

Oddział Lubelski POLSKIEGO TOWARZYSTWA MATEMATYCZNEGO

oraz

Instytut Matematyki UMCS

zapraszają na odczyt pod tytułem

Markowskie metody Monte Carlo

Odczyt wygłosi

dr BŁAŻEJ MIASOJEDOW

**Wydział Matematyki, Informatyki i Mechaniki,
Uniwersytet Warszawski**

Czas i miejsce: 26 kwietnia 2017 roku (środa), godz. 10.15-12.00, Sala 2
Instytutu Matematyki UMCS

Streszczenie: Markowskie metody Monte Carlo (MCMC) są jednym z podstawowych narzędzi obliczeniowych stosowanych w statystyce. W referacie przedstawione będą podstawowe problemy obliczeniowe, dla których stosuje się algorytmy MCMC. Omówione zostaną podstawowe algorytmy MCMC, czyli algorytm Metropolisa-Hastingsa oraz próbnik Gibbsa. Następnie przedstawione będą najważniejsze wyniki teoretyczne dotyczące analizy algorytmów MCMC. W ostatniej części referatu omówione będą najważniejsze algorytmy wprowadzone w ostatnich latach oraz możliwe kierunki dalszego rozwoju metod MCMC.