

DAFTAR ISI

HALAMAN SAMPUL	i
HALAMAN JUDUL.....	ii
ABSTRAK	iii
<i>ABSTRACT</i>	iv
HALAMAN PERSETUJUAN.....	v
HALAMAN PENGESAHAN I	vi
HALAMAN PENGESAHAN II	vii
PEDOMAN PENGGUNAAN TESIS.....	viii
HALAMAN PERUNTUKAN	ix
KATA PENGANTAR.....	x
DAFTAR ISI.....	xii
DAFTAR LAMPIRAN	xv
DAFTAR GAMBAR	xvi
DAFTAR TABEL.....	xvii
DAFTAR SINGKATAN DAN LAMBANG.....	xviii
BAB I Pendahuluan.....	1
I.1 Latar Belakang	1
I.2 Rumusan Masalah.....	4
I.3 Tujuan Penelitian	4
I.4 Pembatasan Masalah.....	4
I.5 Manfaat Penelitian	5
BAB II Tinjauan Pustaka	6
II.1 Penelitian Terdahulu	6
II.2 Opsi.....	9
II.3 Model Black Scholes	11
II.3.1 Lemma Ito.....	11
II.3.2 Logaritma <i>Return</i>	14
II.3.3 Fungsi Distribusi Normal.....	14
II.3.4 Ekspektasi dan Variansi.....	14
II.3.5 Gerak Brown.....	15

II.3.6 Persamaan Black Scholes Merton (BSM)	16
II.3.7 Volatilitas	17
II.4 Fungsi Aktivasi	19
II.5 <i>Recurrent Neural Network</i> (RNN).....	20
II.6 <i>Long Short Term Memory</i> (LSTM).....	23
II.6.1 <i>Forget Gate</i> (Gerbang Lupa)	24
II.6.2 <i>Input Gate</i> (Gerbang Masukkan)	25
II.6.3 <i>Output Gate</i> (Gerbang Keluaran)	26
II.7 <i>Adaptive Moment Estimation</i> (ADAM).....	27
BAB III Metode Penelitian	30
III.1 Prosedur Penelitian	30
III.2 Sumber Data.....	31
III.3 Langkah – langkah Penelitian.....	32
BAB IV Hasil dan Pembahasan	40
IV.1 Dataset penelitian untuk Model Black Scholes Merton.....	40
IV.2 Menentukan nilai parameter – parameter model Black Scholes Merton	41
IV.2.1 Memprediksi volatilitas harga saham pada perusahaan AFI.....	46
IV.2.2 Menentukan parameter waktu pada saham perusahaan AFI	65
IV.2.3 Menentukan parameter <i>strike price</i> pada saham perusahaan AFI.	65
IV.2.4 Menentukan parameter suku bunga bebas risiko pada saham perusahaan AFI	66
IV.2.5 Melakukan prediksi harga opsi model Black Scholes Merton pada perusahaan AFI	66
IV.2.6 Memprediksi volatilitas harga saham pada perusahaan MSFT	70
IV.2.7 Menentukan parameter waktu pada saham perusahaan MSFT	76
IV.2.8 Menentukan parameter <i>strike price</i> pada saham perusahaan MSFT	77
IV.2.9 Menentukan parameter suku bunga bebas risiko pada saham perusahaan MSFT	78
IV.2.10 Melakukan prediksi harga opsi model Black Scholes Merton pada perusahaan MSFT	78
BAB V Kesimpulan	87

V.1 Kesimpulan	87
DAFTAR PUSTAKA	88
LAMPIRAN	96