

Analisa pada instrumen keuangan dan volatilitas terapan pada sekuritas = The Analysis on financial instruments and implied volatility on securities

Muhammad Ilham Ramadhan, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20482423&lokasi=lokal>

Abstrak

ABSTRAK

Karya ilmiah ini menjelaskan tentang analisis mengenai beberapa instrumen keuangan dan dampak dari volatilitas terhadap Morgan Stanley pada krisis keuangan tahun 2008 menggunakan Bloomberg Terminal. Pertama, analisis dilakukan terhadap ekspektasi pasar yang akan datang pada kekuatan dari dua jenis mata uang yang berbeda yaitu Dolar Amerika dan Dolar Singapura. Kedua, analisis dilakukan untuk menentukan harga dari sebuah European Plain Vanilla Option pada suatu perusahaan dalam hal ini Intel Corporation. Analisis ketiga dilakukan untuk menyusun suatu strategi yang tepat dalam Option Trading. Keempat, menjelaskan volatilitas di antara Dolar Amerika dan Peso Meksiko pada saat kampanye pemilihan presiden Amerika Serikat 2016 yang dimana Donald Trump menyetuskan kebijakan yang dinilai kontroversial terhadap Meksiko. Analisis terakhir yaitu mengukur volatilitas pasar terhadap Morgan Stanley pada saat krisis keuangan tahun 2008.

<hr>

ABSTRACT

This paper explains the analysis of several financial instruments and the impact of volatility on Morgan Stanley in the 2008 financial crisis using Bloomberg Terminal. First, an analysis is carried out to future market expectations on the strengths of two different currencies, namely the US Dollar and Singapore Dollar. Second, to determine the price of a European Plain Vanilla Option for a company in this case Intel Corporation. The third analysis is done to construct an appropriate strategy in Option Trading. Fourth, explaining the volatility of the strength between the US Dollar and Mexican Peso during the 2016 United States Presidential Election Campaign in which Donald Trump made controversial policies towards Mexico. The final analysis is measuring market volatility on Morgan Stanley during the 2008 financial crisis.