



DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN.....	iii
HALAMAN PERSEMBAHAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL.....	ix
DAFTAR GAMBAR	x
DAFTAR LAMPIRAN.....	xi
INTISARI.....	xii
ABSTRACT.....	xiii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Tujuan Penelitian.....	4
1.4 Metodologi Penelitian	4
1.5 Tinjauan Pustaka	4
1.6 Sistematika Penulisan.....	6
BAB II LANDASAN TEORI.....	8
2.1 Opsi	8
2.1.1 Pengertian dan Jenis-jenis Opsi	8
2.1.2 Nilai Intrinsik	10
2.1.3 Nilai Waktu	11
2.1.4 Hedging.....	11
2.1.5 Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Harga Opsi	13
2.1.6 Manfaat Transaksi Opi.....	13
2.2 Variabel Random.....	14
2.3 Distribusi Normal	15
2.4 Distribusi Normal Standar.....	19
2.5 Proses Stokastik.....	20
2.6 Gerak Brown	21
2.7 Lemma Ito	23
2.8 Proses Harga Saham	25
2.9 Volatilitas	26
2.10 Return dalam Investasi	27
2.11 Transformasi <i>Fourier</i>	28
2.12 Transformasi <i>Fast-Fourier</i>	29
2.13 Aturan Trapezoid.....	29
2.14 Metode Simpson.....	29
2.15 Evaluasi Harga Opsi	30
BAB III PEMBAHASAN	31
3.1 Model <i>Black-Scholes</i>	31
3.2 Model <i>Fast Fourier Transform</i>	36
3.3 Transformasi Fast Fourier dengan Normal Inverse Gaussian.....	39



BAB IV STUDI KASUS	41
4.1 Data	41
4.2 Volatilitas	43
4.3 Tingkat Suku Bunga Bebas Risiko.....	43
4.4 Perbandingan Model Harga Opsi Beli Tipe Eropa.....	44
4.5 Pertimbangan Membeli atau Menjual Opsi Beli Tipe Eropa	48
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN.....	49
5.1 Kesimpulan.....	49
5.2 Saran	50
DAFTAR PUSTAKA	51