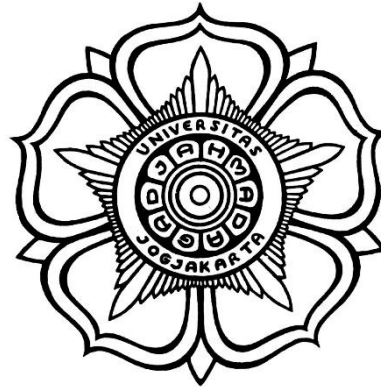


**EVALUASI TEKNIK-TEKNIK ANALISIS DATA  
UNTUK MENGUKUR *VALUE-AT-RISK* (VAR): STUDI  
KASUS PORTOFOLIO OBLIGASI PT IDN FINANCE**

**Tesis**

untuk memenuhi sebagian persyaratan  
mencapai derajat Sarjana S-2

Program Studi Magister Manajemen



Diajukan oleh  
**Andre Parulian**  
23/526649/PEK/29765

Kepada  
**FAKULTAS EKONOMIKA DAN BISNIS  
UNIVERSITAS GADJAH MADA  
2025**

# EVALUASI TEKNIK-TEKNIK ANALISIS DATA UNTUK MENGUKUR *VALUE-AT-RISK* (VAR): STUDI KASUS PORTOFOLIO OBLIGASI PT IDN FINANCE

Disiapkan dan disusun oleh:

**Andre Parulian**

23/526649/PEK/29765

telah dipertahankan di depan Dewan Penguji  
pada tanggal 14 Juli 2025  
dan dinyatakan telah lulus memenuhi syarat

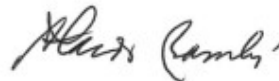
Susunan Dewan Penguji

Dosen Penguji I



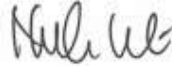
Prof. Dr. Tri Gunarsih, M.M.,  
NIP 110989002

Dosen Penguji II



Hardo Basuki, Dr., M.Soc.Sc., CSA., CA.,  
NIP 121195608202201101

Dosen Penguji III



I Wayan Nuka Lantara, M.Si., Ph.D.,  
NIP 197503312008011003

Tesis ini diterima sebagai salah satu persyaratan  
Untuk memperoleh gelar Master of Business Administration (M.B.A.)  
Tanggal 14 Juli 2025


Ketua Prodi Magister Manajemen



Prof. Dr. Tandelilin Eduardus, M.B.A.  
NIP 195610131983031002

Mengetahui,  
Wakil Dekan Bidang Akademik  
Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Gadjah Mada



  
Bayu Sutikno, SE., M.S.M., PhD.  
NIP 197805202005011002



## PERNYATAAN KEASLIAN KARYA TULIS TESIS atau KARYA TULIS MANDIRI

Yang bertanda tangan di bawah ini saya, menyatakan bahwa tesis/karya tulis mandiri dengan judul:

**EVALUASI TEKNIK-TEKNIK ANALISIS DATA UNTUK MENGUKUR *VALUE-AT-RISK* (VAR):  
STUDI KASUS PORTOFOLIO OBLIGASI PT IDN FINANCE**

dan diajukan untuk diuji pada tanggal: 14 Juli 2025 adalah hasil karya saya. Dengan ini saya menyatakan dengan sesungguhnya bahwa dalam tesis/karya tulis mandiri ini tidak terdapat keseluruhan atau sebagian tulisan orang lain yang saya ambil dengan cara menyalin, atau meniru dalam bentuk rangkaian kalimat atau simbol yang menunjukkan gagasan atau pendapat atau pemikiran dari penulis lain, yang saya aku seolah-olah sebagai tulisan saya sendiri, dan atau tidak terdapat bagian atau keseluruhan tulisan yang saya salin, tiru, atau yang saya ambil dari tulisan orang lain tanpa memberikan pengakuan pada penulis aslinya.

Apabila saya melakukan hal tersebut di atas, baik sengaja atau tidak, dengan ini saya menyatakan menarik tesis/karya tulis mandiri yang saya ajukan sebagai hasil tulisan saya sendiri ini. Bila kemudian terbukti bahwa saya ternyata melakukan tindakan menyalin atau meniru tulisan orang lain seolah-olah hasil pemikiran saya sendiri, berarti gelar dan ijasah yang telah diberikan oleh universitas **batal saya terima.**

Yogyakarta, 14 Juli 2025  
Yang Memberi Pernyataan



**Andre Parulian**

Saksi 1, sebagai pembimbing tesis/ karya tulis mandiri merangkap anggota tim penguji tesis /karya tulis mandiri:

**I Wayan Nuka Lantara, M.Si., Ph.D.,**

Saksi 2, sebagai anggota tim penguji tesis /karya tulis mandiri :

**Prof. Dr. Tri Gunarsih, M.M.,**

Saksi 3, sebagai anggota tim penguji tesis /karya tulis mandiri :

**Hardo Basuki, Dr., M.Soc.Sc., CSA., CA.,**