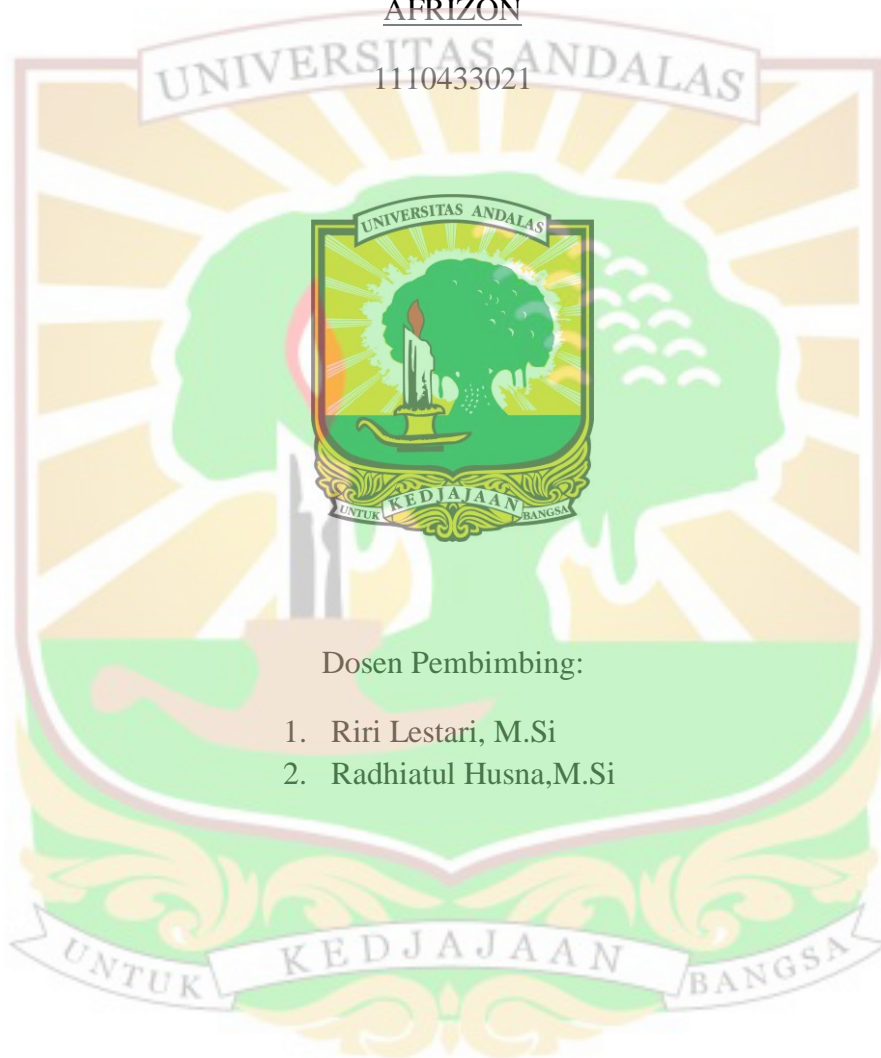


KEKONVERGENAN MODEL BINOMIAL HARGA OPSI
CALL TIPE EROPA

OLEH:

AFRIZON

1110433021



Dosen Pembimbing:

1. Riri Lestari, M.Si
2. Radhiatul Husna, M.Si

FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM

UNIVERSITAS ANDALAS

PADANG

2016



KEKONVERGENAN MODEL BINOMIAL HARGA OPSI CALL TIPE EROPA

Afrizon, Radhiatul Husna

ABSTRAK

Opsi call tipe Eropa merupakan kontrak yang memberikan hak bukan kewajiban kepada pemilik atau pemegangnya untuk membeli sejumlah saham tertentu, pada waktu atau tanggal jatuh tempo tertentu. Model Black-Scholes untuk harga opsi call tipe Eropa merupakan solusi analitik dan model binomial merupakan solusi numerik untuk harga opsi tersebut. Penelitian ini bertujuan untuk mengkaji kekonvergenan dari model Black - Scholes secara matematis. Pada tulisan ini diperoleh bahwa model binomial untuk harga opsi call tipe Eropa konvergen ke model Black – Scholes.

Kata kunci: Opsi call tipe Eropa, Model Black-Scholes, Model Binomial

