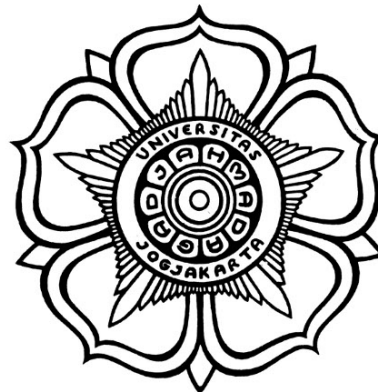


SKRIPSI

**PERBANDINGAN PEMODELAN *EXPECTED SHORTFALL* DENGAN
METODE GLOSTEN-JAGANNATHAN-RUNKLE GARCH (GJR-GARCH)
DAN EGARCH: STUDI KASUS PADA ASET KRIPTO BITCOIN**

**(COMPARISON OF EXPECTED SHORTFALL MODELING USING THE
GLOSTEN-JAGANNATHAN-RUNKLE GARCH (GJR-GARCH) AND
EGARCH METHODS: A CASE STUDY ON BITCOIN
CRYPTOCURRENCY ASSETS)**



MOHAMMAD DAFI NAZWA AULIA
21/475207/PA/20547

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

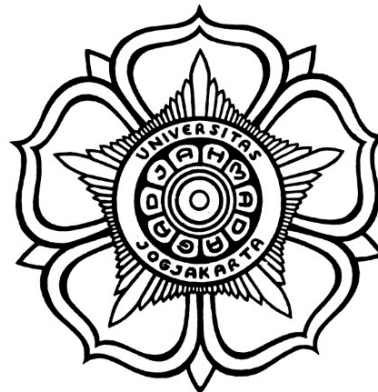
2025

SKRIPSI

PERBANDINGAN PEMODELAN *EXPECTED SHORTFALL* DENGAN METODE GLOSTEN-JAGANNATHAN-RUNKLE GARCH (GJR-GARCH) DAN EGARCH: STUDI KASUS PADA ASET KRIPTO BITCOIN

(*COMPARISON OF EXPECTED SHORTFALL MODELING USING THE GLOSTEN-JAGANNATHAN-RUNKLE GARCH (GJR-GARCH) AND EGARCH METHODS: A CASE STUDY ON BITCOIN CRYPTOCURRENCY ASSETS*)

Diajukan untuk memenuhi salah satu syarat memperoleh derajat Sarjana Statistika
Program Sarjana Program Studi Statistika



MOHAMMAD DAFI NAZWA AULIA
21/475207/PA/20547

PROGRAM SARJANA PROGRAM STUDI STATISTIKA
DEPARTEMEN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS GADJAH MADA
YOGYAKARTA

2025

HALAMAN PENGESAHAN

SKRIPSI


PERBANDINGAN PEMODELAN *EXPECTED SHORTFALL* DENGAN METODE GLOSTEN-JAGANNATHAN-RUNKLE GARCH (GJR-GARCH) DAN EGARCH: STUDI KASUS PADA ASET KRIPTO BITCOIN

Telah dipersiapkan dan disusun oleh


MOHAMMAD DAFI NAZWA AULIA
21/475207/PA/20547

Telah dipertahankan di depan Tim Penguji
pada tanggal 9 Januari 2025


Susunan Tim Penguji



Dr. Dwi Ertiningsih, S.Si., M.Si.
Pembimbing Utama



Drs. Danardono, MPH., Ph.D.
Ketua Tim Penguji




Atina Husnaqilati, S.Si., M.Sc., Ph.D.
Penguji

Mengetahui,
a.n. Dekan FMIPA UGM
Wakil Dekan Bidang Pendidikan, Pengajaran
dan Kemahasiswaan



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



Rahmasari Nur Azizah, S.Si., M.Sc.
Penguji