

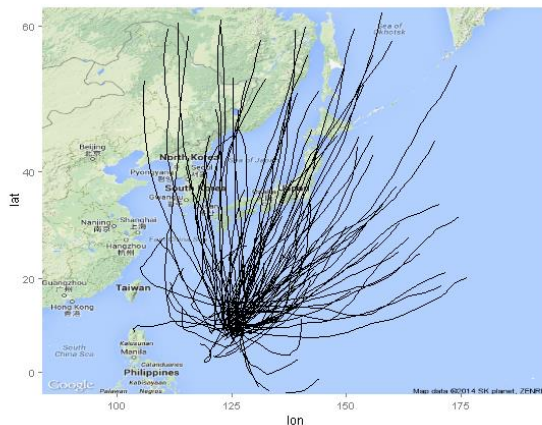
粒子モンテカルロ法による時間逆転シミュレーション

高柳 慎一(総研大) 伊庭幸人(統数研)

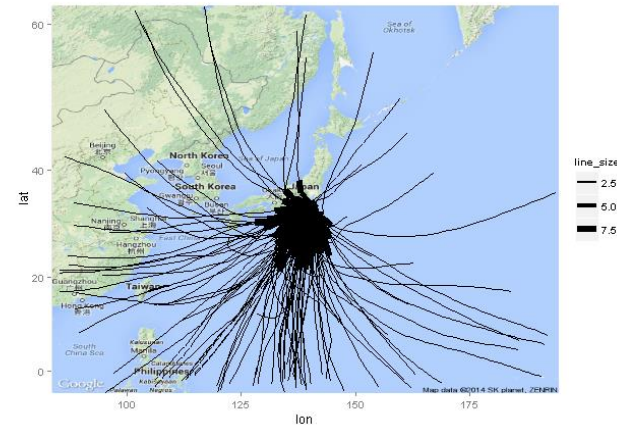
確率モデルが与えられたときのレアイベント生成
ゴールが与えられたときのシナリオと生起確率が欲しい
→ 目標から時間反転して逆に解く

例: 確率台風モデル

[順方向]



[時間反転]



計算可能な近似 → 経路の重みで補正して正しい確率を出す
→ 粒子モンテカルロ(逐次モンテカルロ) 分裂・消滅