

USTHB

FACULTÉ de MATHÉMATIQUE

DÉPARTEMENT de PROBABILITÉ et STATISTIQUE

Séminaire hebdomadaire du Laboratoire MSTD
2024/2025

Exposé du lundi 14 avril 2025
Salle 107 Bloc CAM 11h30

**Échantillonnage préférentiel via entropie croisée pour
l'estimation des probabilités d'évènements rares.**

S. GRABA

Abstract:

Les événements rares peuvent correspondre à des événements très importants et l'estimation de leurs probabilités est un enjeu crucial. Devant l'incapacité des méthodes de simulation conventionnelles qui nécessitent des temps d'exécution trop importants, le développement de nouvelles techniques était nécessaire. Nous abordons une d'entre elles : l'échantillonnage préférentiel via l'algorithme d'entropie croisée.