

Probabilités V

STEP, MINES ParisTech*

26 novembre 2019 (#87b4ab7)

Table des matières

Integrale de Monte-Carlo	1
Génération de nombres pseudo-aléatoires	1
Méthodes de simulation de v.a.	1
Simulation d'un vecteur Gaussien	1
Echantillonnage d'importance	2

Integrale de Monte-Carlo


Génération de nombres pseudo-aléatoires

Méthodes de simulation de v.a.

- inversion
- rejet
- box-muller

Simulation d'un vecteur Gaussien

Cholesky

*Ce document est un des produits du projet  boisgera/CDIS, initié par la collaboration de (S)ébastien Boisgérault (CAOR), (T)homas Romary et (E)milie Chautru (GEOSCIENCES), (P)auline Bernard (CAS), avec la contribution de Gabriel Stoltz (Ecole des Ponts ParisTech, CERMICS). Il est mis à disposition selon les termes de la licence Creative Commons “attribution – pas d'utilisation commerciale – partage dans les mêmes conditions” 4.0 internationale.

Echantillonnage d'importance