

Probabilités V

STEP, MINES ParisTech*

7 octobre 2019 (#24161b4)

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	2
Echantillonnage d'importance	2

Integrale de Monte-Carlo

Génération de nombres pseudo-aléatoires

Méthodes de simulation de v.a.

- inversion
- rejet
- box-muller

*Ce document est un des produits du projet  **boisgera**/CDIS, initié par la collaboration de (S)ébastien Boiségerault (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.

Simulation d'un vecteur Gaussien

Cholesky

Echantillonnage d'importance