

Daftar Isi

Abstrak	i
Abstract	ii
Lembar Persembahan	iii
Kata Pengantar	v
Daftar Isi	vi
Daftar Gambar	viii
Daftar Tabel	ix
I Pendahuluan	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah	2
1.3 Tujuan	2
1.4 Rencana Kegiatan	3
II Kajian Pustaka	4
2.1 Opsi	4
2.1.1 Opsi Call	4
2.1.2 Opsi Put	4
2.1.3 Opsi Tipe Eropa	4
2.2 Volatilitas	5
2.3 Persamaan Black-Scholes	6
2.4 Metode Beda Hingga	7
2.4.1 Diskretisasi	7
2.4.2 Aproksimasi	8
III Metodologi dan Desain Sistem	9
3.1 Flowchart Sistem	9
3.2 Algoritma	11

IV Hasil Analisis dan Pembahasan	13
4.1 Metode Beda Hingga Skema Eksplisit	13
4.2 Volatilitas	15
4.2.1 Volatilitas Saham PT HM Sampoerna	15
4.2.2 Volatilitas Saham PT Metropolitan Kentjana	16
4.3 Implementasi	16
4.3.1 Hasil Implementasi Saham PT HM Sampoerna	17
4.3.2 Hasil Implementasi Saham PT Metropolitan kentjana	20
4.3.3 Pengaruh Nilai Suku Bunga Terhadap Nilai Opsi Put	23
4.3.4 Pengaruh Perubahan Harga Kesepakatan Terhadap Nilai Opsi Put	24
V Kesimpulan dan Saran	26
5.1 Kesimpulan	26
5.2 Saran	27
Daftar Pustaka	28