

Lucia Caramellino- *Università di Roma “Tor Vergata”*

Titolo: Numerical option pricing under stochastic volatility

Abstract: In questo seminario, nell’ambito dei modelli a volatilità stocastica, si mostrerà una procedura ibrida che coinvolge sia tecniche ad albero sia tecniche di risoluzione numerica di equazioni alle derivate parziali.