



UNIVERSITAS  
GADJAH MADA

Analisis Volatilitas Cryptocurrency untuk Estimasi Value at Risk Menggunakan Model Exponential Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (EGARCH)

FINDRIANTI PALIAS, Prof. Dr.rer.nat. Dedi Rosadi, S.Si., M.Sc.Eng.Math.

Universitas Gadjah Mada, 2023 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

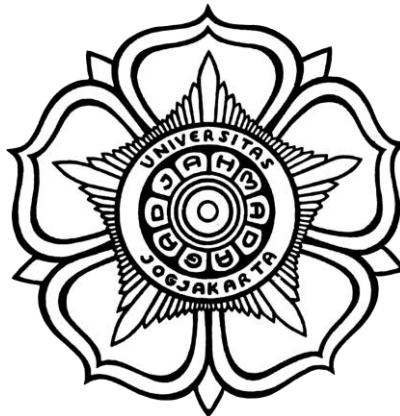
## TESIS

# **ANALISIS VOLATILITAS CRYPTOCURRENCY UNTUK ESTIMASI VALUE AT RISK MENGGUNAKAN MODEL EXPONENTIAL GENERALIZED AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL HETEROSCEDASTICITY (EGARCH)**

**(VOLATILITY ANALYSIS OF CRYPTOCURRENCY FOR VALUE AT RISK ESTIMATION USING EXPONENTIAL GENERALIZED AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL HETEROSCEDASTICITY MODEL)**

Diajukan untuk memenuhi salah satu syarat memperoleh derajat

*Master of Science* Matematika



FINDRIANTI PALIAS

20/466516/PPA/06082

**PROGRAM STUDI MAGISTER MATEMATIKA**

**DEPARTEMEN MATEMATIKA**

**FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM**

**UNIVERSITAS GADJAH MADA**

**YOGYAKARTA**

**2023**