

RINGKASAN

Penelitian ini bertujuan untuk menganalisa keefektifan dan keefisienan metode Monte Carlo dengan teknik reduksi variansi dalam menentukan harga opsi Asia tipe rata-rata aritmatika. Metode Monte Carlo dengan teknik reduksi variansi sendiri terbagi atas dua metode yaitu metode peubah kontrol dan peubah antitetik. Untuk metode peubah kontrol digunakan 2 bentuk peubah kontrol yaitu opsi Eropa dan opsi Asia tipe rata-rata geometrika. Dari hasil penelitian diperoleh bahwa dari kedua metode tersebut, yang lebih efektif dan efisien dalam menaksir harga opsi Asia tipe rata-rata aritmatika adalah metode peubah kontrol dengan peubah kontrol berupa opsi Asia tipe rata-rata geometrika.

Kata Kunci:

Opsi Asia, Metode Monte Carlo, Reduksi Variansi, Peubah Kontrol, Peubah Antitetik