

SKRIPSI

**ESTIMASI *CONDITIONAL VALUE AT RISK* (CVaR) PORTFOLIO
MULTIVARIAT SAHAM-SAHAM LQ45 DENGAN METODE GARCH-
STUDENT-T-EVT-VINE COPULA**

***(ESTIMATING CONDITIONAL VALUE AT RISK (CVaR) OF MULTIVARIATE
PORTFOLIO OF LQ45 STOCKS USING GARCH-STUDENT-T-EVT-VINE
COPULA METHOD)***

Diajukan untuk memenuhi salah satu syarat memperoleh derajat

Sarjana Sains Statistika



MICHAEL

17/409525/PA/17832

PROGRAM STUDI S1 STATISTIKA

DEPARTEMEN MATEMATIKA

FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM

UNIVERSITAS GADJAH MADA

YOGYAKARTA

2020