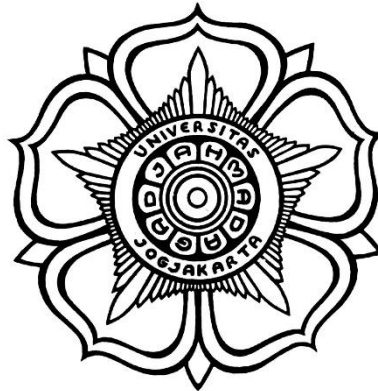


SKRIPSI

ESTIMASI VALUE AT RISK (VaR) DENGAN MENGGUNAKAN MODEL GTLGARCH (1,1)

ESTIMATING VALUE AT RISK (VaR) USING GTLGARCH (1,1) MODEL

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



Nurul Hidayati

15/383367/PA/17027

PROGRAM STUDI STATISTIKA

DEPARTEMEN MATEMATIKA

FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM

UNIVERSITAS GADJAH MADA

2019