Universitas Indonesia Library >> UI - Tesis Membership

Simulasi model peramalan perubahan kurs valuta asing di masa mendatang

Simangunsong, Eliot, author

Deskripsi Lengkap: https://lib.ui.ac.id/detail?id=20471173&lokasi=lokal

---

Abstrak

RINGKASAN EKSEKUTIF
Uang adalah salah satu dari penemuan manusia yang sangat penting yang membentuk suatu sistem ekonomi modem yang kompleks. Untuk memudahkan transaksi menggunakan uang, diadakanlah sistem standard. Pertama sekali ialah standard emas yang merupakan sistem moneter intemasional dimana nilai dari suatu mata uang ditentukan dengan sejumlah tertentu emas. Masa penggunaan sistem ini sejak tahun 1870-an hingga pecah perang dunia I tahun 1914. Sistem standard emas terhenti selama perang dunia I, dan membentuk standard barn yang disebut gold exchange standard. Mulai tahun 1946, sesuai dengan persetujuan Bretton Woods, setiap negara berikrar untuk mempertahankan nilai tukar mata uangnya tetap (fixed) ibandingkan nilai dollar a tau emas. Pada oulan Desember 1971, dengan perjanjian Smithsonian, dunia secara perlahan lahan bergerak ke arahfree exchange rate dan resmi menggunakan sistem nilai tukar mengambang pada tahun 1973.

Sejak saat itu gejolak perubahan kurs valuta asing berkembang secara fluktuatif sehingga menyebabkan timbulnya resiko valuta dan menyebabkao variasi pada keuntungan operasi perusahaan. Jenis resiko tersebut ialah resiko perubahan kurs (berubahnya nilai aset, liabilitas, revenue, dan ongkos pengeluaran perusahaan jika dinilai dari nilai mata uang asing) serta resiko politik seperti pembatasan ekspor/impor, pengawasan pemerintah terhadap pergerakan aset dan kontrol kapital.

Setiap kegiatan bisnis pada masa kini yang melibatkan transaksi intemasional tentulah menghadapi resiko kurs dalam transaksinya. Kenyataan ini mengakibatkan semakin banyak perusahaan yang memperhatikan pengaruh dari perubahan nilai tukar uang yang dapat terjadi setiap saat dan seringkali mempengaruhi kineija perusahaan balk dalam keunggulan kompetisi ataupun dalam penerimaan keuntungan perusahaan.

Salah satu cara untuk membantu kesulitan tersebut adalah dengan menggunakan komputer sebagai alat bantu untuk memprediksi perubahan nilai tukar uang di masa depan. Pada komputer dijalankan program simulasi khusus sehingga hasil aplikasi program yang diperoleh dapat dipergunakan sebagai alat bantu yang cepat, akurat, dan efisien dalam memberikan informasi yang dibutuhkan.

Program simulasi yang didesain pada karya akhir ini menggunakan parameter-parameter ekonomi fundamental, Karena itu hanya cocok untuk pendugaan yang bersifat jangka panjang dan kurang tepat jika dipakai untuk pendugaan harian. Alasan penggunaan model-model fundamental ialah karena penggunaan dan fungsi model yang sederhana, mudah dipahami dan menggunakan data faktor-faktor fundamental ekonomi yang mudah diperoleh sehingga memudahkan user atau pengguna untuk mengoptimalkan penggunaannya. Program simulasi dapat menghasilkan beberapa output sekaligus dan model yang berbeda

bila user memiliki data input yang lengkap. Output yang dihasilkan dapat berupa taksiran nilai dan arah pergerakan kurs di masa mendatang.

Secara umum proses pengolahan data menggunakan program terdiri dari tiga tahap. Tahap pertama ialah proses input data. Pada tahapan mi user memasukkan data ke dalam program (menggunakan input devices seperti keyboard). Tahap berikutnya ialah pemrosesan data menggunakan fungsi atau model yang terdapat dalam program untuk menghasilkan informasi. Tahap ketiga ialah proses output informasi.. Pada tahap akhir ini data yang telah diproses tadi diperlihatkan kepada user sebagai informasi.

Pemrograman forecasting valuta dilakukan menggunakan software bahasa pemrograman Delphi for Windows 95. Pemilihan penggunaan bahasa pemrograman Delphi ini ialah karena mudah dipelajari, user interface yang baik, hasil kompilasi yang berkualitas serta mendukung penuh model aplikasi 32-bit pada Windows 95.

Keuntungan dan kemudahan dalam penggunaan program forecasting valuta antara lain data-data input berupa parameter fundamental ekonomi yang mudah diperoleh, user dapat sekaligus mengeksekusi model-model sehingga dapat langsung membandingkan output dan hasil eksekusi masing-masing model forecasting, penggunaan program menggunakan bahasa Indonesia sehingga mudah dipelajani, user interface Windows 95 yang bersahabat, penggunaan tab notebook pada setiap tahapan penggunaan program memudahkan user dalam menginput data dan memperoleh output infonnasi, fasilitas help atau bantuan yang lengkap, serta fasilitas pelaporan (reporting) untuk pencetakan output hasil forecasting menggunakan printer.

Pengembangan sistem lebih lanjut masih dapat dilakukan dengan melengkapi program modul technical forecasting dan fasilitas untuk mendesain model sendiri oleh pengguna program sehingga memungkinkan pengguna program untuk menambah model-model forecasting yang baru. Pengembangan lain yang juga memungkinkan ialah penambahan modul program dengan komunikasi internet. Dengan modul mi maka user dapat mencari data dan mengambil data langsung dari internet sehingga hasil output forecasting yang diperoleh menjadi Iebih baik lagi.