

BAB V

KESIMPULAN DAN SARAN

5.1 Kesimpulan

1. Perhitungan harga Opsi Beli Asia dengan menggunakan metode Trinomial dilakukan dengan cara menghitung nilai-nilai parameter terlebih dahulu yaitu, u , d , P_u dan P_d , setelah itu akan diperoleh perkiraan harga saham, harga saham rata-rata dan *payoff*, kemudian harga Opsi Beli Asia.
2. Konstruksi program perhitungan harga Opsi Beli Asia dilakukan dengan menggunakan Matlab R2015a. Tahap pertama dari konstruksi program tersebut adalah merancang program mulai dari data masukan, data keluaran, serta algoritma program.
3. Berdasarkan
4. Dalam penelitian ini, dengan data masukan harga saham awal adalah sebesar 2570, volatilitas sebesar 0,0116, suku bunga 0,06, dan partisi selang waktu adalah 92 hari, maka didapat hasil perhitungan harga Opsi Beli Asia sebesar 84,7356 (rupiah).

5.2 Saran

1. Dalam penelitian ini, partisi selang waktu yang digunakan adalah perhari. Untuk penelitian selanjutnya dapat dipartisi ke selang waktu yang lebih kecil lagi, seperti per jam atau per detik agar hasil perhitungan lebih akurat.
2. Penelitian selanjutnya dapat ditambahkan pengaruh dividen dalam perhitungan harga opsi, serta menggunakan metode lain.