
- 信心的翅膀
- 李安：用真誠的心，感動世界

部落格推薦人

標籤

RSS

RSS | 部落格聯播

什麼是「蒙地卡羅模擬法（ Monte Carlo Simulation ）」？

2008/07/31 08:31 讚 28 分享

67,250 2 2 0

是一種數值方法，利用亂數取樣 (Random Sampling) 模擬來解決數學問題。在數學上，所謂產生亂數，就是從一開始給定的數集合中選出的數，若從集合中不按順序隨機選取其中數，稱為亂數，若是被選到的機率相同時，稱為均勻亂數。例如擲骰子，1 點至 6 點骰子出現機率均等。

那到底 蒙地卡羅方法最適合解決哪些問題？ 舉凡在所有目前具有隨機效應的過程，均可能以蒙地卡羅方法大量模擬單一事件，藉統計上平均值獲得某設定條件下實際最可能測量值。

蒙地卡羅模擬法，是基於大數法則的實證方法，當實驗的次數越多，其平均值也就會越趨近於理論值。其法則亦可以估算投資組合的各種風險因子，特別是一些難以估算的非線性投資組合。另外也可處理具時間變異的變異數、不對稱等非常態分配和極端狀況等特殊情形，甚至也可用來計算信用風險。

雖然蒙地卡羅模擬法具有以上優點，但因需要繁雜的電腦技術和大量重複的抽樣，所須計算成本高且耗時的缺點。最後，若是僅處理非線性及非常態分配的投資組合，則可以選擇此模擬法，以加速其運算的速度和準確性。

參考資料: TEPS-期刊查詢結果

回覆 推薦 引用 列印

有誰推薦

全站分類：知識學習 隨堂筆記 自訂分類：專案管理

上一則： 限制理論(TOC)運用在專案管理上的方法

下一則： Project Selection Methods 專案選擇方法

你可能會有興趣的文章：

幸福是靠自己去爭取的

收心囉

玩樂或工作，自己決定

與別人不一樣

凡事簡單

用心經營

0則留言

排序依據 最新

新增回應……

Facebook 留言外掛程式

迴響（2） ：

2樓. 海綿君

2012/12/29 16:57

感謝

謝謝你的解釋

獲益良多

1樓. 阿呆

2010/10/14 09:41

模擬資料的來源

請問~ 執行蒙地卡羅的模擬研究時, 資料來源是用自己假設的模式生成的資料來做? 還是要用手上已有的真實資料來做? 這樣重複抽樣的感覺, 好像靴環法, 意義上是一樣的嗎?

發表迴響

暱稱 E-Mail

URL

會員登入

字體 文字大小 HTML

5 + 4 = ※ 請計算輸入數字

送出迴響

本部落格刊登之內容為作者個人自行提供上傳，不代表 udn 立場。

刊登網站廣告 關於我們 常見問題 服務條款 著作權聲明 隱私權聲明 客服

▲top

Powered by udn.com

粉絲團 讚 28

登入 加入 網路城邦