

Notes sur le projet

Loi Marginale après gibbs

$$p(x) = \int p(x|y)p(y)dy = E_y[p(x|y)]$$

$$\hat{p}_m(x) = \frac{1}{m} \sum_{i=1}^m p(x|y = y_i)$$

Pour un estimateur

$$\hat{h} = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n h(\theta_i)$$

$$\text{Var}(\hat{h}) = \frac{1}{n-1} \sum_{j=1}^m \left(\hat{h}_j - \hat{h}^* \right)^2 \quad \text{avec} \quad \hat{h}^* = \frac{1}{n} \sum_{j=1}^m \hat{h}_j$$

Les autocorrélations des échantillons sont souvent une exponentielle décroissante.