

## SKRIPSI

### **ESTIMASI *VALUE AT RISK* (VaR) PORTOFOLIO MULTIVARIAT MENGUNAKAN METODE GARCH STUDENT T-EVT-VINE COPULA**

***(ESTIMATING VALUE AT RISK (VaR) OF MULTIVARIATE PORTFOLIO  
USING GARCH STUDENT T-EVT-VINE COPULA METHOD)***



Nadya Nirvanda Kichen  
13/347970/PA/15406

**PROGRAM STUDI S1 STATISTIKA  
DEPARTEMEN MATEMATIKA  
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM  
UNIVERSITAS GADJAH MADA  
YOGYAKARTA  
2017**

## SKRIPSI

### **ESTIMASI VALUE AT RISK (VaR) PORTOFOLIO MULTIVARIAT MENGUNAKAN METODE GARCH STUDENT T-EVT-VINE COPULA**

#### ***(ESTIMATING VALUE AT RISK (VaR) OF MULTIVARIATE PORTFOLIO USING GARCH STUDENT T-EVT-VINE COPULA METHOD)***

Diajukan untuk memenuhi salah satu syarat memperoleh derajat  
Sarjana Sains Statistika



Nadya Nirvanda Kichen  
13/347970/PA/15406

**PROGRAM STUDI S1 STATISTIKA  
DEPARTEMEN MATEMATIKA  
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM  
UNIVERSITAS GADJAH MADA  
YOGYAKARTA  
2017**