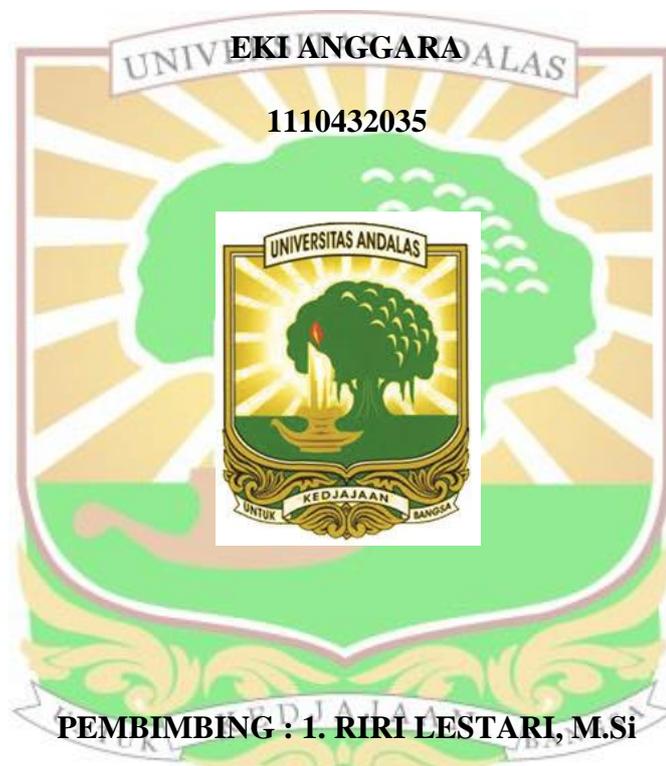


**PERHITUNGAN HARGA OPSI CALL POWER ASIA
DENGAN PAYOFF NONLINIER
PADA SAHAM INTEL CORPORATION**

SKRIPSI SARJANA MATEMATIKA

OLEH :



2. Dr. AHMAD IQBAL BAQI

**JURUSAN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS ANDALAS
PADANG**

2017

ABSTRAK

Abstrak. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui cara menentukan harga dari suatu opsi *call power* asia dengan *payoff* nonlinier. Dalam penelitian ini, data yang digunakan adalah data sekunder pada perusahaan Intel Corporation. Hasil yang diperoleh dapat disimpulkan bahwa opsi *call power* asia dengan *payoff* nonlinier dipengaruhi oleh beberapa faktor antara lain harga saham awal periode, waktu jatuh tempo, harga pelaksanaan, tingkat suku bunga bebas resiko, volatilitas dan parameter *power* α .

Kata kunci: Opsi *Call* Asia, Opsi *Call power* Asia, Model *Black-Scholes*. *Payoff Nonlinier*

