



I N S E A





Trésprobablement:

1. Erreur d'implémentation

2. Loi a priori extrêmement loindees dominées

3. Converger très très lente

5

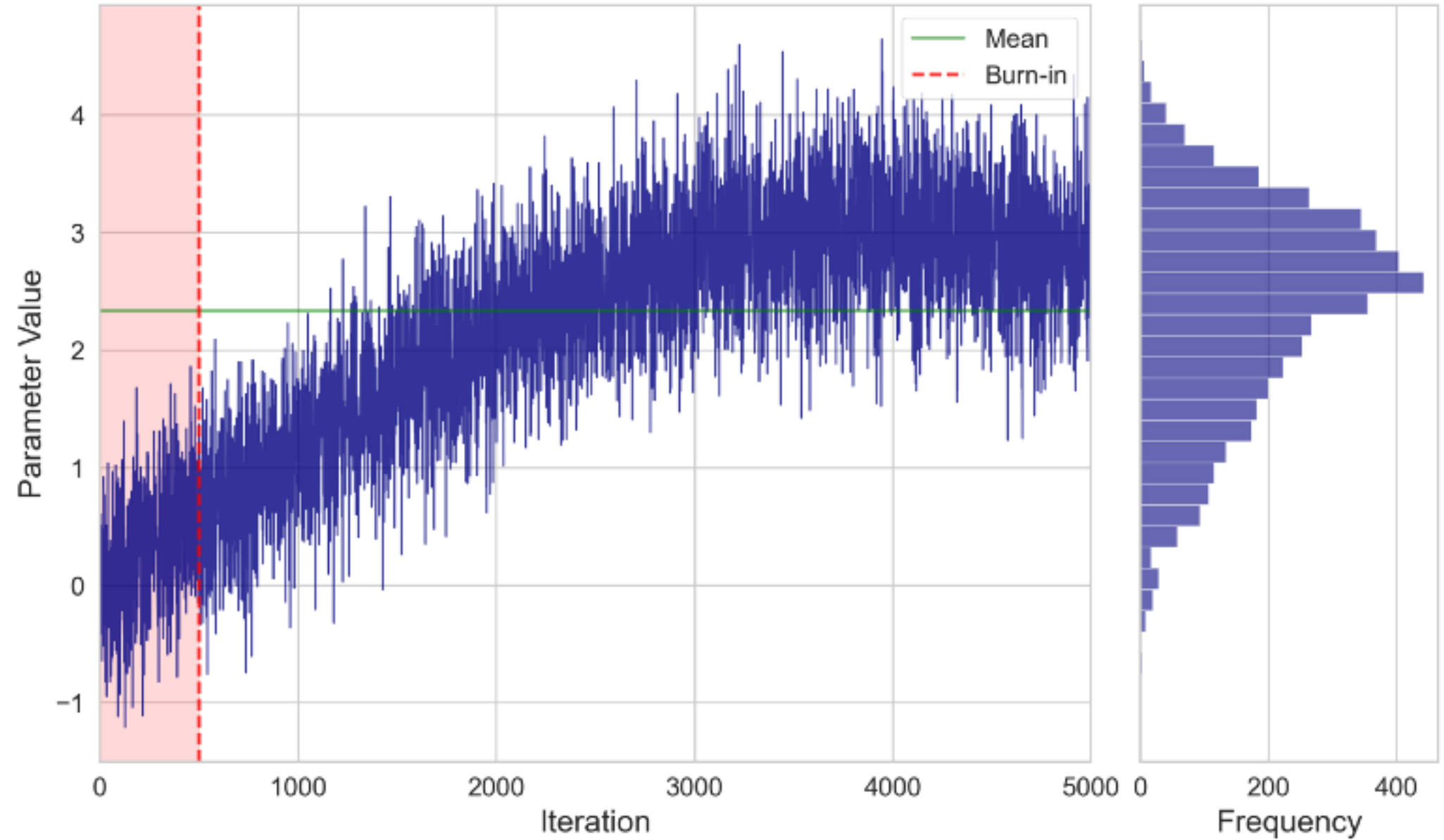
7

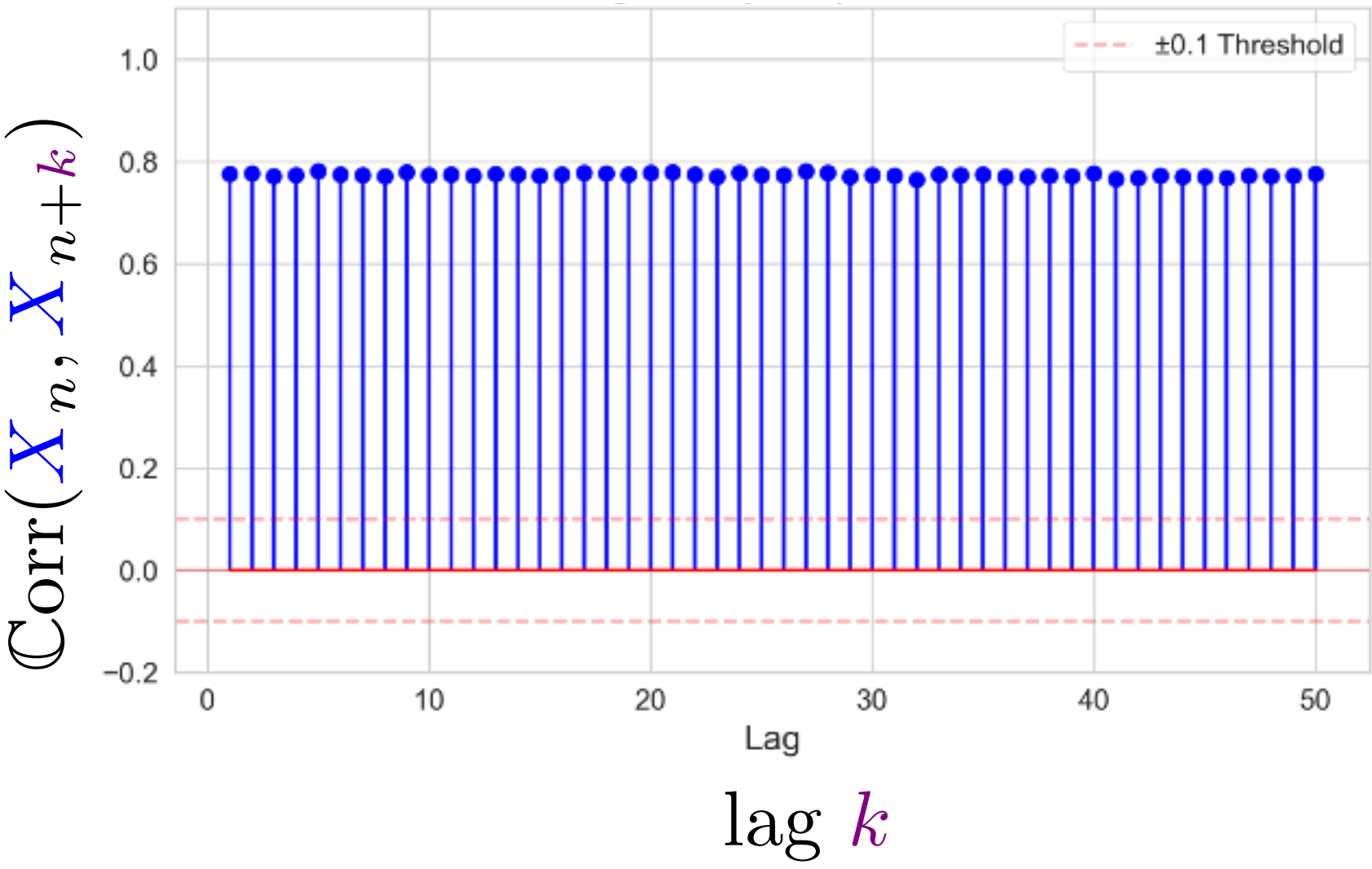
MMc diagnostics in 1D

Visuais

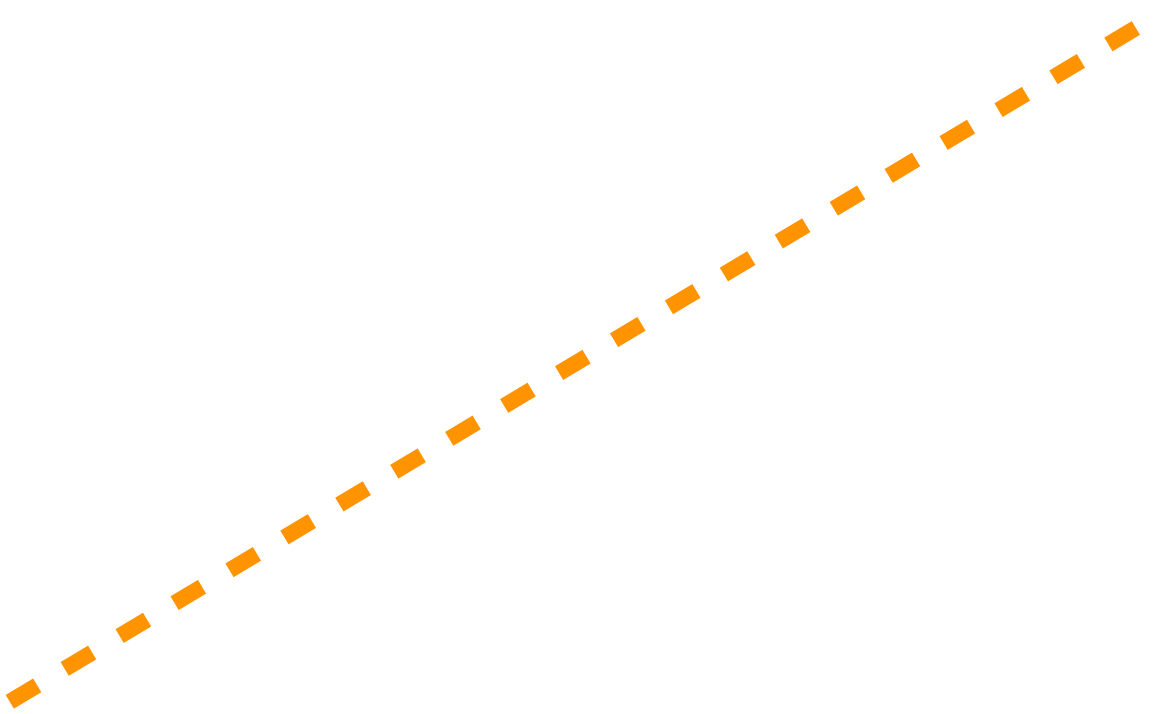
Est-ce un bon choix McMc?

Explicitations principales?

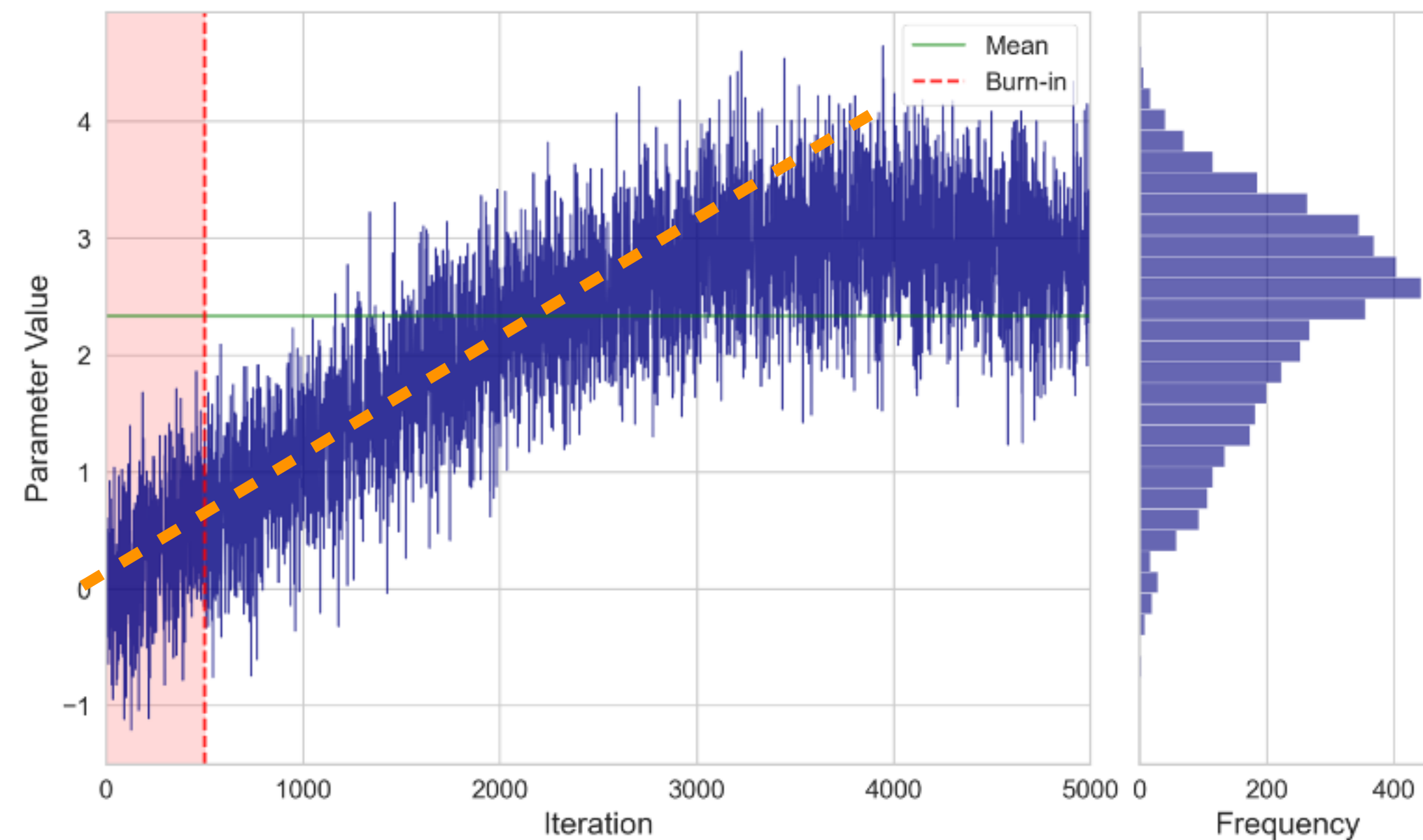




(autocorr inutiles ici, on s'y attendait vu le trace plot)



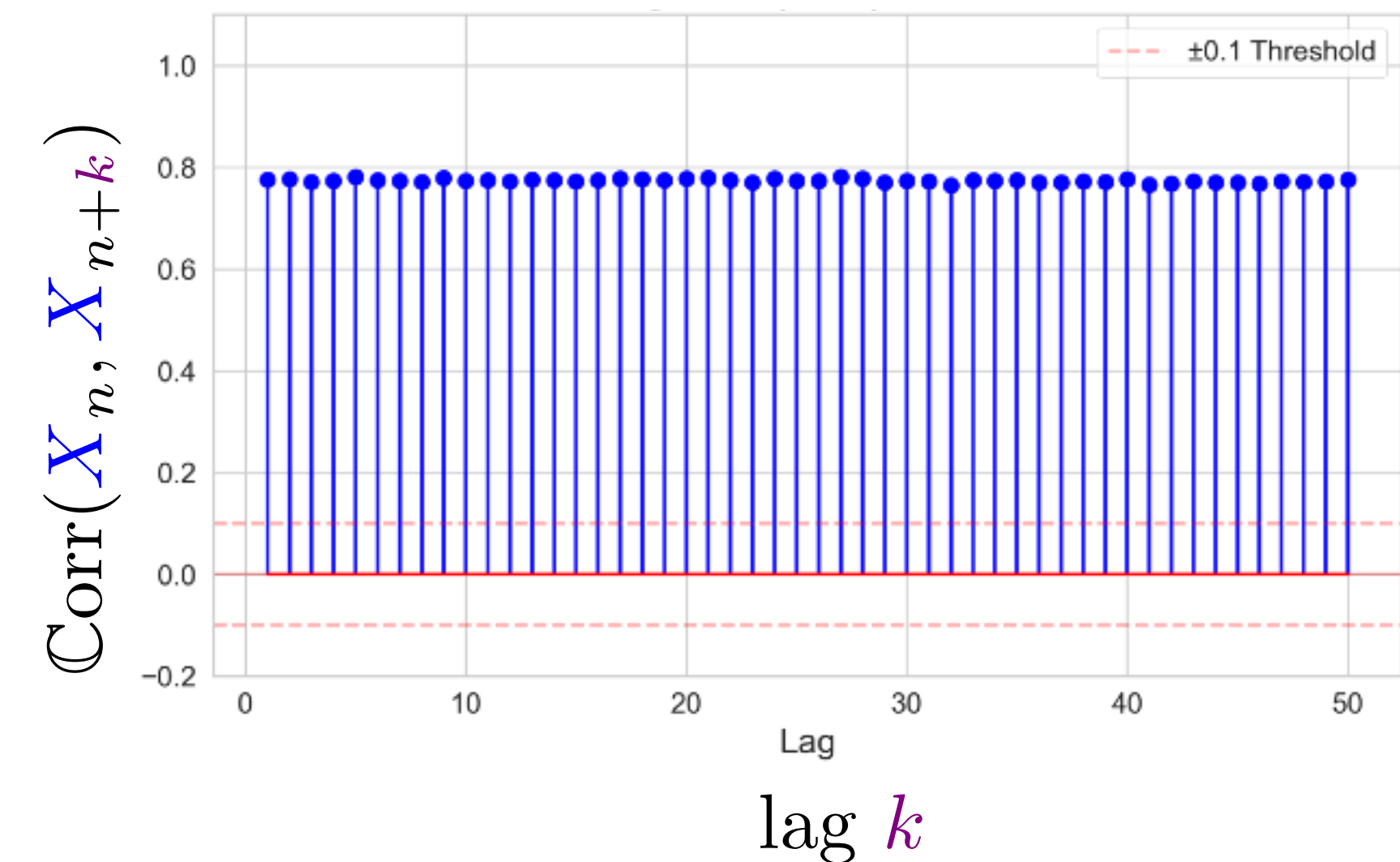
Drift excessif !



Est-ce une bonne chaîne MCMC ?

Drift excessif !

(autocorr inutile ici, on s'y attendait vu le trace plot)



Explications principales ?

Très probablement:

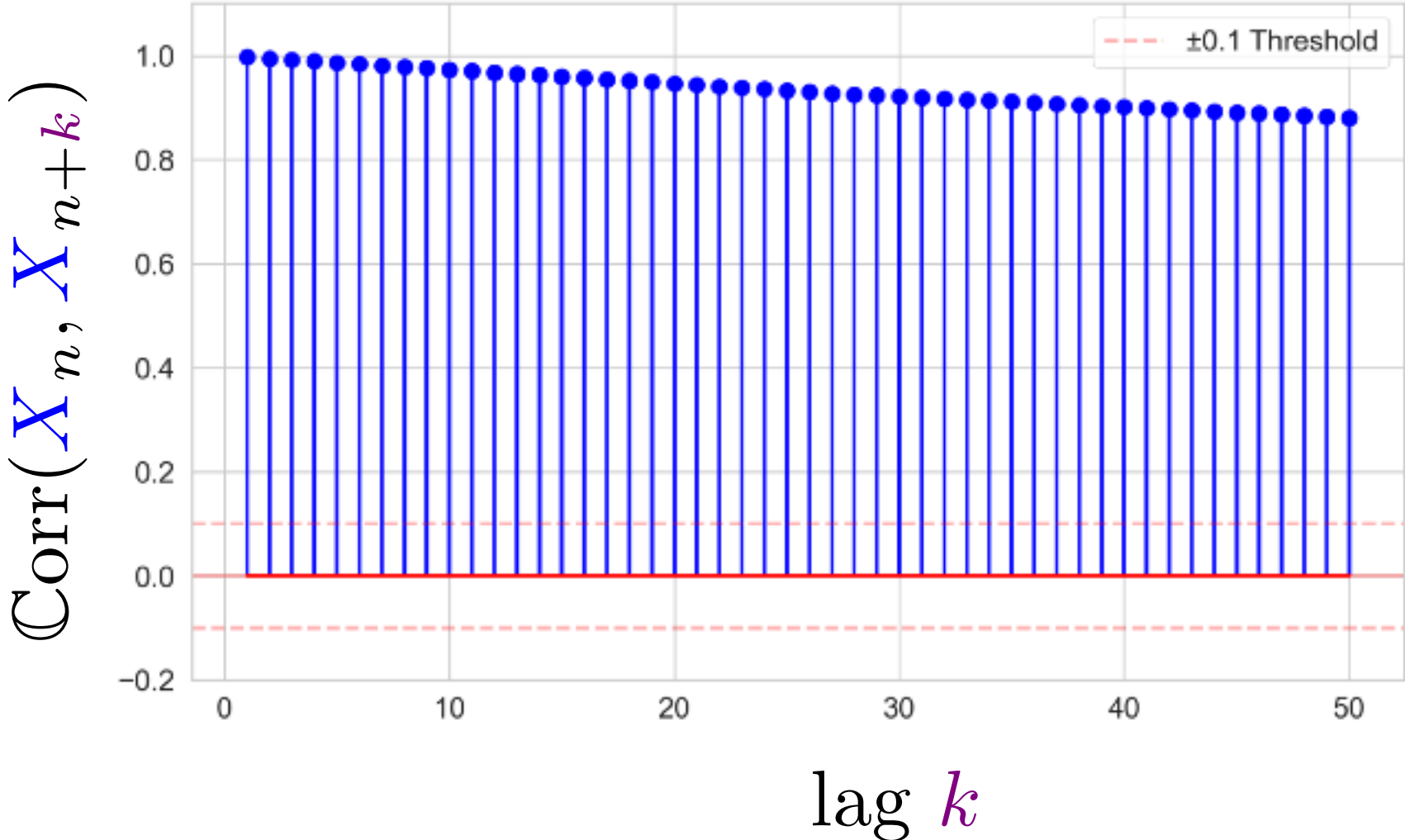
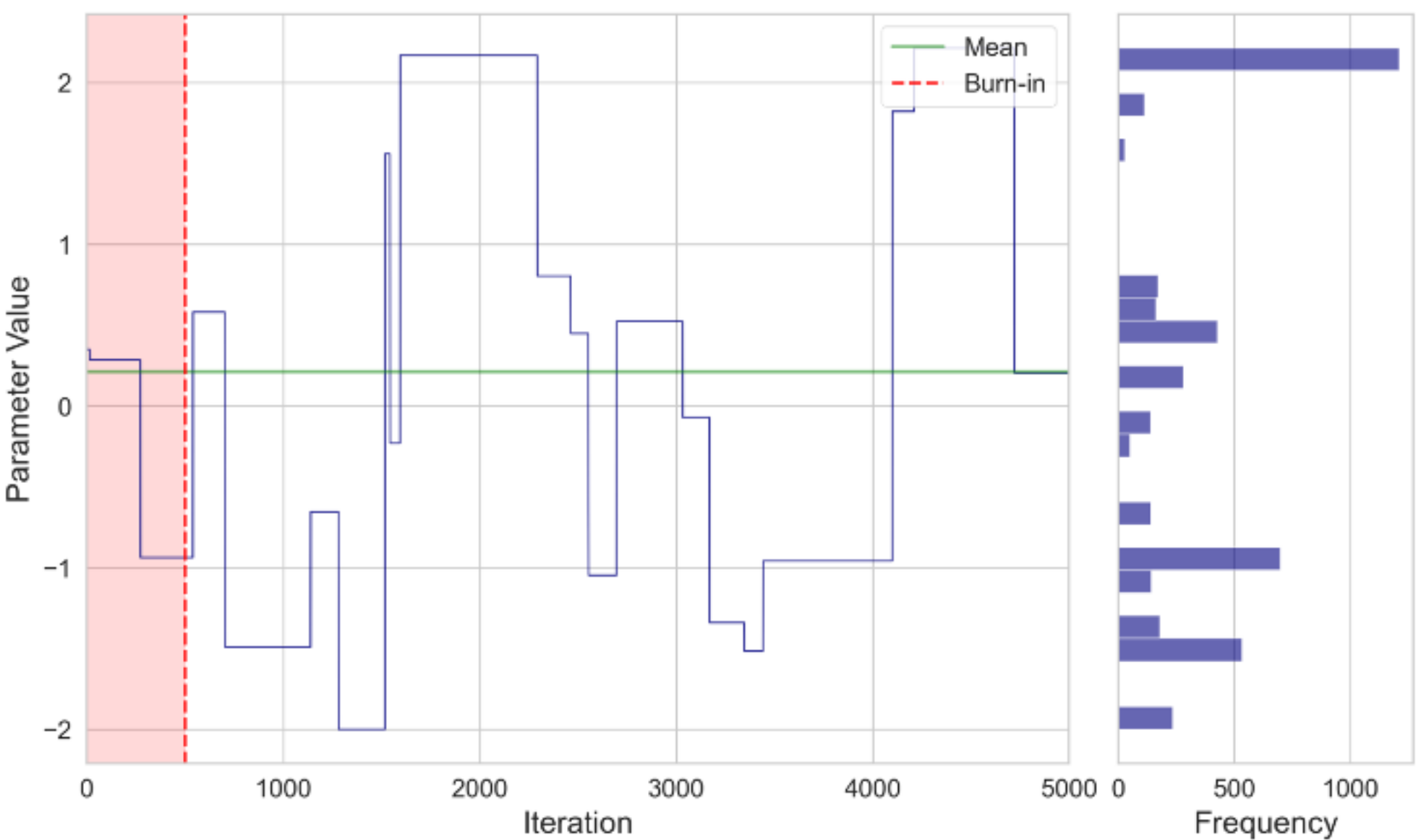
1. Erreur d'implémentation
2. Loi a priori extrêmement loin des données
3. Convergence très très lente



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)



(autocorr inutile ici, on s’y attendait vu le trace plot)



Est-ce une bonne chaîne MCMC ?