

TESIS

**SIMULASI P-MARTINGALE EMPIRIS DAN APLIKASINYA PADA
PENENTUAN HARGA OPSI ASIA**

**(*EMPIRICAL P-MARTINGALE SIMULATION AND ITS APPLICATION
IN ASIAN OPTIONS PRICING*)**



WIRAWAN SETIALAKSANA
13/351419/PPA/04180

**PROGRAM STUDI S2 MATEMATIKA
JURUSAN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS GADJAH MADA
YOGYAKARTA**

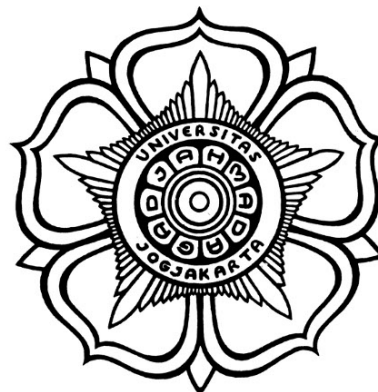
2015

TESIS

**SIMULASI P-MARTINGALE EMPIRIS DAN APLIKASINYA PADA
PENENTUAN HARGA OPSI ASIA**

**(*EMPIRICAL P-MARTINGALE SIMULATION AND ITS APPLICATION
IN ASIAN OPTIONS PRICING*)**

Diajukan untuk memenuhi salah satu syarat memperoleh derajat
Master of Science Matematika



WIRAWAN SETIALAKSANA
13/351419/PPA/04180

**PROGRAM STUDI S2 MATEMATIKA
JURUSAN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS GADJAH MADA
YOGYAKARTA**

2015