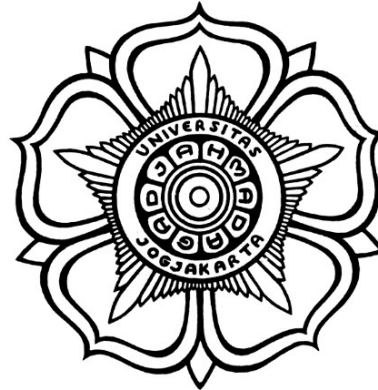


**SKRIPSI**

***ESTIMASI CONDITIONAL VALUE AT RISK (CVAR) MENGGUNAKAN  
MODEL HYBRID GENERALIZED AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL  
HETEROSKEDASTICITY DAN LONG SHORT-TERM MEMORY: STUDI  
KASUS PADA INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN***

***CONDITIONAL VALUE AT RISK (CVAR) ESTIMATION USING HYBRID  
GENERALIZED AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL  
HETEROSKEDASTICITY AND LONG SHORT-TERM MEMORY  
MODEL: CASE STUDY ON IDX COMPOSITE***



Dwi Cahya Nurani  
22/497587/PA/21429

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

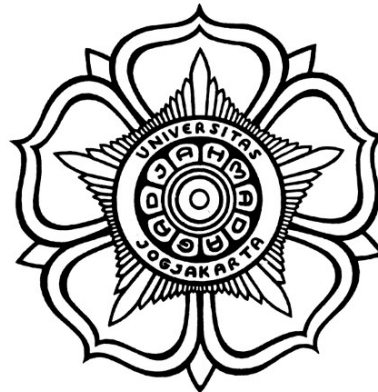
**2026**

**SKRIPSI**

***ESTIMASI CONDITIONAL VALUE AT RISK (CVAR) MENGGUNAKAN  
MODEL HYBRID GENERALIZED AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL  
HETEROSKEDASTICITY DAN LONG SHORT-TERM MEMORY: STUDI  
KASUS PADA INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN***

***CONDITIONAL VALUE AT RISK (CVAR) ESTIMATION USING HYBRID  
GENERALIZED AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL  
HETEROSKEDASTICITY AND LONG SHORT-TERM MEMORY  
MODEL: CASE STUDY ON IDX COMPOSITE***

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



Dwi Cahya Nurani  
22/497587/PA/21429

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

**2026**

## HALAMAN PENGESAHAN

### SKRIPSI

**ESTIMASI CONDITIONAL VALUE AT RISK (CVAR) MENGGUNAKAN  
MODEL HYBRID GENERALIZED AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL  
HETEROSKEDASTICITY DAN LONG SHORT-TERM MEMORY: STUDI  
KASUS PADA INDEKS HARGA SAHAM GABUNGAN**

Telah dipersiapkan dan disusun oleh

Dwi Cahya Nurani  
22/497587/PA/21429

Telah dipertahankan di depan Tim Penguji  
pada tanggal 7 Januari 2026

Susunan Tim Penguji



Prof. Dr. Abdurakhman, S.Si., M.Si.  
Pembimbing Utama



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

Mengetahui,  
a.n. Dekan FMIPA UGM  
Wakil Dekan Bidang Keuangan, Aset,  
dan Sumber Daya Manusia



Prof. Dr.-Ing. Mhd. Rizki M. Pulungan, S.Si., M.Sc.  
NIP. 1975110120021002



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



Rianti Siswi Utami, S.Si., M.Sc.  
Penguji