

# Notes and To-Do:

April 16, 2020

- Complete section 4.3.
- Optimize model 1.
- Try third transformation.
- Speed reversion parameter analysis.
- Threshold  $\eta$ .
- Optimize with  $a = -1 + \epsilon$  and  $b = 1 - \epsilon$ .
- Try to optimize using only data with few error, to check if we reduce the variance and the histograms matches better.
- Try to do a double optimization for Lamperti.

## Meeting with Marco:

- Algun intervalo se escapa? Si se escapa, podemos hacer Euler adaptativo.
- Intervalo de confianza puntual.
- Trabajar con el maximo y minimo de la trayectoria.
- La variabilidad no cambia en el tiempo. Es una limitacion de este modelo.
- Preguntar a Ahmed donde es importante  $\theta_t < \infty$ .