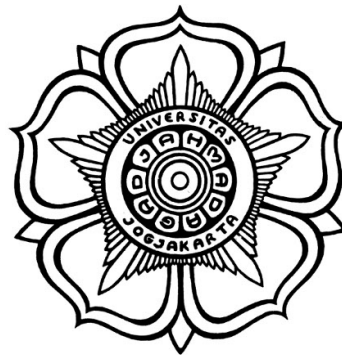


TESIS

ESTIMASI VALUE AT RISK PADA SAHAM *FAST-MOVING CONSUMER GOODS* MENGGUNAKAN MODEL EGARCH-GPD

(*ESTIMATION OF VALUE AT RISK IN FAST-MOVING CONSUMER GOODS STOCKS USING THE EGARCH-GPD MODEL*)

Diajukan untuk memenuhi salah satu syarat memperoleh derajat
Master of Science Matematika



Anugerah Agung Kristiawan
20/466507/PPA/06073

**PROGRAM STUDI MAGISTER MATEMATIKA
DEPARTEMEN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS GADJAH MADA
YOGYAKARTA**

2024

HALAMAN PENGESAHAN

TESIS

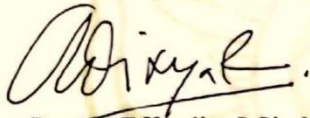
ESTIMASI VALUE AT RISK PADA SAHAM *FAST-MOVING CONSUMER GOODS* MENGGUNAKAN MODEL EGARCH-GPD

Telah dipersiapkan dan disusun oleh

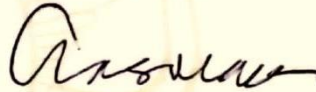
ANUGERAH AGUNG KRISTIAWAN
20/466507/PPA/06073

Telah dipertahankan di depan Tim Penguji
pada tanggal 10 Juli 2024

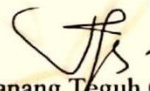
Susunan Tim Penguji



Dr. Adhitya Ronnie Effendie, S.Si., M.Si., M.Sc.
Pembimbing Utama



Dr. Abdurakhman, S.Si., M.Si.
Ketua Tim Penguji



Danang Teguh Qoyyimi, S.Si., M.Sc., Ph.D.
Penguji

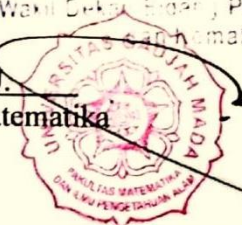


Dr. Indarsih, S.Si., M. Si.
Penguji

Tesis ini telah diterima sebagai salah satu persyaratan
untuk memperoleh gelar *Master of Science*
Tanggal 10 Juli 2024

Prof. Dr. Sri Wahyuni, S.U.
Ketua Program Studi Magister Matematika

Mengetahui,
Dean Dekan FMIPA UGM
Wakil Dekan Bidang Pendidikan, Pengajaran
dan Mahasiswa



Prof. Drs. Roto, M.Eng., Ph.D.
NIP. 196711171993031020