

Génération de nombres pseudo-aléatoires

Simon Flibotte

Résumé

Les nombres aléatoires sont utilisés dans de nombreux domaines : jeux vidéo, casinos, et même pour approximer numériquement des solutions à des problèmes mathématiques et physiques.

Dans cet exposé, nous verrons un peu les deux principaux types de problèmes de la simulation moderne :

1. La génération de la loi uniforme $(0,1)$, qui fait appel à la théorie des nombres.
2. La génération d'autres lois de probabilité.

Nous verrons aussi l'importance d'utiliser un bon générateur lors de la simulation de données dans un contexte d'inférence.