UNIVERSITAS
GADJAH MADA
Analisis Profitabilitas Penerapan Model LÃ©vy-driven Ornstein-Uhlenbeck Pada Strategi Pasangan Arbitrase Statistik
Margaretha Novita Nadeak, Prof. Dr. Drs. Gunardi, M.Si.
Universitas Gadjah Mada, 2025 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

SKRIPSI

ANALISIS PROFITABILITAS PENERAPAN MODEL LÉVY-*DRIVEN* ORNSTEIN-UHLENBECK PADA STRATEGI PASANGAN ARBITRASE STATISTIK

(*PROFITABILITY ANALYSIS OF LÉVY-DRIVEN ORNSTEIN-UHLENBECK MODEL IMPLEMENTATION ON STATISTICAL ARBITRAGE PAIRS STRATEGIES*)

Margaretha Novita Nadeak
21/480856/PA/20915

PROGRAM SARJANA PROGRAM STUDI ILMU AKTUARIA
DEPARTEMEN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS GADJAH MADA
YOGYAKARTA

2025

UNIVERSITAS
GADJAH MADA
Analisis Profitabilitas Penerapan Model LÃ©vy-driven Ornstein-Uhlenbeck Pada Strategi Pasangan Arbitrase Statistik
Margaretha Novita Nadeak, Prof. Dr. Drs. Gunardi, M.Si.
Universitas Gadjah Mada, 2025 | Diunduh dari http://etd.repository.ugm.ac.id/

HALAMAN PENGESAHAN

SKRIPSI

ANALISIS PROFITABILITAS PENERAPAN MODEL LÉVY-*DRIVEN* ORNSTEIN-UHLENBECK PADA STRATEGI PASANGAN ARBITRASE STATISTIK

Telah dipersiapkan dan disusun oleh

Margaretha Novita Nadeak
21/480856/PA/20915

Telah dipertahankan di depan Tim Penguji
pada tanggal 24 Juli 2025

Susunan Tim Penguji

Prof. Dr. Drs. Gunardi, M.Si.
Pembimbing Utama

Danang Teguh Qoyyimi, S.Si., M.Sc., Ph.D.
Ketua Tim Penguji

Restu Ananda Putra, S.Si., M.Aktr.
Penguji

Mengetahui,
a.n. Dekan FMIPA UGM
Wakil Dekan Bidang Pendidikan, Pengajaran dan Kemahasiswaan

Prof. Drs. Roto, M.Eng., Ph.D.
NIP. 196711171993031020