

ABSTRAK

Opsi Tipe Eropa (*European Option*), adalah opsi yang dapat dilaksanakan hanya pada saat jatuh tempo. Berdasarkan jenis hak yang diberikan kepada pemegangnya, opsi dibedakan menjadi dua, yaitu: Opsi *Call* dan Opsi *Put*. Harga opsi merupakan harga yang harus dibayarkan oleh pemegang opsi (*holder*) ke penjual opsi (*writer*) untuk memperoleh hak opsi tersebut. Ada beberapa metode yang dapat digunakan untuk menentukan harga opsi, diantaranya dengan metode *Black Scholes*. Selain model *Black Scholes*, menentukan harga opsi juga dapat dilakukan menggunakan simulasi *Quasi Monte Carlo*. Pada penelitian ini akan dibahas tentang penggunaan metode *Quasi Monte Carlo* dengan menggunakan salah satu barisan *quasi* acak yaitu *Halton*. Barisan *quasi* acak *Halton* dipilih karena barisan ini merupakan barisan *low discrepancy* (pembeda lemah) paling dasar yang berbentuk *multiple dimensions* (berdimensi banyak), sehingga dengan banyaknya dimensi yang diberikan untuk menentukan harga opsi akan menyebabkan nilai *error* semakin kecil dan kekonvergenan harga opsi tersebut akan semakin cepat.

Kata Kunci: Opsi Tipe Eropa, Opsi *Call*, Opsi *Put*, *Holder*, *Writer*, Model *Black-Scholes*, Simulasi *Quasi Monte Carlo*, Barisan *Quasi* Acak *Halton*, *Low discrepancy*, *Multiple dimensions*, *Error*, Kekonvergenan.

