

國立高雄大學統計學研究所

112 學年度書報討論題目暨摘要登記表

複合式吉氏取樣

Da-Jyun Lin(林大鈞)

摘要

吉氏取樣(Gibbs sampling)已是一種可用來產生聯合分佈樣本的 MCMC 演算法，透過對目標聯合分佈之完全條件分佈(full conditional distributions)間的疊代，可以簡單且有效地獲取樣本以進行後續統計推論。然而，收斂速度在遇到複雜的聯合分佈時經常表現出疲態，因此如何提高收斂效率就成為至關重要的課題。近年，隨著 PCGS (partially collapsed Gibbs sampler)的發展，即用非完全條件分佈置換部分的完全條件分佈，可以成功地加快吉氏取樣的收斂速度。在本研究中，我們將探討如何活用 PCGS 在複雜統計模型上。

指導教授簽名：

