



Università degli Studi di Pavia

Dottorato di Ricerca in Bioingegneria
e Bioinformatica
Dipartimento di Informatica e Sistemistica

AVVISO DI SEMINARIO

Variance reduction strategies in MCMC

Prof. Antonietta Mira
Università dell'Insubria

Abstract

*We illustrate two general purpose variance reduction techniques.
The first one works both for Monte Carlo and Markov Chain Monte Carlo (MCMC) estimators and is based on the zero-variance principle introduced in the physics literature by Assaraf and Caffarel (1999, 2003).
The second one aims at reducing the autocorrelation along the simulated path of the Markov chain and thus reducing the asymptotic variance of the resulting MCMC estimators.*

28 maggio 2010, ore 14:30,
Aula Seminari, piano D
Dipartimento di Informatica e Sistemistica, V. Ferrata 1, Pavia

I dottorandi e gli interessati sono cordialmente invitati

L'organizzatore
Prof. R. Bellazzi

Il coordinatore del dottorato
Prof. A. Buizza

Per informazioni:
<http://dis.unipv.it/events.html>
semenza@unipv.it
0382 985757



**DIPARTIMENTO DI
INFORMATICA E SISTEMISTICA**
V. Ferrata 1 – 27100 PAVIA

