Giới thiệu MCMC

Không gian mẫu (sampling space)

Đánh giá MCMC

Chain tracing

Lag

ACF & Effective sample size:

* Cỡ mẫu hiệu quả (effective sample size):
* Correlated observations
* Giả sử ta có 1 bộ mẫu (observations) yi với phân phối mean tại $$\mu$$ và standard deviation $$\sigma$$
* $$y = normal(\mu, \sigma)$$
* Khi đó mean của phân phối này sẽ được tính bằng công thức:
* $$\hat{\mu} = $$
* Khi đó variance của mu hat sẽ là:
* $$Var(\hat{\mu}) = \sigma^2/n $$