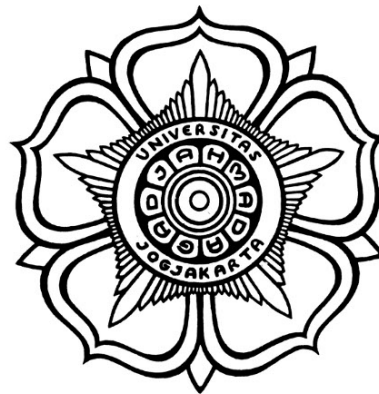


DISERTASI

**PENENTUAN HARGA OPSI INDONESIA DI BAWAH MODEL GERAK
BROWN FRAKSIONAL CAMPURAN UNTUK SAHAM YANG
MEMENUHI SIFAT *LONG MEMORY***

**(*INDONESIAN OPTION PRICING UNDER MIXED FRACTIONAL
BROWNIAN MOTION FOR STOCK WITH LONG MEMORY
PROPERTY*)**



Chatarina Enny Murwaningtyas

15/389865/SPA/00539

**PROGRAM STUDI DOKTOR MATEMATIKA
DEPARTEMEN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS GADJAH MADA
YOGYAKARTA**

2021