

SKRIPSI

**PENENTUAN HARGA OPSI JUAL AMERIKA
DENGAN VOLATILITAS MODEL GARCH
MENGUNAKAN SIMULASI**

(STUDI KASUS SAHAM IBM INC.)

**AMERICAN PUT OPTION PRICING WITH GARCH MODEL
VOLATILITY USING SIMULATION**



Oleh:

RAHMANIAR DWINTA KUSUMA

10/297341/PA/12975

**PROGRAM STUDI STATISTIKA
FAKULTAS ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS GADJAH MADA
YOGYAKARTA**

2015