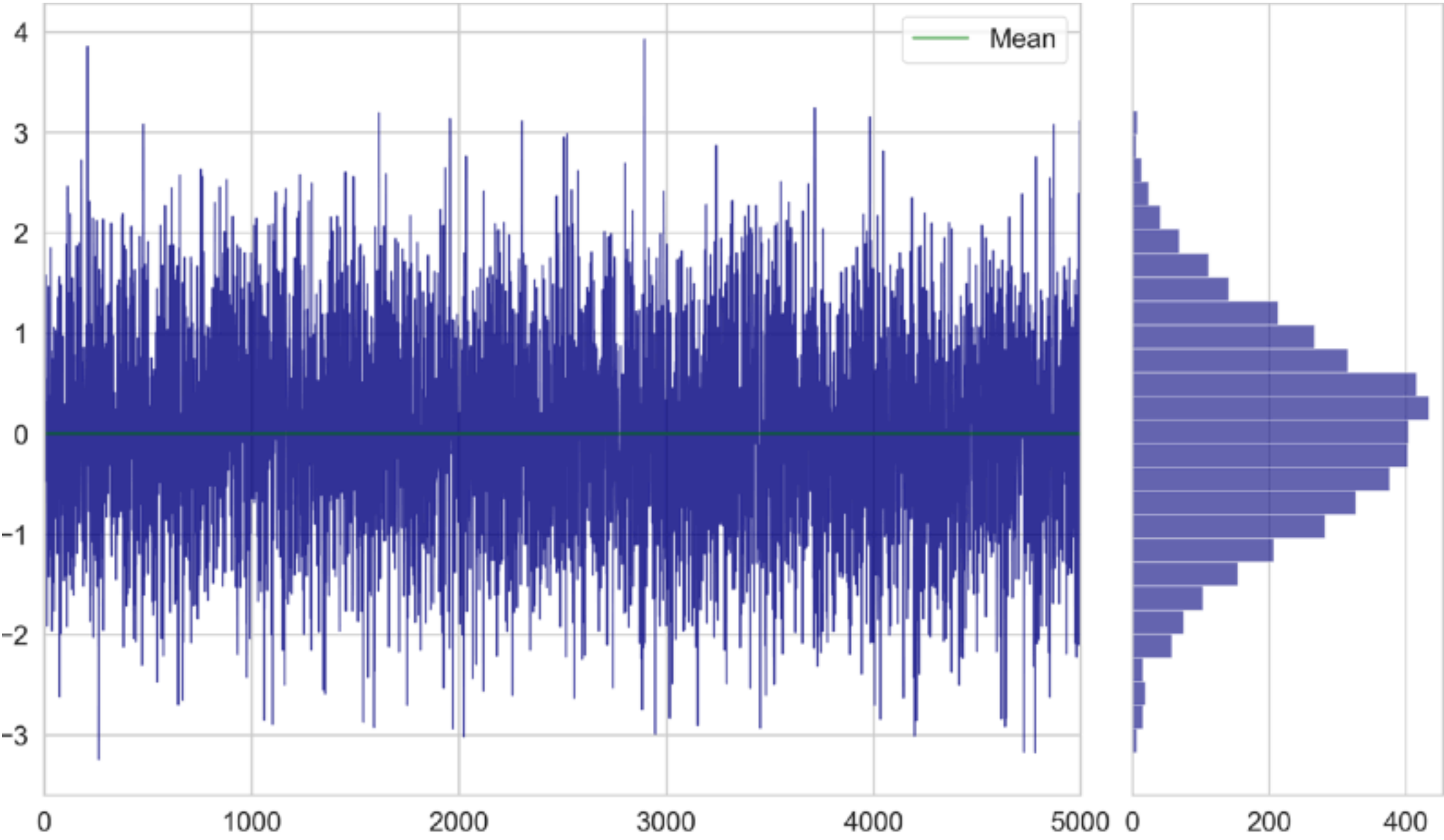




I N S E A





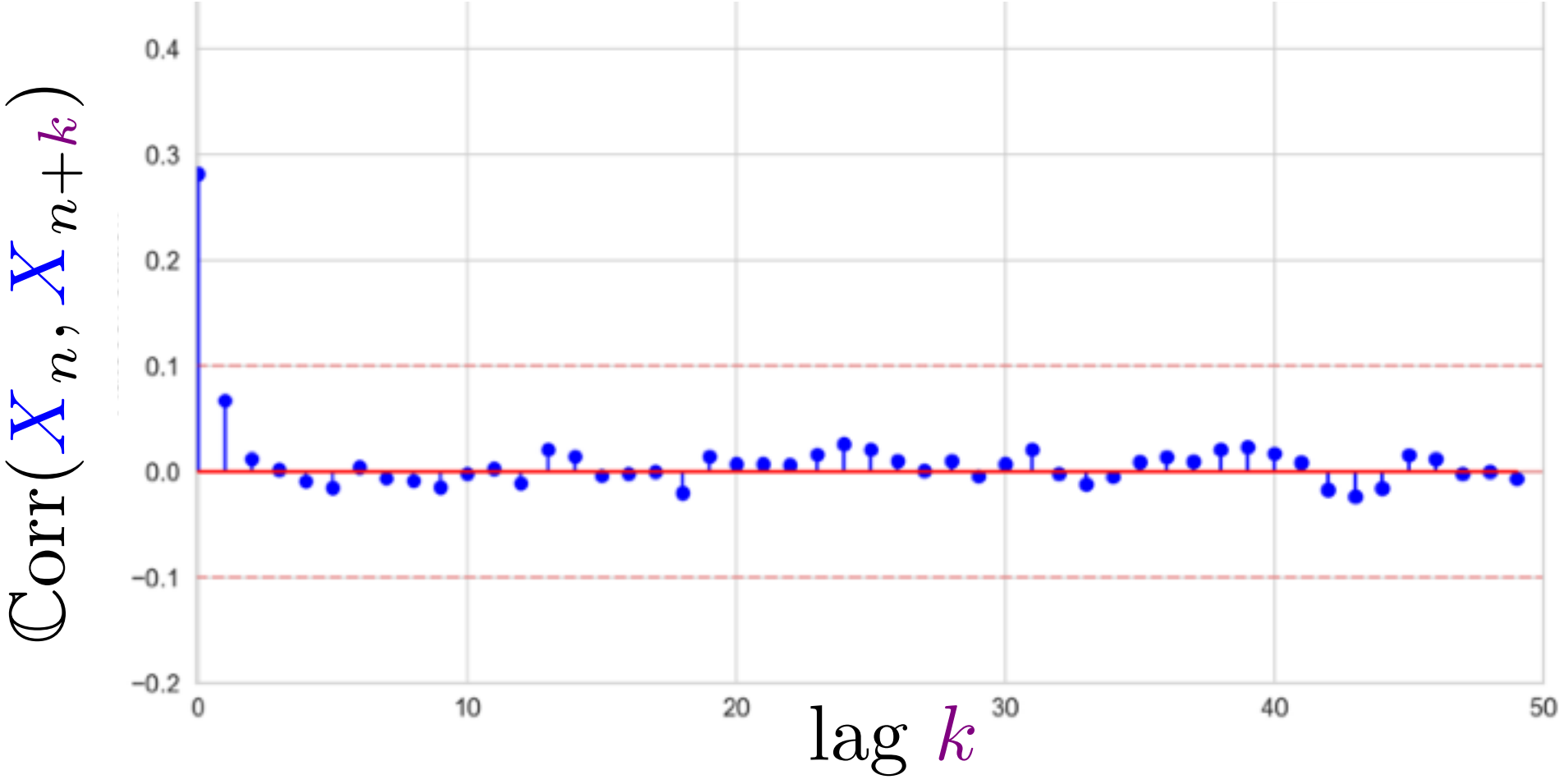


54

MMc diagnostics in 1D

Histogramme des échantillons

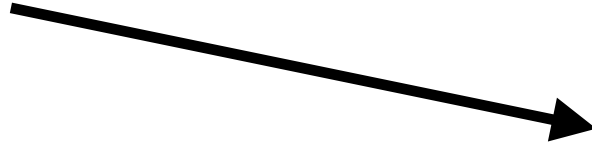




“Trace plot”

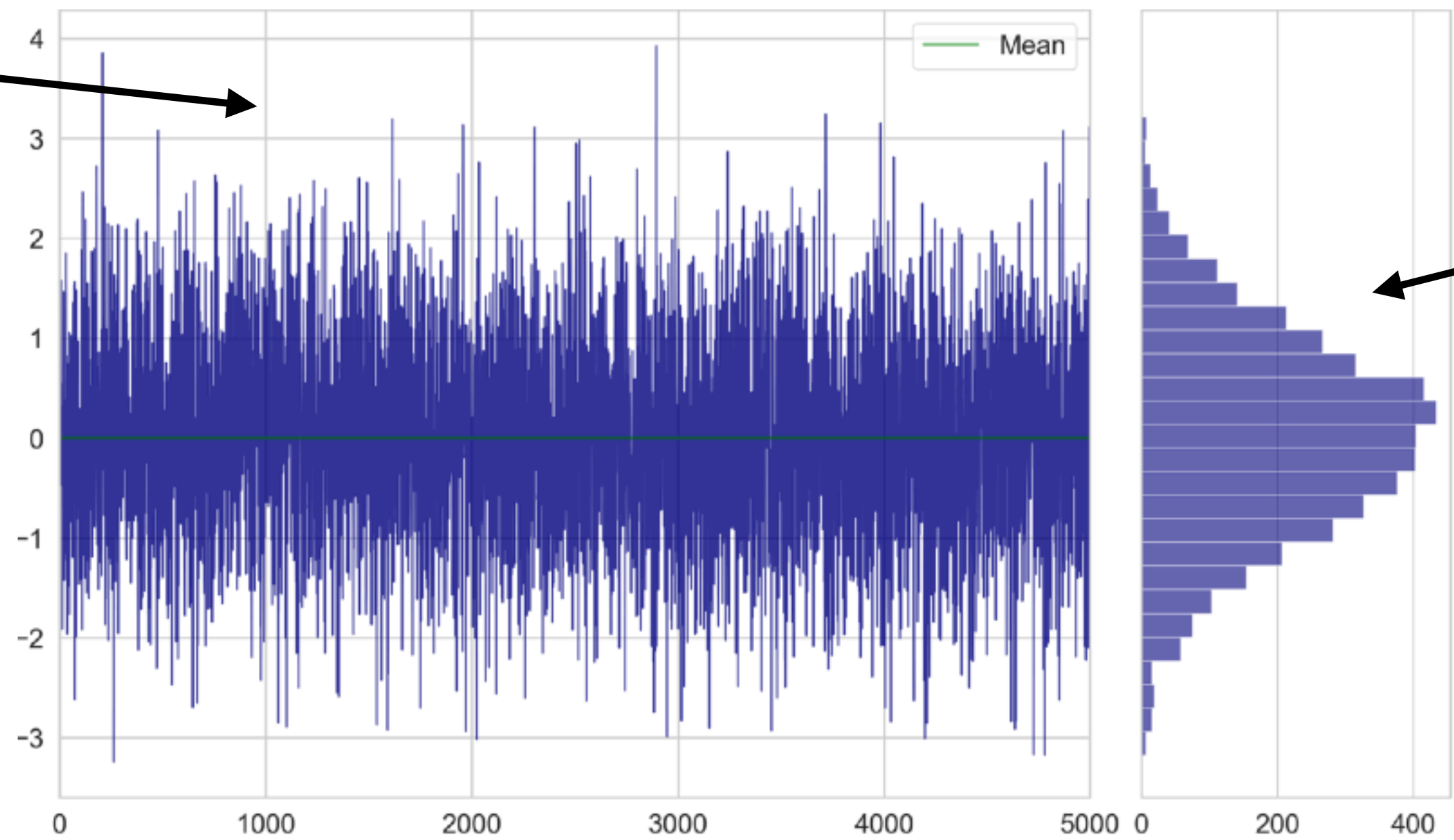


“Auto-correlation plot”



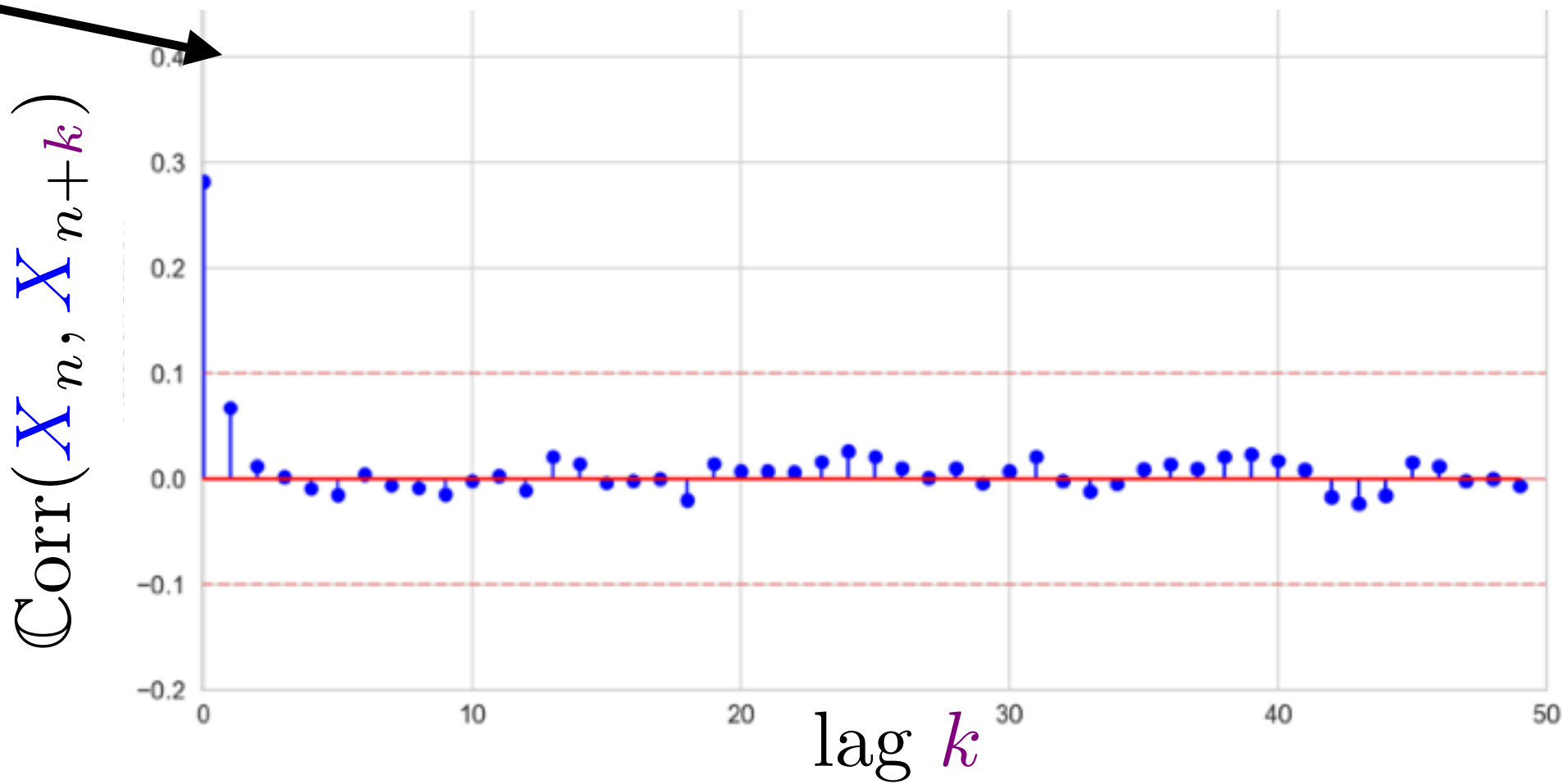
Visuais

“Trace plot”



Histogramme des échantillons

“Auto-correlation plot”

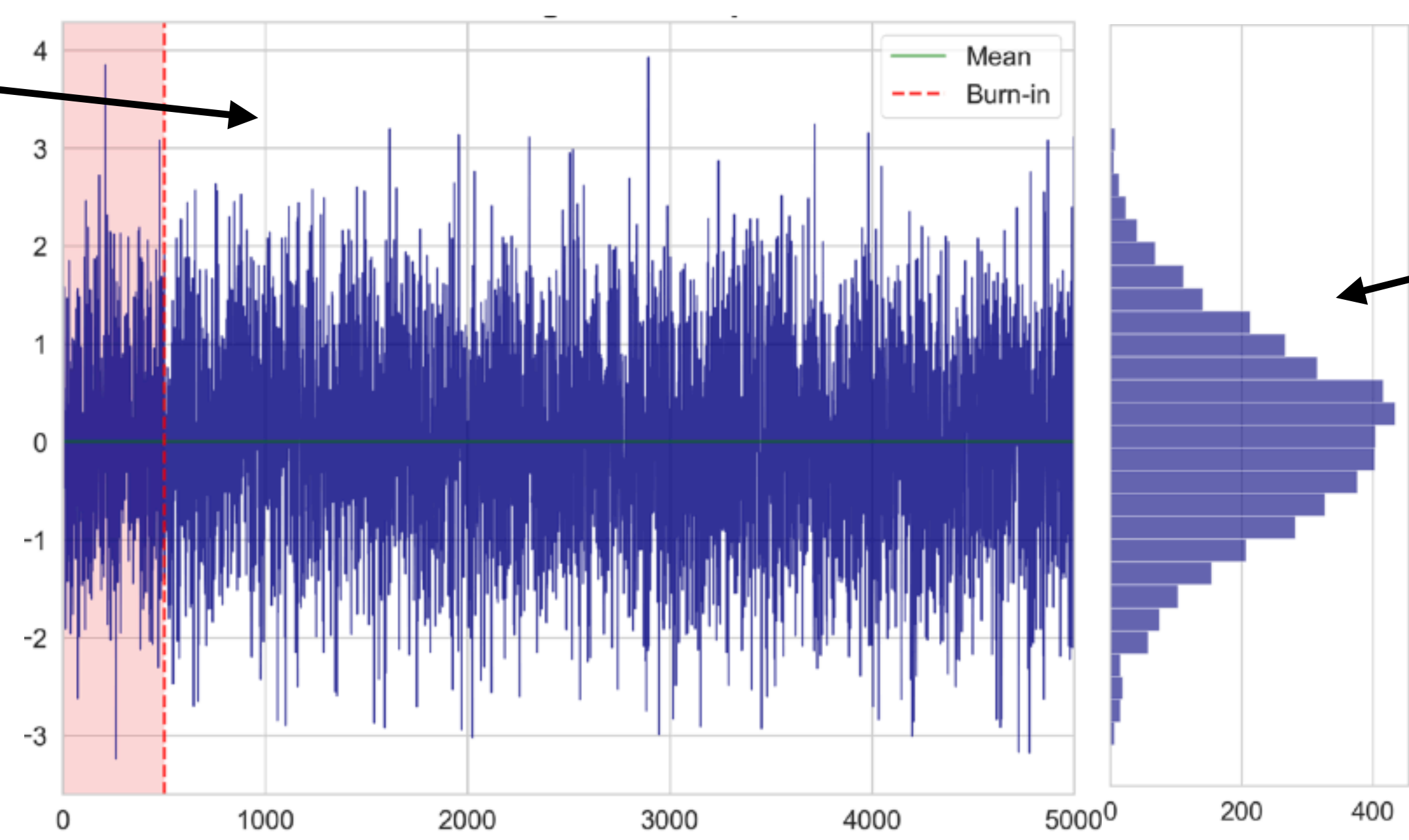


1. Pourquoi Monte-Carlo ? (Exemple de modèle hiérarchique)
2. Introduction à la méthode Monte-Carlo (historique, PRNG)
3. Algorithmes de simulation i.i.d (PRNG, transformation, rejet)
4. Méthodes MCMC (Gibbs, Metropolis)
5. Diagnostics de convergence MCMC
6. Méthodes MCMC avancées (Langevin, HMC, NUTS)



“Trace plot”

En pratique, on “jette” la première partie des échantillons pour être dans le régime stationnaire: période de “chauffe” / *Burn-in*.



Histogramme des échantillons

“Auto-correlation plot”

