



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

WILLY RADITYA N, Dr. Abdurakhman, M.Si.

Universitas Gadjah Mada, 2020 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

UNIVERSITAS
GADJAH MADA

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**