

PERBANDINGAN RISIKO PORTOFOLIO ANTARA STANDAR DEVIASI DAN VaR DENGAN MENGGUNAKAN METODE DELTA NORMAL

Tesis

Untuk memenuhi sebagian persyaratan
Mencapai derajat Sarjana S-2

Program Studi Magister Manajemen
Jurusan Ilmu-ilmu Sosial



diajukan oleh
Jemmy Gemilang Subuh
10213/PS/MM/02

Kepada
**SEKOLAH PASCASARJANA
UNIVERSITAS GADJAH MADA
2004**



LEMBAR PENGESAHAN

PERBANDINGAN RISIKO PORTOFOLIO ANTARA STANDAR DEVIASI DAN VaR DENGAN MENGUNAKAN METODE DELTA NORMAL

yang dipersiapkan dan disusun oleh
Jemmy Gemilang Subuh
10213/PS/MM/02
telah dipertahankan di depan Dewan Penguji
pada tanggal 21 Juni 2004
dan dinyatakan telah lulus memenuhi syarat

Yogyakarta, 21 Juni 2004

Dosen Penguji I

Prof. Dr. Zaki Baridwan, M.Sc

Dosen Penguji II

Dr. Jogiyanto Hartono MBA

Dosen Pembimbing

Dr. Jogiyanto Hartono, MBA