



**UNIVERSITAS
PRASETIYA MULYA**

TUGAS AKHIR

**METODE MONTE CARLO UNTUK
PERHITUNGAN HARGA OPSI EROPA
DENGAN VOLATILITAS STOKASTIK MODEL
HESTON**

**REYNANDA ADHIMA PURWOKO
23101810094**

**PROGRAM STUDI SARJANA MATEMATIKA
UNIVERSITAS PRASETIYA MULYA
JAKARTA, 2022**



**UNIVERSITAS
PRASETIYA MULYA**

**METODE MONTE CARLO UNTUK
PERHITUNGAN HARGA OPSI EROPA
DENGAN VOLATILITAS STOKASTIK MODEL
HESTON**

Oleh

REYNANDA ADHIMA PURWOKO
23101810094

Tugas akhir ini sebagai salah satu syarat untuk memperoleh gelar
Sarjana Matematika

**PROGRAM STUDI SARJANA MATEMATIKA
UNIVERSITAS PRASETIYA MULYA
JAKARTA, 2022**