



SÉMINAIRE DE MATHÉMATIQUES ACTUARIELLES ET FINANCIÈRES

organisé par *Quantact*, le *Laboratoire de mathématiques actuarielles et financières*
du CRM

PK-5115

201, avenue du Président-Kennedy, Montréal

Département de mathématiques, UQAM

27 septembre 2017, 15:30-16:30

Yuliya Mishura

Taras Shevchenko National University of Kyiv

Option pricing in the markets with fractional stochastic volatility

We consider what is fractional Brownian motion and why it is popular in finance. We treat the models with stochastic volatility that involves a fBm and produce all the machinery for approximate and numerical option pricing, together with the rate of convergence to a true value.

Du café et une collation légère seront servis à 15:15.

Site web: www.quantact.uqam.ca/pages/seminaires