

Una Introducción al Método de Monte Carlo

Fernando Baltazar-Larios

12 de marzo de 2013

Resumen

El método de Monte Carlo es una herramienta muy importante en la simulación estocástica que permite dar solución a problemas matemáticos cuya solución analítica no existe o es muy costoso encontrarla.. El método de Monte Carlo consiste en representar la solución analítica de un problema como un parámetro de una población hipotética para luego estimar dicho parámetro a partir de una muestra aleatoria construida por medio de una sucesión de números aleatorios. En esta plática se presenta el concepto, la metodología y la aplicación de la simulación de Monte Carlo.