

SKRIPSI

**ESTIMASI VALUE AT RISK INTRADAY PORTOFOLIO DENGAN
METODE CGARCH(1,1)-EVT-COPULA**

***(INTRADAY PORTFOLIO VALUE AT RISK ESTIMATION USING
CGARCH(1,1)-EVT-COPULA METHOD)***

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



Willy Raditya Ningsih
16/398669/PA/17630

**PROGRAM STUDI STATISTIKA
DEPARTEMEN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS GADJAH MADA
YOGYAKARTA
2020**