

Variance Estimation for Adaptive Feynman-Kac Models

Qiming DU

21 mars, 2017

1 Tutoriel: Simulation des événements rares par Adaptive Multilevel Splitting

1. Introduction sur la méthode multilevel splitting
2. Un exemple naïf pour le problème statique
3. Un exemple sur la dynamique de Langevin

2 Estimateur de la variance pour les modèles de Feynman-Kac adaptives

1. Introduction sur le modèle de Feynman-Kac classique
2. Introduction sur le modèle d'arbres généalogiques
3. Un estimateur de la variance pour le modèle de Feynman-Kac adaptive