



● 首页

关于我们

分类

- 学院简介
- 院长致词
- 工作论文
- 学术机构
- 学术研究所
- 学术顾问委员会
- 教学支撑平台
- 计量经济学研究中心
- 讲座资源平台
- 金融研究中心
- 教务管理平台
- 中国劳动经济学与社会
- 科研管理平台
- 现代统计学研究中心
- 协同办公平台
- 中国宏观经济与金融研
- WISE论坛
- 政治经济学研究中心
- WISE考试网
- SAS计量经济学合作中
- WISE院刊
- 行政机构
- 发表论文
- 院长办公室
- 高性能计算与数据中心
- 图书资料室
- 高级培训与咨询中心

● 学院人员

✚ 搜索

○ 博士后人员

● 人才培养

- 专业介绍
 - 劳动经济学
 - 统计学
 - 西方经济学
 - 金融学
 - 数量经济学
- 课程介绍
- 博士后流动站
- 博士研究生
 - 06级博士生
 - 07级博士生
 - 08级博士生
 - 09级博士生
 - 10级博士生
- 硕士研究生
 - 05级硕士生
 - 06级硕士生
 - 07级硕士生
 - 08级硕士生
 - 09级硕士生
 - 10级硕士生
- 本科双学位
- 留学生
 - 08级留学生

● 学生就业

- 2008届毕业生
- 2009届毕业生
- 2010届毕业生

● 学术研究

- 工作论文
- 发表论文
- 研究项目

● 讲座系列

- 本学期讲座日程表
- IZA劳动经济学讲座
 - 本学期
 - 2009秋季
 - 2009春季
 - 2008秋季



首页 - 资源库

On Generating Monte Carlo Samples of Continuous Diffusion Bridges

作者: Ming Lin,Rong Chen,Per Mykland 编号: 20100311 被浏览: 2372次

This paper is accepted by *Journal of the American Statistical Association*.

Abstract: Diffusion processes are widely used in engineering, finance, physics and other fields. Usually continuous time diffusion processes are only observable at discrete time points. For many applications, it is often useful to impute continuous time bridge samples that follow the diffusion dynamics and connect each pair of the consecutive observations. The Sequential Monte Carlo (SMC) method is a useful tool to generate the intermediate paths of the bridge. Often the paths are generated forward from the starting observation and forced in some ways to connect with the end observation. In this paper we propose a constrained SMC algorithm with an effective resampling scheme that is guided by backward pilots carrying the information of the end observation. This resampling scheme can be easily combined with any forward SMC sampler. Two synthetic examples are used to demonstrate the effectiveness of the resampling scheme.

Keywords: Stochastic diffusion equation, Sequential Monte Carlo, Resampling, Priority score, Backward pilot.

[点击进入下载](#)

上一条: Exploring the Relati 下一条: Self-Selectivity in

联系方式:

通讯地址: 厦门大学王亚南经济研究院经济楼A308

邮政编码: 361005

联系电话: 86-592-2188827

传 真: 86-592-2187708

电子邮件: wise@xmu.edu.cn

- 2008春季
- 2007秋季
- 高级经济学讲座
 - 本学期
 - 2009秋季
 - 2009春季
 - 2008秋季
 - 2008春季
 - 2007秋季
 - 2007春季
 - 2006
 - 2005
- 青年学者论坛
 - 本学期
 - 2009秋季
 - 2009春季
 - 2008秋季
 - 2008春季
 - 2007秋季
 - 2007春季
- 职业发展讲座
 - 2011春季
 - 2010秋季
 - 2010春季
 - 2009秋季
 - 2009春季
 - 2008秋季
- 午餐学术讲座
- SMU-MAF讲座
 - 本学期
 - 2008秋季
 - 2008春季
- 会议活动
 - 即将举办
 - 已经举办
 - 2010
 - 2009
 - 2008
 - 2007
 - 2006
 - 2005
- 资源库
 - 学生事务表单下载
 - 学术研究网
 - 教学支撑平台
 - 讲座资源平台
 - 教务管理平台
 - 科研管理平台
 - 协同办公平台
 - WISE论坛
 - WISE考研网
 - WISE院刊
 - 厦门风光
- 校企合作
- 人文地理
 - 厦大风光
 - 厦门风光
 - 武夷山
 - 泉州（开元寺、市区、闽台博物馆）
 - 湄洲湾（妈祖庙）
 - 客家土楼
 - 古田会议