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:

$$\hat{\mu} = $$

Phương sai (variance) của $$\hat{\mu$$ sẽ là:

$$Var(\hat{\mu}) = \sigma^2/n $$