

Penentuan harga opsi Asia

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20339200&lokasi=lokal>

Abstrak

Opsi Asia dengan European style adalah opsi yang payoff-nya bergantung pada rata-rata harga aset selama masa hidup opsi dan hanya dapat dieksekusi pada saat jatuh tempo saja. Tujuan dari penulisan tugas akhir ini adalah menentukan harga opsi Asia menggunakan rata-rata geometrik dan rata-rata aritmatik melalui pendekatan terhadap rata-rata geometrik. Untuk menentukan harga opsi Asia menggunakan rata-rata geometrik dapat dilakukan dengan didekati ke kerangka Black-Scholes sehingga didapat formula Black-Scholes untuk opsi call Asia dan opsi put Asia. Sedangkan untuk menentukan harga opsi Asia menggunakan rata-rata aritmatik, dilakukan melalui pendekatan terhadap rata-rata geometrik yang dikemukakan oleh Michael Curran