



Optimisasi Portofolio dengan Kendala Conditional Value-at-Risk (CVaR)

MUHAMMAD ZUHRI ARFIN, Dr. Nanang Susyanto, S.Si., M.Sc.

Universitas Gadjah Mada, 2021 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

UNIVERSITAS
GADJAH MADA

SKRIPSI

OPTIMISASI PORTOFOLIO DENGAN KENDALA CONDITIONAL VALUE-AT-RISK (CVAR)

(**PORTFOLIO OPTIMIZATION WITH CONDITIONAL VALUE-AT-RISK
(CVAR) CONSTRAINTS**)



MUHAMMAD ZUHRI ARFIN
17/411328/PA/17848

PROGRAM SARJANA PROGRAM STUDI MATEMATIKA
DEPARTEMEN MATEMATIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS GADJAH MADA
YOGYAKARTA

2021