



DAFTAR ISI

SKRIPSI.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN.....	iii
PERSEMBAHAN.....	iv
KATA PENGANTAR.....	v
DAFTAR ISI.....	vii
DAFTAR TABEL DAN GAMBAR.....	ix
INTISARI.....	x
ABSTRACT.....	xi
BAB I PENDAHULUAN.....	1
1.1 Latar Belakang.....	1
1.2 Tujuan Penelitian.....	3
1.3 Batasan Masalah	4
1.4 MetodologiPenulisan.....	4
1.5 Tinjauan Pustaka	4
1.6 Sistematika Penulisan.....	5
BAB II LANDASAN TEORI.....	6
2.1 Opsi.....	6
2.2 Distribusi Lognormal.....	11
2.3 Proses Stokastik.....	15
2.4 Proses Wiener.....	15
2.5 Model Harga Saham.....	17
2.6 Lemma Ito.....	18
2.7 Proses Harga Saham.....	20
2.8 Estimasi Volatilitas.....	22
2.9 Normalitas kolmogorov-smirnov.....	23



BAB III PENENTUAN HARGA OPSI <i>COMPLEX CHOOSER</i> DENGAN MODEL BLACK-SCHOLES	24
3.1 <i>Chooser Option</i>	24
3.2 <i>Complex Chooser Option</i>	26
3.3 Model Black-Scholes.....	28
3.4 Penentuan Nilai <i>Complex Chooser Option</i>	29
BAB IV STUDI KASUS	41
4.1 Data.....	41
4.2 Uji Normalitas.....	42
4.3 Volatilitas Data.....	43
4.4 Tingkat Bunga Bebas Resiko.....	44
4.5 Penentuan Harga Opsi.....	44
4.6 Menentukan Nilai Opsi <i>Complex Chooser</i> PT Astra Internasional Tbk..	45
4.7 Pengambilan Keputusan.....	47
4.8 Keuntungan dan Kerugian.....	49
BAB V KESIMPULAN DAN SARAN	50
5.1 Kesimpulan.....	50
5.2 Saran.....	51
DAFTAR PUSTAKA	52
LAMPIRAN	53



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

PENENTUAN HARGA OPSI COMPLEX CHOOSER DENGAN MODEL BLACK-SCHOLES
NOVALIA P SINAGA , Prof.Dr.rer.nat Dedi Rosadi,. S.Si.M.sc
Universitas Gadjah Mada, 2016 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

DAFTAR GAMBAR DAN TABEL

Gambar 4.1 Harga penutupan Saham PT Astra Internasional Tbk.....	42
Gambar 4.2 Plot Probabilitas Normal	43
Tabel 4.1 Perhitungan <i>Complex Chooser Option</i>	45