

Implementasi metode projected sor dalam mengaproksimasi harga PUT Amerika

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20180960&lokasi=lokal>

Abstrak

Penggunaan sekuritas derivatif sebagai investasi di pasar modal telah meningkat pesat dalam beberapa tahun terakhir. salah satu contoh sekuritas derivatif adalah opsi. Karena adanya kendala eksekusi awal, solusi analitik untuk perhitungan harga opsi put Amerika sulit untuk ...