

DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN	i
LEMBAR PERNYATAAN.....	i
ABSTRAK.....	iii
<i>ABSTRACT</i>	iv
LEMBAR PERSEMBAHAN	v
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR GAMBAR.....	ix
DAFTAR ISTILAH.....	x
BAB I	
PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Rumusan Masalah	2
1.3 Batasan Masalah.....	2
1.4 Tujuan.....	2
1.5 Metodologi Penyelesaian Masalah.....	2
1.6 Sistematika Penulisan.....	3
BAB II	
LANDASAN TEORI.....	5
2.1 Opsi	5
2.1.1 <i>Call Option</i>	5
2.1.2 <i>Put Option</i>	6
2.2 Opsi <i>Barrier</i>	7
2.3 Model Black-Scholes.....	8
2.3.1 Model Black-Scholes Untuk Penentuan Harga Opsi <i>Vanilla</i>	8
2.3.2 Model Black-Scholes Untuk Penentuan Harga Opsi <i>Barrier</i>	9
2.4 Metode Binomial Standar	10
2.4.1 Penentuan Nilai Parameter u , d , dan p	12
2.5 Metode <i>Averaging Binomial</i>	13
BAB III	
RANCANGAN SISTEM.....	16
3.1 Diagram Penentuan Harga Opsi <i>Barrier</i> dengan metode <i>Averaging Binomial</i>	16
BAB IV	
HASIL DAN IMPLEMENTASI	20

4.1	Implementasi Data.....	20
4.1.1	Simulasi 6 Data dan Kekonvergenan Metode <i>Averaging Binomial</i> Terhadap Model Black-Scholes.....	20
4.1.2	Simulasi 50 Data Saham dan Kekonvergenan Metode <i>Averaging Binomial</i> Terhadap Model Black-Scholes.....	27
4.2	Hasil Perhitungan Kompleksitas Waktu Algoritma	37
BAB V		
KESIMPULAN DAN SARAN		38
5.1	Kesimpulan.....	38
5.2	Saran.....	38
DAFTAR PUSTAKA		40
LAMPIRAN A: PERHITUNGAN KOMPLEKSITAS WAKTU ALGORITMA		41
LAMPIRAN B: PROGRAM MATLAB		48