

how

两个阶段 • ①. L 个样本 $z^{(1)} \dots z^{(L)}$ 从 $g(z)$ 中抽取

②. 权重 w_1, \dots, w_L 通过

$$w_l = \frac{\tilde{p}_l}{\sum_m \tilde{p}_m} = \frac{\frac{\tilde{p}(z^{(l)})}{g(z^{(l)})}}{\sum_m \frac{\tilde{p}(z^{(m)})}{g(z^{(m)})}}$$

计算

③ L 个样本的第二个集合从离散的相变分布 $(z^{(1)} \dots z^{(L)})$ 中抽取，权重由权重 (w_1, \dots, w_L) 给定。

说明可以完成采样： • 重新采样的值的累积分布：

$$p(z \leq a) = \sum_{l: z^{(l)} \leq a} w_l = \frac{\sum_l \mathbb{I}(z^{(l)} \leq a) \tilde{p}(z^{(l)}) / g(z^{(l)})}{\sum_l \tilde{p}(z^{(l)}) / g(z^{(l)})}$$



