

Krzysztof Łatuszyński

University of Warwick

Paul Fearnhead

Lancaster University

Gareth O. Roberts

University of Warwick

Giorgos Sermaidis

Lancaster University

Losowanie istotne w czasie ciągłym dla nieredukowalnych dyfuzji

Opowiem o metodzie pozwalającej na estymację Monte Carlo bez błędu dyskretyzacji względem czasu dla dyfuzji nieredukowalnych, czyli takich, których nie da się przekształcić przekształceniem 1 – 1 do dyfuzji o równaniu ze stałym współczynnikiem dyfuzji, jak np. $dX_t = b(X_t) dt + 5 dB_t$.