

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN.....	i
LEMBAR PERNYATAAN	ii
ABSTRAK	iii
<i>ABSTRACT</i>	iv
KATA PENGANTAR	Error! Bookmark not defined.
LEMBAR PERSEMBAHAN.....	vi
DAFTAR TABEL	Error! Bookmark not defined.
DAFTAR GAMBAR.....	Error! Bookmark not defined.
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah.....	2
1.3 Tujuan	2
1.4 Batasan Masalah.....	3
1.5 Metodologi Penyelesaian	3
1.6 Sistematika Penulisan	4
BAB II TINJAUAN PUSTAKA	5
2.1 Opsi	5
2.2 Opsi Asia.....	7
2.3 Gerak Brownian dan Saham Lognormal.....	8
2.4 Opsi <i>Path-dependent</i>	10
2.5 Simulasi <i>Monte Carlo</i>	12
2.6 Teorema Limit Pusat dan Selang Kepercayaan.....	14
BAB III PERANCANGAN SISTEM.....	17
3.1 Model Pemecahan Masalah.....	17
3.1.1 Data.....	18

3.1.2	Penentuan Parameter	18
3.1.3	Simulasi <i>Monte Carlo</i>	19
3.1.4	Penentuan Harga Opsi.....	20
BAB IV ANALISIS DAN HASIL PENGUJIAN		21
4.1	Tujuan Simulasi.....	21
4.2	Implementasi Simulasi <i>Monte Carlo</i> pada Opsi Asia	21
4.3	Skenario Pengujian	24
4.4	Analisis Hasil	24
4.4.1	Pengaruh Banyaknya <i>Timestep</i> dan Simulasi <i>Monte Carlo</i> Terhadap Nilai Hampiran dan Selang Kepercayaan	24
4.4.2	Pengaruh Banyaknya <i>Timestep</i> dan Simulasi <i>Monte Carlo</i> Terhadap Standar Deviasi.....	25
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....		27
5.1	Kesimpulan.....	27
5.2	Saran	27
DAFTAR PUSTAKA		
LAMPIRAN		