

SKRIPSI

**ESTIMASI *VALUE AT RISK* (VaR) PORTOFOLIO MULTIVARIAT
MENGGUNAKAN METODE GJR GARCH-EVT-VINE COPULA**

**(ESTIMATION OF *VALUE AT RISK* (VaR) OF PORTFOLIO BASED ON GJR
GARCH-EVT-VINE COPULA METHOD)**



Yuliana Triastuti
14/364295/PA/15971

**PROGRAM STUDI S1 STATISTIKA
DEPARTEMEN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS GADJAH MADA
YOGYAKARTA
2019**