

# C'est quoi une simulation Monte Carlo ?

---



# Monte Carlo ?

---

- La simulation Monte Carlo est une technique pour résoudre des problèmes mathématiques
- Au lieu de trouver une solution analytique, on va utiliser le hasard pour explorer l'ensemble des scénarios, puis tirer des conclusions sur les résultats

# Monte Carlo ?

---

- Elle tire son nom de la ville éponyme, célèbre pour ses casinos
- Formalisée au début du 20e siècles, elle est notamment utilisée dans l'invention de la bombe nucléaire

# Modéliser l'incertitude



- La simulation Monte Carlo est utilisé aussi pour la modélisation financière !
- Par exemple pour modéliser la valorisation d'une entreprises en simulant différents scénarios ce qui permet d'intégrer de l'incertitude à la modélisation
- J'ai d'ailleurs développé un guide pour appliquer cette technique à la valorisation des projets data ! (lien dans la dernière slide)

# Cas particuliers

---

- Variables corrélées entres elles

A prévoir dans la simulation

- Chaîne de Markov / Système multi-agents

Quand la simulation nécessite de découper chaque scénario en plusieurs intervalles de temps/agents qui interagissent ou sont dépendants entres eux.

(ex : cours boursiers, trafic routier, etc)

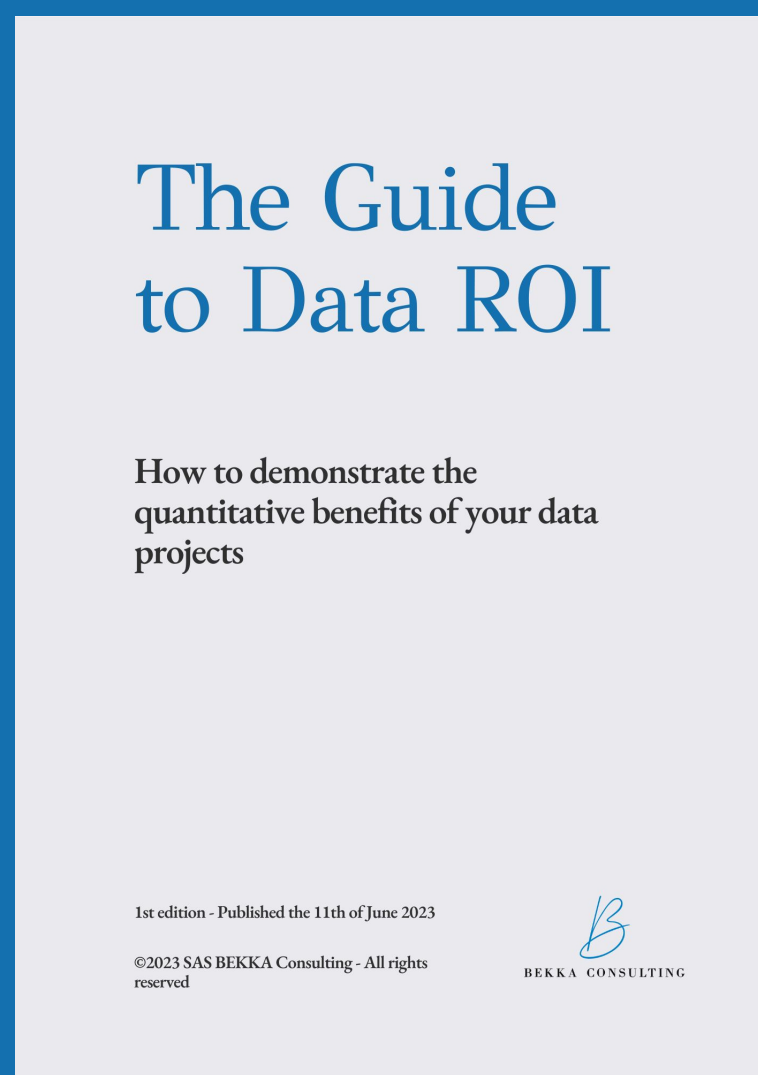
Tu as trouvé ça  
intéressant ?



Laisse-moi ton avis en  
commentaire !

Si tu veux plus d'infos tu as  
mon Guide GRATUIT de +30  
pages sur la valorisation des  
données

---



Disponible sur :  
[www.bekkaconsulting.com](http://www.bekkaconsulting.com)