

LAPORAN PENELITIAN



APLIKASI MODEL BLACK-CHOLES PADA ASURANSI

Drs. Franky Alfrits Oroh, M.Si
NIP. 19630420 199003 1 002

Jurusan Pendidikan Matematika
Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam
Universitas Negeri Gorontalo
Oktober 2011

HALAMAN PENGESAHAN

1. Judul Penelitian : Aplikasi model Black-Choles pada Asuransi

2. Ketua Peneliti
 - a. Nama Lengkap : Drs. Franky Alfrits oroh, M.Si
 - b. Jenis Kelamin : L
 - c. NIP : 19630420 199003 1 002
 - d. Jabatan Fungsional : Lektor
 - e. Jabatan Struktural : Sekretaris Jurusan Pendidikan Matematika
 - f. Bidang Keahlian : Matematika Terapan
 - g. Fakultas/Jurusan : MIPA/Pendidikan Matematika
 - h. Perguruan Tinggi : Universitas Negeri Gorontalo

3. Pendanaan dan jangka waktu penelitian
 - a. Jangka waktu penelitian yang diusulkan : 1 semester
 - b. Biaya total yang diusulkan : Rp. 5.000.000,-


Mengetahui,
Dekan FMIPA,


Prof. Dr. Hj. Evi Hulukati, M.Pd
NIP. 19600530 1986 2 001

Gorontalo, 18 oktober 2011
Ketua Peneliti,


Drs. Franky Alfrits Oroh, M.Si
NIP. 19630420 199003 1 002

Menyetujui
Ketua Lembaga Penelitian,


Prof. Dr. Hi. Ishak Isa, M.Si
NIP. 19610526 198703 1 005

ABSTRACT

We find some equilibrium conditions between all those coefficients they are strategy, participation rate and guaranteed minimum rate, from analytical point of view of the bonus system and first fair valuation is made in the classical binomial model and then extended in a Black-Scholes model.

Keywords. Black-Scholes model.