
JONATHAN LEE, University of Western Ontario

Parallélisation de MCMC à chaîne unique pour des applications en statistiques spatiales

Les méthodes MCMC représentent un moyen populaire d'échantillonner des distributions complexes. Le calcul parallèle est souvent utilisé pour générer des chaînes multiples et ainsi obtenir des échantillons plus rapidement. Cependant, pour les statistiques spatiales, nous rencontrons parfois des chaînes à longue période de rodage et à mauvais mélange pour lesquelles la parallélisation d'une chaîne unique peut s'avérer une meilleure option. Lorsque les paramètres dépendants sont nombreux, il s'agit d'un défi non trivial. Nous explorons les différentes façons d'utiliser le cadre d'une interface de passage de messages pour procéder à la parallélisation.