



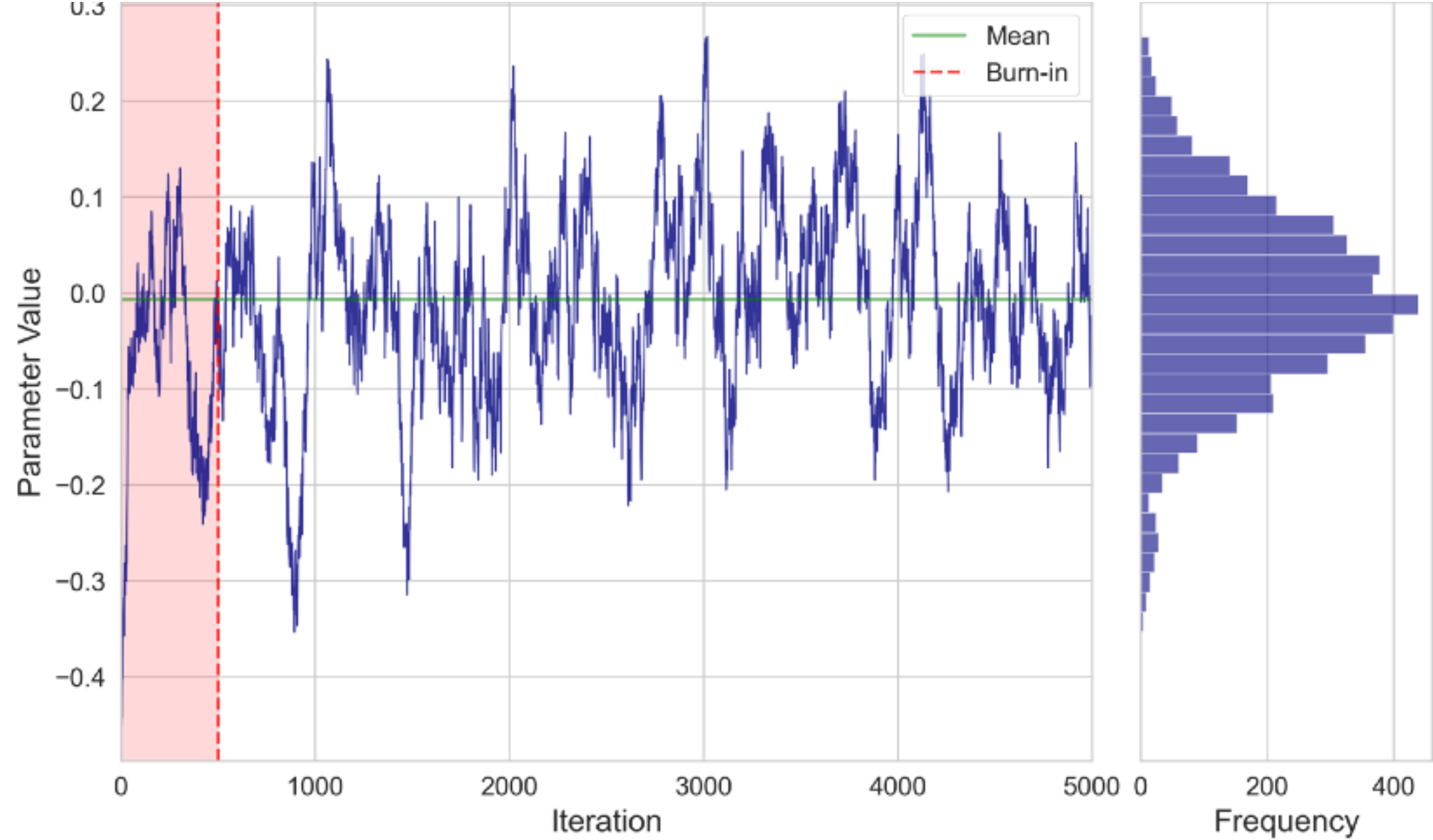
I N S E A





56

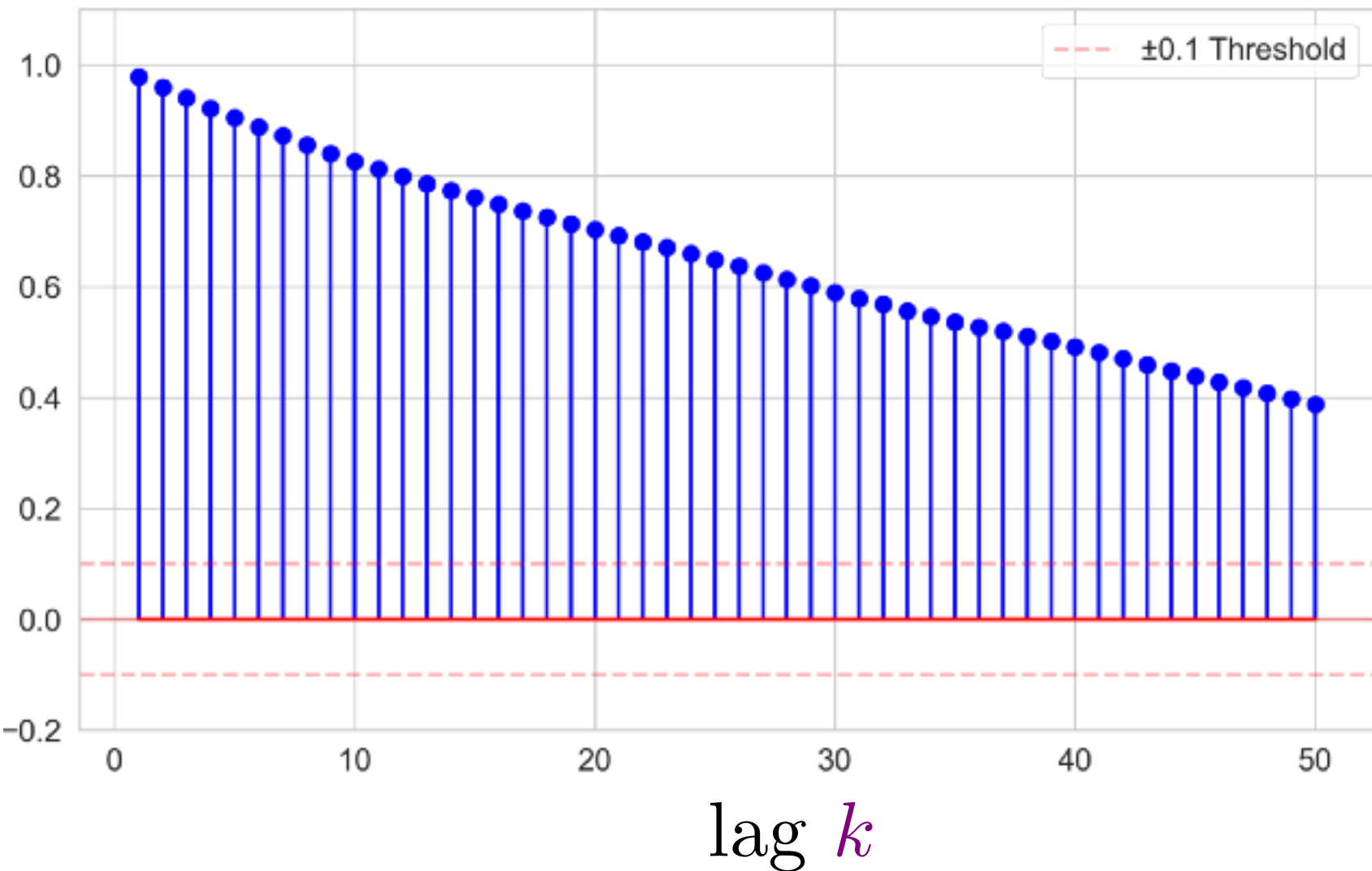
MMc diagnostics in 1D



Visuais

Comment expliquer comment?

Auto-corrélations excessives:

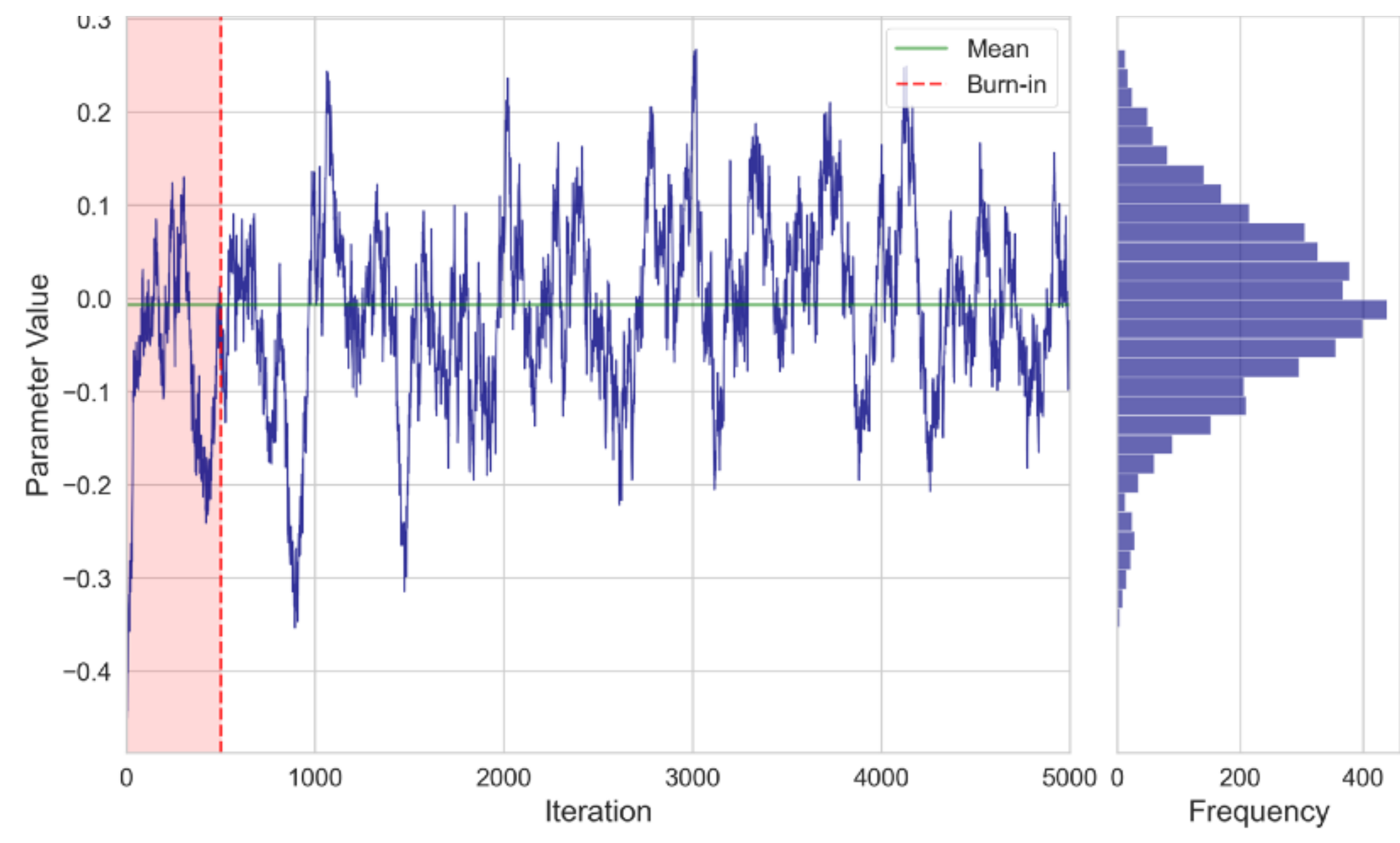


Est-ce un bon choix MCCMC?

Raison principale?

Metropolis: On n'explore pas l'espace

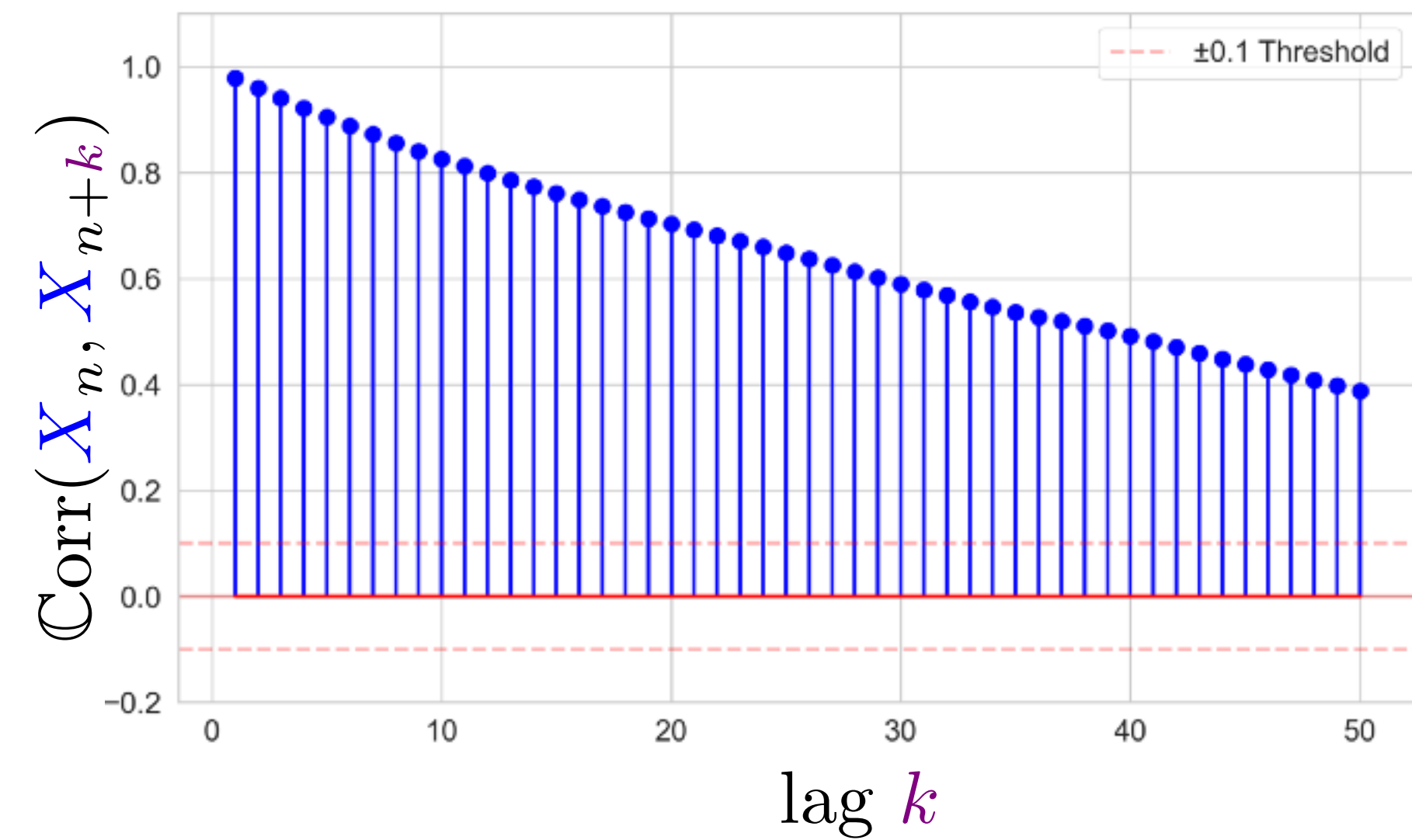




Est-ce une bonne chaîne MCMC ?

Comment expliquer ce comportement ?

Auto-corrélations excessives:



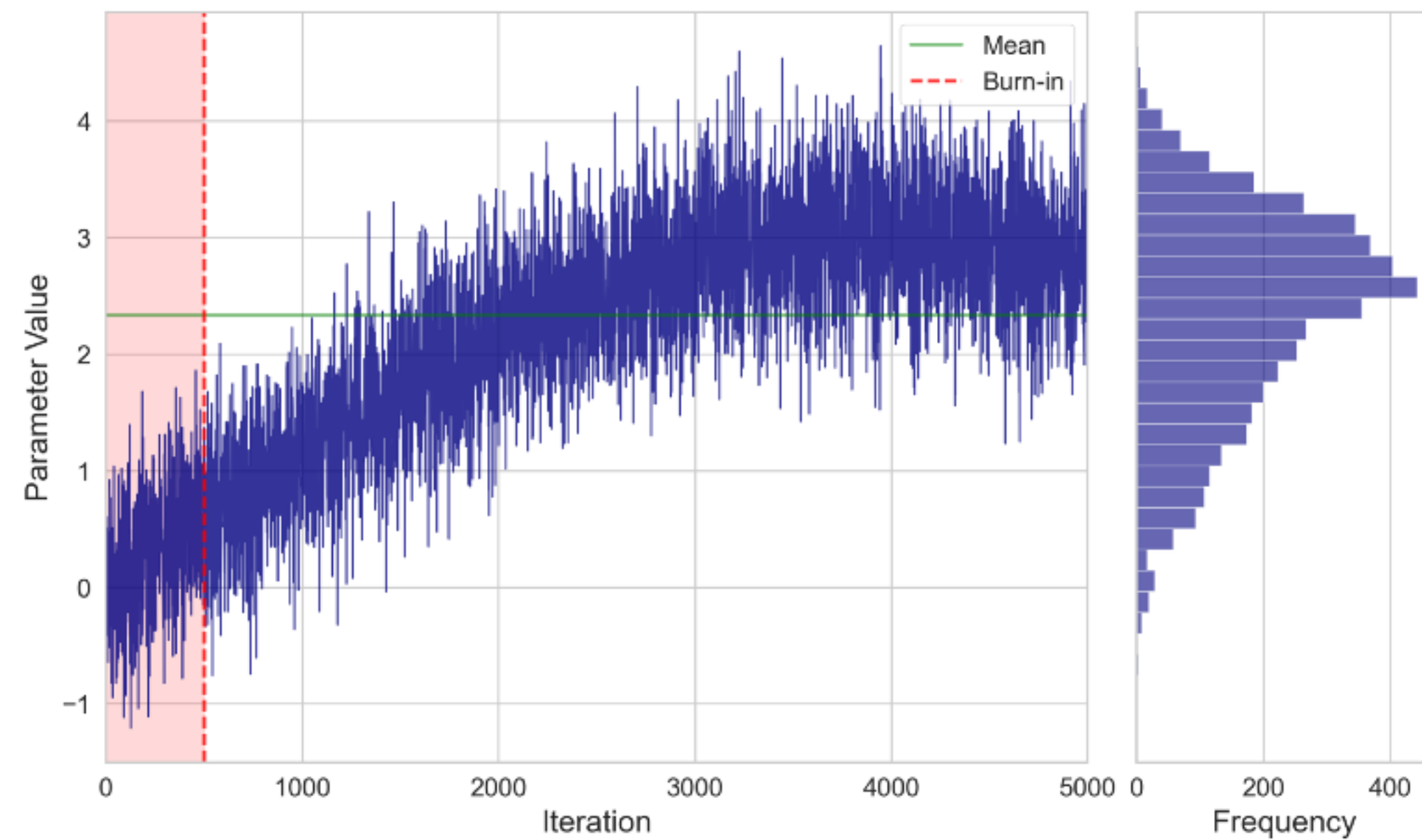
Raison principale ?

Metropolis: On n'explore pas assez l'espace



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)





Est-ce une bonne chaîne MCMC ?