

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	Error! Bookmark not defined.
LEMBAR PERNYATAAN.....	Error! Bookmark not defined.
ABSTRAK.....	iv
ABSTRACT.....	v
LEMBAR PERSEMBAHAN	vError! Bookmark not defined.
KATA PENGANTAR	vError! Bookmark not defined.i
DAFTAR ISI.....	vError! Bookmark not defined.
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR TABEL.....	xi
BAB 1 PENDAHULUAN	Error! Bookmark not defined.
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	2
1.3 Tujuan.....	2
1.4 Batasan Masalah.....	3
1.5 Hipotesis.....	3
1.6 Metodologi Penelitian	3
1.7 Sistematika Penulisan.....	4
BAB 2 LANDASAN TEORI.....	5
2.1 Opsi	5
2.2 Opsi Amerika	6
2.2.1. Opsi beli (<i>call</i>) Amerika.....	6
2.2.2. Opsi jual (<i>put</i>) Amerika.....	8
2.3 Model <i>Black-Scholes</i>	9
2.4 Batas Exercise	11
2.5 Modifikasi Model <i>Black-Scholes</i> untuk Opsi Amerika.....	12
2.6 Metode numerik dengan pendekatan metode eksplisit	12
2.7 Penyelesaian Opsi Amerika dengan algoritma PSOR.....	14
BAB 3 ANALISIS PENYELESAIAN MASALAH	17

3.1 Deskripsi Penyelesaian Permasalahan	17
3.2 Pengumpulan Data	17
3.3. Alur Penyelesaian.....	17
3.3.1 Penentuan Parameter.....	18
3.3.2 Identifikasi Model untuk perhitungan opsi Amerika.....	18
3.3.3 Perancangan skema numerik dengan pendekatan metode beda hingga secara eksplisit.....	18
3.3.4 Penentuan harga opsi Amerika menggunakan algoritma <i>Projected Successive Over Relaxation</i> (PSOR).....	19
3.3.5 Solusi harga opsi Amerika.....	19
3.3.6 Validasi	19
3.3.7 Analisis	19
BAB 4 IMPLEMENTASI DAN ANALISIS.....	20
4.1 Implementasi pendekatan metode beda hingga secara eksplisit	20
4.2 Analisis Batas <i>Exercise</i> opsi jual Amerika	22
4.3 Sensitivitas terhadap nilai opsi.....	23
BAB 5 KESIMPULAN DAN SARAN	27
5.1 Kesimpulan.....	27
5.2 Saran.....	27
DAFTAR PUSTAKA	27
LAMPIRAN.....	28