

SKRIPSI

**PENENTUAN HARGA OPSI BELI TIPE EROPA MENGGUNAKAN
MODEL VOLATILITAS STOKASTIK HESTON DENGAN PERANGKAT
LUNAK PYTHON DAN R**

**(PRICING OF EUROPEAN CALL OPTIONS USING HESTON
STOCHASTIC VOLATILITY MODEL IN PYTHON AND R SOFTWARE)**



SALSABILA ALYA ANDRA

17/411331/PA/17851

**PROGRAM STUDI S1 STATISTIKA
DEPARTEMEN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS GADJAH MADA
YOGYAKARTA**

2021

SKRIPSI

**PENENTUAN HARGA OPSI BELI TIPE EROPA MENGGUNAKAN
MODEL VOLATILITAS STOKASTIK HESTON DENGAN PERANGKAT
LUNAK PYTHON DAN R**

**(PRICING OF EUROPEAN CALL OPTIONS USING HESTON
STOCHASTIC VOLATILITY MODEL IN PYTHON AND R SOFTWARE)**

Diajukan untuk memenuhi salah satu syarat memperoleh derajat Sarjana Sains
Statistika



SALSABILA ALYA ANDRA

17/411331/PA/17851

**PROGRAM STUDI S1 STATISTIKA
DEPARTEMEN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS GADJAH MADA
YOGYAKARTA**

2021