

**SKRIPSI**

**PERBANDINGAN DISTRIBUSI *STABLE* DENGAN MODEL GARCH-GPD  
UNTUK MENGESTIMASI *VALUE AT RISK***

***COMPARISON STABLE DISTRIBUTION WITH GARCH-GPD MODEL  
FOR VALUE AT RISK ESTIMATION***



**Danang Akbar Riano**  
**13/352688/PA/15690**

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