ΕΘΝΙΚΟ ΜΕΤΣΟΒΙΟ ΠΟΛΥΤΕΧΝΕΙΟ
ΣΧΟΛΗ ΕΦΑΡΜΟΣΜΕΝΩΝ ΜΑΘΗΜΑΤΙΚΩΝ ΚΑΙ ΦΥΣΙΚΩΝ ΕΠΙΣΤΗΜΩΝ
ΤΟΜΕΑΣ ΜΑΘΗΜΑΤΙΚΩΝ
Ηρώων Πολυτεχνείου 5
Πολυτεχνειούπολη Ζωγράφου, Κτήριο Ε
ΤΚ. 157 73, ΑΘΗΝΑ

NATIONAL TECHNICAL UNIVERSITY OF ATHENS
SCHOOL OF APPLIED MATHEMATICAL AND PHYSICAL SCIENCES
DEPARTMENT OF MATHEMATICS
5, Heroes of Polytechniou Avenue
Zografou Campus, E Building
GR.-157 73 ATHENS, GREECE

☎: + 30 210 772 1748, 1744, 3291 - Telefax: + 30 210 77 21775

Αθήνα, 5/12/2017

Δ Ι Α Λ Ε Ξ Η

Ομιλητής: **Αντώνιος Παπαπαντολέων**

(Ε.Μ.Π.)

Τίτλος : **«Optimal transport, improved Fréchet-Hoeffding bounds and applications»**

Περίληψη: We consider a multivariate random variable with known marginals and unknown dependence structure. In this talk, we will present several methods for sharpening the classical Fréchet-Hoeffding bounds on copulas by using additional, partial information on the dependence structure. Then we will discuss applications of these results for deriving bounds on option prices and portfolio Value-at-Risk in this setting of model / dependence uncertainty. Time permitting, we will also discuss the detection of arbitrage in multi-asset markets and model-free hedging of multi-asset derivatives.

Η ομιλία θα δοθεί την **Παρασκευή 8 Δεκεμβρίου 2017** και **ώρα 13:35**, στην Αίθουσα Σεμιναρίων του Τομέα Μαθηματικών, κτ. Ε΄, 2ος όροφος.

Η Επιτροπή Σεμιναρίων