



KYOTO UNIVERSITY GLOBAL COE PROGRAM

数学のトップリーダーの育成 - コア研究の深化と新領域の開拓

Global COE Seminar

第7回 離散幾何解析セミナー

日 時: 10月2日(金) 午後1時-2時30分
場 所: 京都大学理学研究科3号館552号室
講演者: 来嶋 秀治 氏 (京都大学 数理解析研究所)
題 目: マルコフ連鎖の混交時間とカップリング法

アブストラクト:

本発表ではマルコフ連鎖の収束スピードについて議論する. マルコフ連鎖モンテカルロ(MCMC)法は, 目的の分布を極限分布に持つマルコフ連鎖を設計し, そのマルコフ連鎖を十分な回数推移させ, 極限分布すなわち目的の分布に従うランダム標本を得る手法である. MCMC法を使う際, マルコフ連鎖の収束スピードは計算効率と結果の信頼性を議論する上で欠かせない話題である. 本発表では, 特に組合せ的構造を有限の状態空間として持つマルコフ連鎖を対象とし, 混交時間 (mixing time) を算定する手法としてカップリング法を紹介する.