

**HALAMAN PERSETUJUAN PEMBIMBING
TUGAS AKHIR**

Judul : Prediksi *Value at Risk* (VaR) Portofolio Bivariat dengan
Menggunakan Pendekatan Metode Simulasi Monte Carlo-
Copula Gaussian dan Variansi-Kovariansi
(Studi Kasus : Saham Mingguan Perusahaan Samsung
Electronics Co., Ltd (005930.KS) dan Apple Inc (AAPL) pada
Tahun 2017)

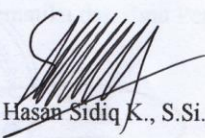
Nama Mahasiswa : Eka Rusnita

Nomor Mahasiswa : 14 611 113

**TUGAS AKHIR INI TELAH DIPERIKSA DAN DISETUJUI UNTUK
DIUJIKAN**

Yogyakarta, 15 November 2018

الإمامة الإسلامية
Pembimbing,


Muhammad Hasan Sidiq K., S.Si., M.Sc.

**HALAMAN PENGESAHAN
TUGAS AKHIR**

**PREDIKSI *VALUE AT RISK* (VAR) PORTOFOLIO BIVARIAT DENGAN
MENGUNAKAN PENDEKATAN METODE SIMULASI MONTE CARLO-
COPULA GAUSSIAN DAN VARIANSI-KOVARIANSI**

(Studi Kasus : Saham Mingguan Perusahaan Samsung Electronics Co., Ltd
(005930.KS) dan Apple Inc (AAPL) Pada Tahun 2017)

Nama Mahasiswa : Eka Rusnita

Nomor Mahasiswa : 14 611 113

**TUGAS AKHIR INI TELAH DIUJIKAN
PADA TANGGAL 12 Desember 2018**

Nama Penguji

Tanda Tangan

1. Dr. Edy Widodo, S.Si., M.Si (.....)
2. Dr. Jaka Nugraha, S.Si., M.Si (.....)
3. Muhammad Hasan Sidiq K., S.Si., M.Sc. (.....)

Mengetahui,

Dekan Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam



Prof. Riyanto, S.Pd., M.Si., Ph.D.

PREDIKSI VALUE AT RISK PERNYATAAN LIO RIVARIAT DENGAN
MENGUNAKAN PENDEKATAN METODE SIMULASI MONTE CARLO-
COPULA GAUSSIAN DAN VARIANSI-KOVARIANSI

Dengan ini saya menyatakan bahwa dalam Tugas Akhir ini tidak terdapat karya yang sebelumnya pernah diajukan untuk memperoleh gelar kesarjanaan di suatu perguruan tinggi dan sepanjang pengetahuan saya tidak terdapat karya atau pendapat yang pernah ditulis atau diterbitkan oleh orang lain, kecuali yang diacu dalam naskah ini dan disebutkan dalam daftar pustaka.

INTISARI

Yogyakarta, 15 November 2018

