

Y. Doç. Dr. Yeliz Yolcu Okur

Uygulamalı Matematik Enstitüsü, ODTÜ, 06800, Ankara, Türkiye

### **Stokastik Volatilité Modellerinde Malliavin Kalkülüs Kullanılarak Duyarlılık Analizi**

Greekler opsiyonların üzerine yazılan varlıkların parametrelerine göre kısmi türevleridir ve duyarlılık analizinde önemli bir yer tutmaktadır. Biz bu çalışmamızda, volatilitenin de bir stokastik süreç olduğu varsayımı altında Avrupa tipi opsiyonlar için Malliavin analizinde önemli bir yer tutan parçalı türev alma (integration by parts) teoremini kullanarak kısmi türevleri inceleyeceğiz. (B. Yılmaz, A. İnkaya ve T. Sayer ile ortak çalışma)