
JOURDAN GOLD, University of Guelph

Une étude de différentes approches dans la méthode de Monte Carlo par chaîne de Markov multi-étapes pour la simulation de distributions discrètes corrélées

On discutera d'une étude sur l'efficacité des divers algorithmes de type Monte Carlo par chaîne de Markov pour l'échantillonnage de distributions discrètes très corrélées. On considérera l'efficacité relative de diverses approches multi-étapes, y compris les algorithmes basés sur l'indépendance ou sur une marche aléatoire, ainsi que des combinaisons hybrides de ceux-ci. La divergence de Kullback-Liebler et la taille équivalente de l'échantillon seront utilisées pour analyser la qualité de l'algorithme dans ce processus de comparaison.