

DAFTAR ISI

SKRIPSI.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
INTISARI.....	xii
ABSTRACT.....	xiii
BAB 1 PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang Masalah	1
1.2 Batasan Masalah	3
1.3 Tujuan Penelitian	3
1.4 Tinjauan Pustaka.....	3
1.5 Metode Penelitian	4
1.6 Sistematika Penulisan	4
BAB II LANDASAN TEORI	6
2.1. Teori Bunga	6
2.2. Nilai Mata Uang.....	7
2.2.1 Nilai Masa Depan (<i>Future Value</i>).....	7
2.2.2 Nilai Sekarang (<i>Present Value</i>).....	8
2.3. Obligasi.....	8
2.3.1 Definisi Obligasi	8
2.3.2 Jenis-Jenis Obligasi.....	8
2.3.3 Karakteristik Obligasi	10
2.3.4 Harga Pasar Obligasi.....	10
2.3.5 Risiko dan Keuntungan Obligasi	11
2.3.6 Yield Obligasi	13
2.3.7 Rating Obligasi	14
2.4. Pemajemukan Kontinu.....	15
2.5. Variabel Random	15
2.6. Suku Bunga Nominal.....	18
2.7. Volatilitas.....	18
2.8. Ekspektasi dan Variansi.....	19
2.9. Distribusi Binomial.....	22
2.10. Distribusi Normal	23

2.11.	Distribusi Log-normal.....	25
2.12.	Proses Stokastik	27
2.13.	Gerak Brown.....	29
2.14.	Persamaan Differensial Stokastik	31
2.15.	Lemma Ito.....	32
2.16.	Bisection Metode	34
2.17.	Deret Taylor.....	35
BAB III OBLIGASI CALLABLE DENGAN SUKU BUNGA BLACK		
DERMAN TOY MENGGUNAKAN POHON TRINOMIAL		
3.1.	Obligasi Callable.....	38
3.2.	Pemodelan Suku Bunga	40
3.3.	Pohon Trinomial	42
3.4.	Suku Bunga Black Derman Toy	44
3.4.1	Penurunan Suku Black Derman Toy.....	45
3.4.2	Pohon Trinomial untuk Suku Bunga Black Derman Toy	51
3.5.	Pemodelan Harga Obligasi Callable Menggunakan Pohon Trinomial	52
BAB IV STUDI KASUS		
4.1.	Deskripsi Data.....	60
4.2.	Metode Penelitian	61
4.3.	Penentuan Harga Obligasi <i>Callable</i>	62
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....		
5.1.	Kesimpulan	68
5.2.	Saran	69
DAFTAR PUSTAKA		
LAMPIRAN.....		
		72