

平成 30 年度

広島大学理学研究科
数学教室談話会

平成 30 年 11 月 27 日 (火) 午後 1 時
広島大学理学部 B 棟 7 階 B707 教室

Kabanov Yuri 氏 (University of Franche-Comté)

題目 : A multi-asset version of the Kusuoka hedging theorem for markets with small transaction cost

In the famous paper of 1995 Kusuoka showed that the binomial approximation of the price process given by a geometric Brownian motion does not lead to the Black-Scholes price of contingent claims in the presence of small transaction costs and calculated the discrepancy. We extend his result to the multinomial approximation of a multi-asset model of a currency market where the exchange rates are given by correlated geometric Brownian motions.

問合せ先:

広島大学理学研究科数学教室談話会係

〒 739-8526 東広島市鏡山 1-3-1

電話: 082-424-7330 (川下 美潮)

email: kawasita@hiroshima-u.ac.jp

最新の教室情報はホームページをご覧ください。

<http://www.math.sci.hiroshima-u.ac.jp/index-j.html>

※ 本セミナーは、5 研究科共同セミナーを兼ねています。