



# Avviso di Seminario

*Giovedì 20 Ottobre 2005 alle ore 17.00*

*presso l' Aula A02*

*del Dipartimento di Fisica e Tecnologie Relative*

*Viale delle Scienze, Edificio 18, Palermo*

*il*

*Prof. Jaume Masoliver*

*del Departament de Física Fonamental*

*Universitat de Barcelona.*

*terrà un seminario dal titolo:*

*Stochastic volatility models: long and short  
correlations*

## *Abstract*

*We will present a brief account of relevant empirical observations on daily volatility. We will also outline the main results provided by some traditional stochastic volatility models, such as the Ornstein-Uhlenbeck model, the Heston model, and the exponential Ornstein-Uhlenbeck model.*

Per informazioni contattare R. N. Mantegna (091-6615074 [mantegna@unipa.it](mailto:mantegna@unipa.it)) Dipartimento di Fisica e Tecnologie Relative, Viale delle Scienze, Edificio 18, Palermo oppure consultare il sito internet <http://lagash.dft.unipa.it> alla pagina *Seminars*.

