

ABSTRAK

Tugas akhir ini menentukan nilai opsi beli Vanilla tipe Eropa yang bergantung pada multi aset (dua aset). Nilai opsi dihitung dengan menggunakan metode *Lattice Multinomial* (Trinomial), modifikasi dari metode binomial karena terdapat tiga kemungkinan pergerakan harga saham yaitu pergerakan harga saham naik, harga saham turun dan harga saham tetap (nilainya tidak berubah).

Hasil yang diperoleh berupa nilai opsi beli tipe Eropa dalam suatu waktu jatuh tempo dan analisis pada sensitivitas terhadap variabel-variabel yang mempengaruhi harga opsi saham, contohnya harga kesepakatan dan suku bunga. Dari hasil yang didapatkan, nilai opsi pada waktu jatuh tempo enam hari adalah 11, 04514 dan semakin besar harga kesepakatannya maka nilai opsi semakin kecil dan semakin besar nilai suku bunga, maka nilai opsi akan semakin kecil.

Kata Kunci: *Opsi Vanilla Tipe Eropa, Opsi Beli, Multi Aset, Metode Lattice, Lattice Multinomial*