



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

APLIKASI OPSI BARRIER UNTUK PROTEKSI PRODUK PERTANIAN
GILANG PRIMAJATI, Dr. Abdurakhman, M.Si
Universitas Gadjah Mada, 2016 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

INTISARI

APLIKASI OPSI BARRIER UNTUK PROTEKSI PRODUK PERTANIAN

Oleh

GILANG PRIMAJATI
14/371081/PPA/04565

Tesis ini membahas tentang aplikasi opsi barrier untuk penentuan premi asuransi harga komoditas pertanian yang disebabkan oleh turunnya harga jual dengan menerapkan batasan level barrier tertentu. Dalam penentuan premi asuransi harga komoditas pertanian, komponen harga diasumsikan bergerak mengikuti Gerak Brown Geometrik dan penentuan level barrier menggunakan Gerak Brown Bridge. Nilai manfaat dihitung dengan mengalikan produktivitas hasil panen dengan kekurangan harga akibat menurunnya harga jual komoditas. Pendekatan model opsi barrier digunakan untuk mengkonstruksi formula premi asuransi harga komoditas pertanian.

Kata kunci: opsi barrier, Gerak Brown Bridge, premi asuransi harga pertanian



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

APLIKASI OPSI BARRIER UNTUK PROTEKSI PRODUK PERTANIAN
GILANG PRIMAJATI, Dr. Abdurakhman, M.Si
Universitas Gadjah Mada, 2016 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

ABSTRACT

APPLICATION BARRIER OPTION FOR PROTECTION AGRICULTURE PRODUCT

by

GILANG PRIMAJATI
14/371081/PPA/04565

This thesis discusses about the application of barrier options for the determination of insurance premiums in agricultural commodity prices caused by lower selling prices by applying the limits specified barrier level. In determining the insurance premium agricultural commodity prices, the price component is assumed to move to follow Geometric Brownian Motion and determining the level of barrier using Brownian Motion Bridge. The value of the benefit is calculated by multiplying the productivity of the crops with the price of a shortage due to declining commodity prices. Barrier option model approach is used to construct formulas insurance premium prices for agricultural commodities.

Key words: option barrier, Geometric Brownian Motion, crop insurance premium prices