第十三周读书报告 5.18-5.24

61518426 周之遥

·读书进度

学习统计学习方法第19章：马尔科夫链蒙特卡罗法。

在随机变量的状态空间上定义一个满足遍历定理的马尔科夫链，然后在这个马尔科夫链上进行随机游走，每个时刻得到一个样本。根据遍历定理，当时间趋于无穷时，样本的分布趋于平稳分布，样本的函数均值趋近于函数的数学期望。

所以，当时间足够长时，在之后的时间里随机游走得到的样本集合就是目标概率分布的抽样结果，得到的函数均值就是要计算的期望值。

·下周计划

完成20章潜在狄利克雷分布。