DAFTAR ISI

LEMBAR PENGESAHAN …….…….. i

LEMBAR PERNYATAAN ……... ii

ABSTRAK ….……... iii

ABSTRACT ….……. iv

LEMBAR PERSEMBAHAN ….……... v

KATA PENGANTAR …….……...….. vii

DAFTAR ISI …… viii

DAFTAR GAMBAR ……..... x

DAFTAR TABEL …….... xi

1. PENDAHULUAN …….…...… 1
   1.1 Latar Belakang ……..…… 1
   1.2 Rumusan Masalah …...…….…… 2
   1.3 Tujuan ……..... 2
   1.4 Batasan Masalah ...…… 2
   1.5 Metodologi Penyelesaian ...…….. 2
   1.6 Sistematika Penulisan ….…….. 3

2. TINJAUAN PUSTAKA ……... 5
   2.1 Swap …….. 5
   2.1.1 Interest Rate Swap ..……... 6
   2.2 Options ……....……... 6
   2.3 Swaptions ……...…… 7
   2.4 Data LIBOR ……..…….. 9
   2.5 Pengolahan Data ……...……. 9
   2.6 Manajemen Resiko dari Swaptions …….. 11
   2.6.1 Model Hull-White…….. 12
   2.7 Metode Monte Carlo ……..... 13

3. PERANCANGAN SISTEM ……. 16
   3.1 Deskripsi Penyelesaian Masalah ……...…… 16
   3.2 Data LIBOR …….. 17
   3.2.1 Alur Penyelesaian ……...…….. 18

4. PEMBAHASAN ……...…… 19
   4.1 Implementasi Pemodelan …….……...……..... 19
   4.2 Pemodelan ……..…….……...…….……..... 19

4.2.1 Strategi Pengujian Sistem…….… 19
4.2.2 Kasus yang digunakan…….……...……..... 20
4.3 Hasil dan Analisis……....…….……...……..... 23
4.3.1 Analisis Hasil Skenario Pengujian…..……...……..... 23

5. KESIMPULAN ……..... 25
5.1 Kesimpulan ……...…… 25
5.2 Saran …….. 25

DAFTAR PUSTAKA ……....…….. 26