Abstrak

Opsi saham dalam pasar modal merupakan salah satu alat yang bisa digunakan untuk investasi yang lebih aman atau mengurangi risiko saham yang dimiliki investor. Opsi terbagi menjadi dua bagian yaitu opsi beli(*Call Option)* dan opsi jual(*Put Option).* Pada tugas akhir ini penulis menggunakan opsi beli tipe eropa(Europan Call) untuk menentukan nilai opsi dengan menggunakan metode Black-Scholes skema implisit. Simulasi dilakukan pada harga saham Bank Central Asia dan Unilever Indonesia Tbk, dengan nilai volatilitas Bank Central Asia sebesar 0.2089441184 dan Unilever indonesia 0.2121776304. Dengan metode beda hingga implisit diperoleh nilai opsi saham Unilever Indonesia sebesar 5300 dan Bank Central Asia 1795.

Keywords: Opsi,Opsi beli, Black-Scholes, Persamaan beda hingga.