

SKRIPSI

ESTIMASI VALUE AT RISK (VAR) PORTOFOLIO BIVARIAT MENGGUNAKAN METODE COPULA – GARCH

ESTIMATING VALUE AT RISK (VAR) OF BIVARIATE PORTFOLIO USING COPULA – GARCH METHOD



TRI MUTOHAROH

12/331544/PA/14759

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

2016

SKRIPSI

ESTIMASI *VALUE AT RISK* (VAR) PORTOFOLIO BIVARIAT MENGGUNAKAN METODE COPULA – GARCH

ESTIMATING VALUE AT RISK (VAR) OF BIVARIATE PORTFOLIO USING COPULA – GARCH METHOD

Diajukan untuk memenuhi salah satu syarat memperoleh derajat
Sarjana Sains Matematika



TRI MUTOHAROH

12/331544/PA/14759

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

2016