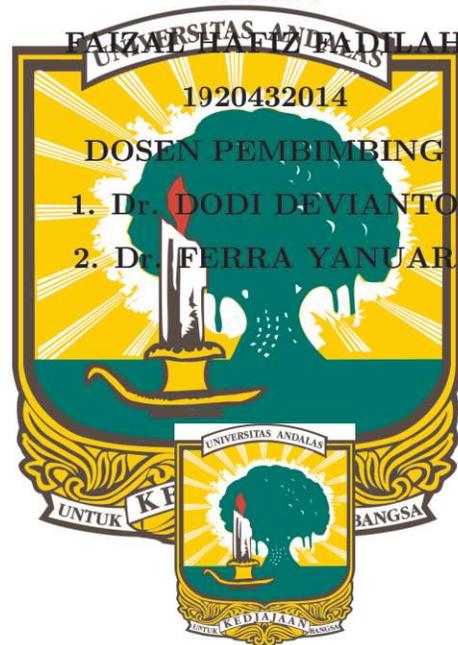


**PEMODELAN HARGA KONTRAK BERJANGKA
KOMODITAS KOPI MENGGUNAKAN METODE
SIMULASI MONTE CARLO DAN QUASI MONTE CARLO**

TESIS

OLEH :



**PROGRAM STUDI MAGISTER MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS ANDALAS
PADANG
2021**

ABSTRAK

Kontrak berjangka saat ini menjadi salah satu alternatif yang sering digunakan dalam manajemen resiko keuangan. Kontrak berjangka merupakan suatu perjanjian antara 2 pihak yang akan membeli atau menjual aset keuangan seperti komoditas di masa yang akan datang dengan harga yang telah ditetapkan sebelumnya. Penelitian ni bertujuan untuk menentukan harga kontrak berjangka komoditas dengan menggunakan metode simulasi Monte Carlo dan Quasi Monte Carlo. Hasil yang diperoleh kemudian dibandingkan untuk melihat metode yang terbaik. Data yang digunakan adalah historis penutupan komoditas kopi arabika periode Januari 2018 s/d Desember 2020 (Bappebti). Hasil perhitungan menunjukan bahwa barisan quasi acak Sobol lebih cepat menghasilkan harga yang konvergen ke suatu nilai dan quasi acak Halton menghasilkan harga dengan standar error yang kecil dibanding dengan barisan quasi acak lainnya.

