

Daftar Isi

Lembar Pengesahan	i
Abstrak	ii
<i>Abstract</i>	iii
Kata Pengantar	iv
Ucapan Terima Kasih.....	v
Daftar Isi	viii
Daftar Gambar.....	x
Daftar Tabel	xi
Daftar Lampiran.....	xii
Bab 1	1
Pendahuluan.....	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Pembatasan Masalah	2
1.3 Perumusan Masalah.....	2
1.4 Tujuan.....	3
1.5 Metodologi Penyelesaian Masalah.....	3
1.6 Sistematika Penulisan.....	3
Bab 2	5
Dasar Teori.....	5
2.1 Pasar Modal.....	5
2.1.1 Pengertian Pasar Modal	5
2.1.2 Instrumen Pasar Modal	5
2.2 Obligasi	6
2.2.1 Pengertian Obligasi	6
2.2.2 Jenis- jenis Obligasi	6
2.2.3 Karakteristik Obligasi	7
2.3 Proses Stokastik.....	7
2.3.1 Proses Markov	7
2.3.2 Proses Stokastik dengan Waktu Kontinu	7
2.3.3 Proses Wiener	8
2.4 Model Jangka Pendek.....	8
2.5 Lemma Ito	8
2.6 Model Vasicek.....	9

2.7	Selang Kepercayaan	11
2.8	Monte Carlo.....	11
2.9	<i>Least Square</i>	12
2.10	Formula <i>Zero Coupon Bond</i> dengan Model Vasicek.....	12
Bab 3	15
Rancangan Sistem	15
3.1	Deskripsi sistem	15
3.2	Sistem penelitian	15
3.3	Deskripsi sistem penelitian.....	16
3.3.1	Input Data.....	16
3.3.2	Hitung Parameter b dan σ	16
3.3.3	Pilih Nilai Parameter a Optimum	16
3.3.4	Simulasi prediksi suku bunga dengan model Vasicek.....	18
3.3.5	Analisis hasil simulasi prediksi suku bunga	18
3.3.6	Hitung selang kepercayaan	18
3.3.7	Simulasi harga obligasi	18
Bab 4	19
Hasil Analisis	19
4.1	Pengujian sistem.....	19
4.1.1	Tujuan pengujian sistem	19
4.1.2	Tahapan.....	19
4.2	Hasil dan Analisis.....	21
4.2.1	Tahap 1: Hitung parameter b dan σ	21
4.2.2	Tahap 2: Memperoleh nilai parameter a optimum.....	22
4.2.3	Tahap 3: Simulasi prediksi suku bunga menggunakan model Vasicek	25
4.2.4	Tahap 4: Menganalisis hasil simulasi prediksi suku bunga	32
4.2.5	Tahap 5: Simulasi prediksi harga obligasi	34
BAB 5	36
Kesimpulan dan Saran	36
5.1	Kesimpulan.....	36
5.2	Saran.....	36
DAFTAR PUSTAKA	x