

SKRIPSI

ESTIMASI *VALUE AT RISK* DENGAN PEMODELAN GARCH-GEV MENGUNAKAN METODE ESTIMASI PARAMETER *PROBABILITY WEIGHTED MOMENTS*

VALUE AT RISK ESTIMATION WITH GARCH-GEV MODELLING USING ESTIMATION PARAMETER METHOD OF PROBABILITY WEIGHTED MOMENTS

Diajukan untuk memenuhi salah satu syarat memperoleh derajat
Sarjana Sains pada Program Studi Statistika FMIPA UGM



Pinasthi Renaningtias
14/364219/PA/15952

**PROGRAM STUDI S1 STATISTIKA
DEPARTEMEN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS GADJAH MADA
YOGYAKARTA**

2018