



I N S E A

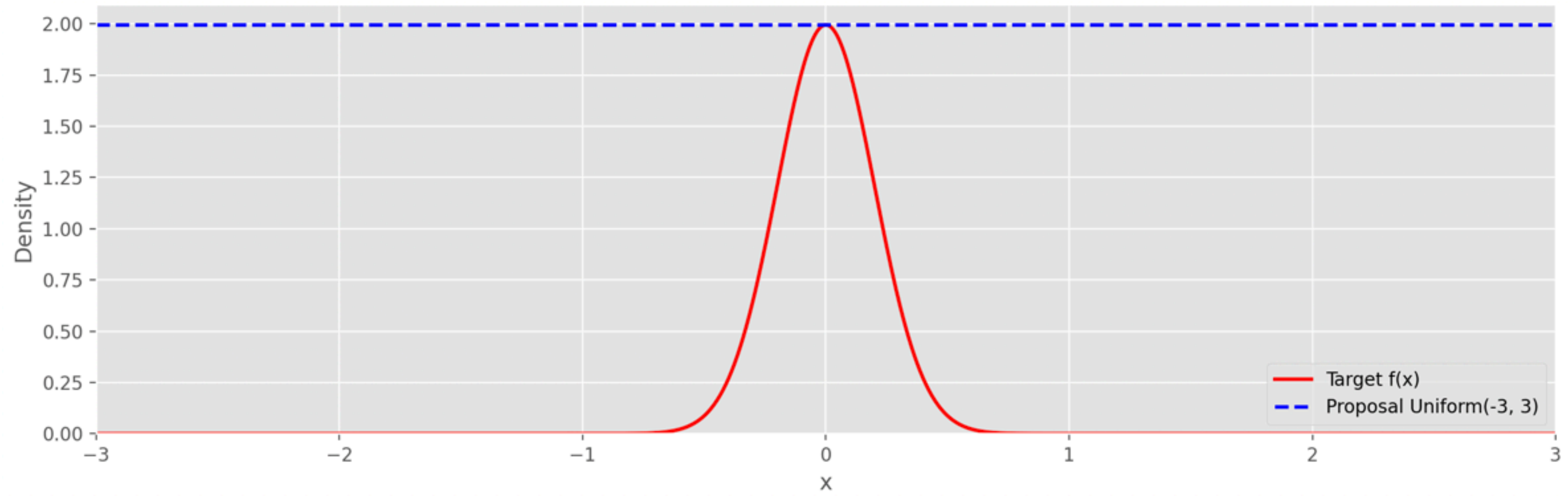






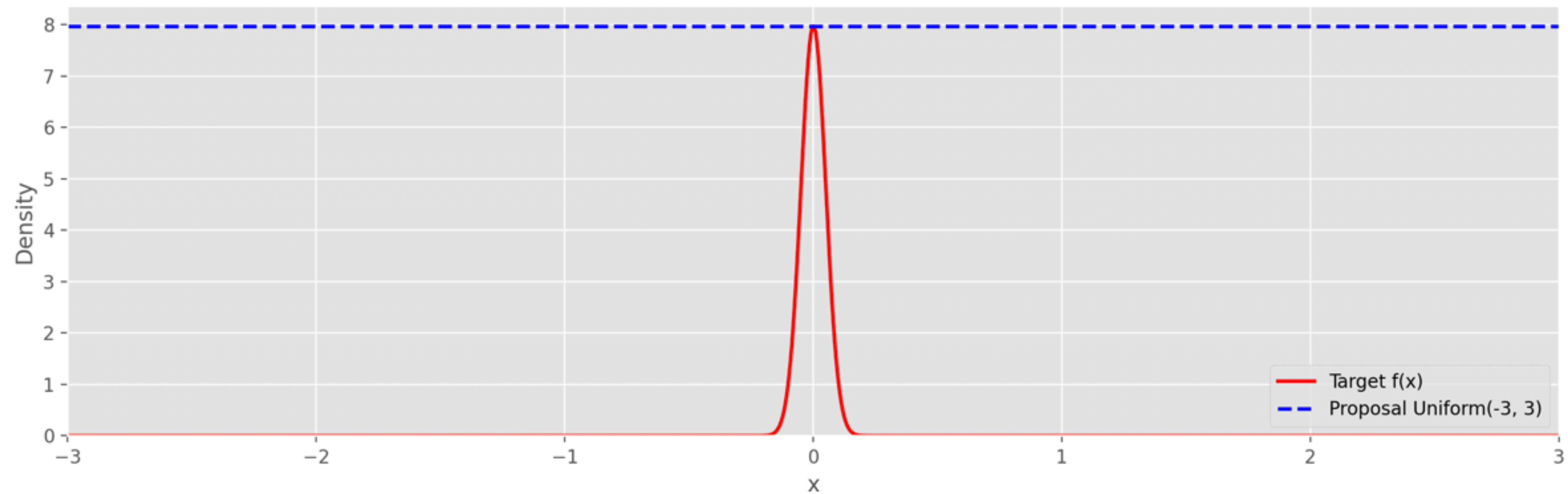
Algorithmes de simulation

Rejection sampling

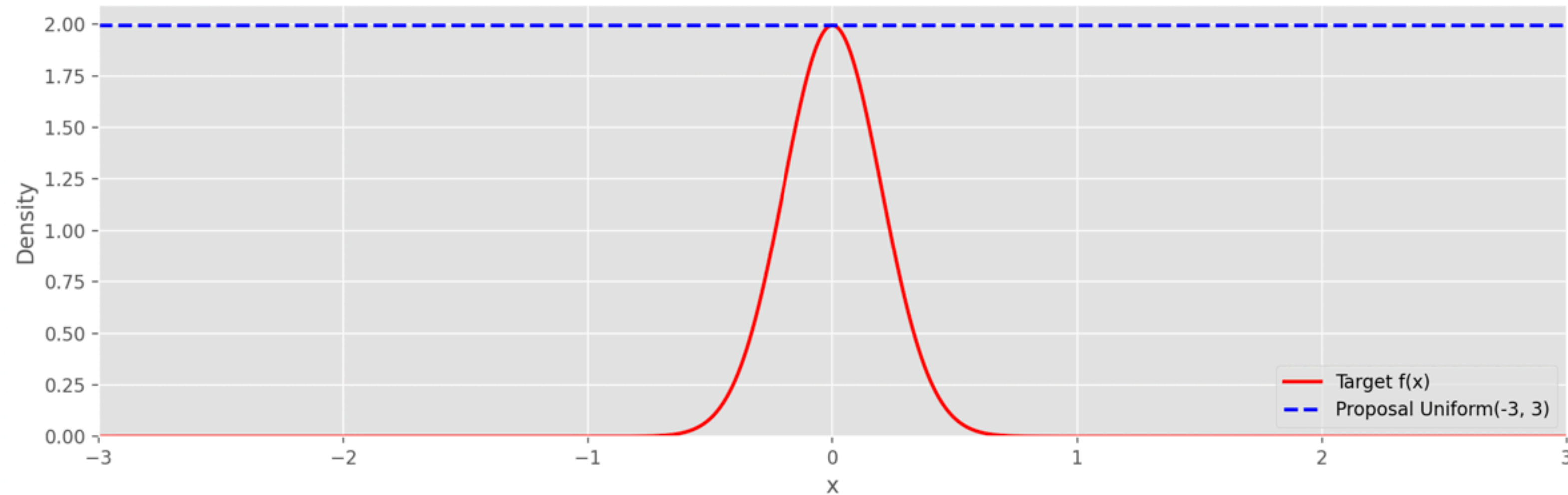


Et si on avait cette **densité** on ne target ?

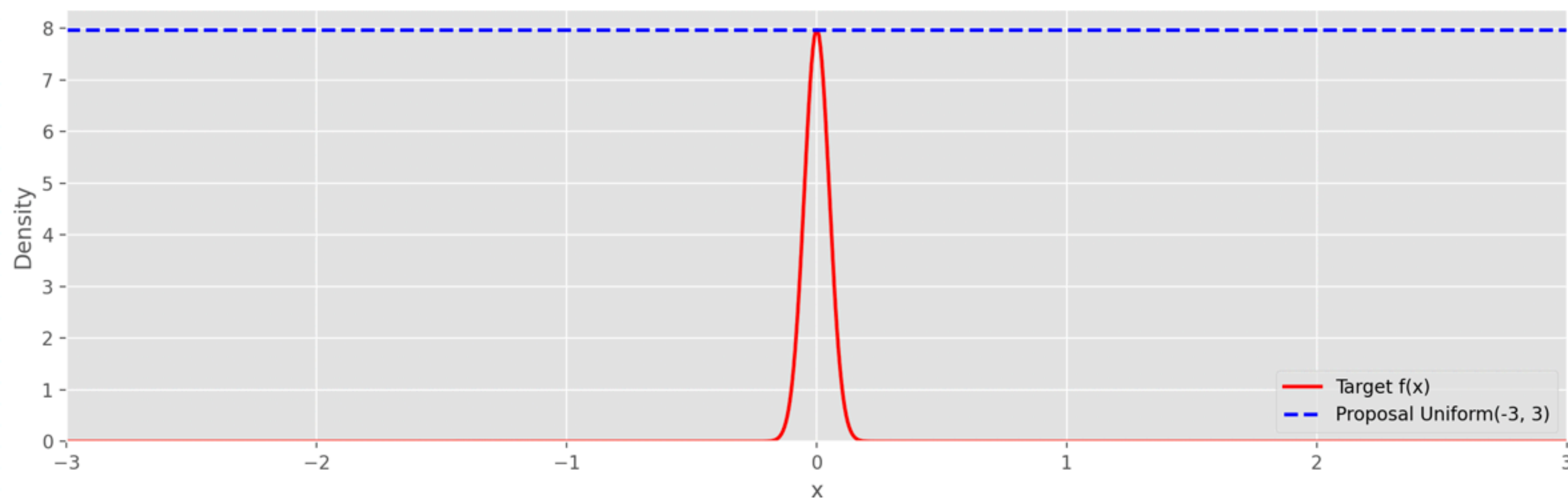
Ou celle-ci ?



Et si on avait cette **densité** comme target ?



Ou celle-ci ?



1. Pourquoi Monte-Carlo ? (Exemple de modèle hiérarchique)
2. Introduction à la méthode Monte-Carlo (historique, PRNG)
3. Algorithmes de simulation i.i.d (PRNG, transformation, rejet)
4. Méthodes MCMC (Gibbs, Metropolis)
5. Diagnostics de convergence MCMC
6. Méthodes MCMC avancées (Langevin, HMC, NUTS)



