Universitas Indonesia Library >> UI - Tesis Membership

Penilaian, aplikasi dan analisa strategi currency option sebagai alternatif instrumen lindung nilai bagi eksposure valuta asing perusahaan

Martalena, author

Deskripsi Lengkap: https://lib.ui.ac.id/detail?id=20448239&lokasi=lokal

---

Abstrak

ABSTRAK

Karya akhir ini membahas penilaian, aplikasi, dan evaluasi efektivitas dari penggunaan berbagai strategi currency option untuk melindungi eksposure valuta asing (dibatasi hanya eksposure US Dollar terhadap Rupiah) perusahaan di Indonesia. Penilaian currency option dilakukan dengan menggunakan aplikasi formula Black-Scholes untuk currency option dan dibagi dalam 3 periode @1 bulan, yaitu periode Oktober 1998, November 1998, dan Desember 1998.