

SIMULATION DE VARIABLES ALÉATOIRES - Algorithme de Metropolis-Hastings

CONFÉRENCIÈRE : Vanessa Bergeron-Laperrière

OÙ : 5183 pav. André-Aisenstadt

QUAND : Mercredi 4 août 2010 14h à 15h

RÉSUMÉ : Dans cette conférence, nous aborderons le problème de l'approximation de la valeur de l'espérance d'une fonction quelconque de variable aléatoire, lorsque l'intégrale est incalculable, ou dans les cas de très grandes dimensions. Ainsi, nous verrons différentes méthodes de simulation, et plus spécialement les méthodes de Monte Carlo par Chaîne de Markov (MCMC), en particulier l'algorithme Metropolis-Hastings et ses améliorations.