

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