

$$p(z) = \frac{1}{Z_p} \tilde{p}(z)$$

↑ 易于计算的分布.

Q 为了应用拒绝采样法

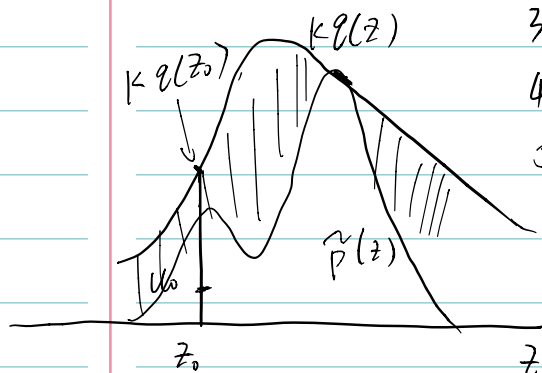
A. 1. 一些提议分布, 并且我们已知从提议分布采样;

2. 引入常数 k , 对所有 z 值有 $k g(z) \geq \tilde{p}(z)$.

3. 从 $g(z)$ 中采样 z_0 ,

4. 在区间 $[0, k g(z_0)]$ 上均匀分布中生成 u_0

5. 若 $u_0 > \tilde{p}(z_0)$ 则样本被拒绝, 否则, 保留.



Q 接受的概率

A

$z \sim g(z)$, 这些样本之后被接受 $\frac{\tilde{p}(z)}{k g(z)}$,

$$P(\text{接受}) = \int \left\{ \frac{\tilde{p}(z)}{k g(z)} \right\} g(z) dz$$

$$= \frac{1}{k} \int \tilde{p}(z) dz$$





