

Menentukan nilai implied volatility opsi Eropa dengan menggunakan metode bisection dan metode newton-raphson

Siti Chadijah, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20180886&lokasi=lokal>

Abstrak

Dalam dunia investasi dikenal sekuritas derivatif, yaitu alat keuangan yang nilainya bergantung pada alat keuangan lain yang tercantum di dalamnya. Salah satu contoh sekuritas derivatif adalah opsi call Eropa. Untuk menghitung nilai opsi call Eropa digunakan formula Black-Scholes. Semua parameter dalam formula Black-Scholes, yaitu harga aset dasar saat ini, suku bunga bebas resiko, harga patokan, dan waktu jatuh tempo dapat diketahui secara langsung, kecuali volatilitas. Dalam skripsi ini akan dibahas bagaimana mengestimasi volatilitas dengan menggunakan implied volatility, yaitu nilai volatilitas yang di dapat dengan menggunakan bantuan nilai opsi yang didapat dari pasar. Estimasi implied volatility dengan metode numerik, yaitu metode Bisection dan metode Newton-Raphson.