

**ANALISIS RISIKO PORTOFOLIO SAHAM DENGAN
VALUE AT RISK MODEL VOLATILITAS GARCH
STUDI KASUS: DANA PENSIUN PT ABC**

Tesis

untuk memenuhi sebagian persyaratan
mencapai derajat Sarjana S-2

Program Studi Magister Manajemen



Diajukan Oleh

M. Alif Anugrah Y.

15/387220/PEK/20770

Kepada

FAKULTAS EKONOMIKA DAN BISNIS

UNIVERSITAS GADJAH MADA

2018