

analisa perbandingan kontrak forward dan option untuk hedging tender dan penerapan model arema untuk peramalan kurs forward sebagai pendukung pengambilan keputusan kontrak forward atau option

Mario Kresnadi, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=20184004&lokasi=lokal>

Abstrak

Dalam suatu transaksi ekspor. Eksportir dihadapkan suatu resiko. Terutama jika menyangkut penerimaan pembayaran dalam mata uang asing. Resiko tersebut bertambah besar apabila transaksi bersifat tender, dimana kontrak kerja belum pasti dan karenanya penerimaan juga belum pasti. Tujuan skripsi ini adalah untuk menentukan metode hedging apa yang paling cocok untuk mengatasi resiko perubahan kurs valuta asing. Sesuai contoh kasus yang dipakai, terdapat dua metode hedging yang dapat dipergunakan, yaitu kontrak Forward dan kontrak Option. Maka kemudian fokus skripsi ini adalah membandingkan hasil penggunaan kedua kontrak tersebut. Perangkat manajemen yang dipakai adalah Hodel ARIHA. Hodel ARIHA ini digunakan untuk meramal pergerakan kurs forward. Hasil menunjukkan peramalan dengan menggunakan data bahwa kurs forward DHK akan meningkat. historis Dengan hasil. tepat dasar tersebut dilakukan perhitungan dan perbandingan Kemudian disimpulkan bahwa metode hedging yang paling untuk contoh kasus yang digunakan adalah kontrak Forward.