

**PERBANDINGAN *VALUE AT RISK* (VaR) PADA BANK BUMN  
DAN BANK SWASTA MENGGUNAKAN METODE  
*GENERALIZED AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL  
HETEROSCEDASTIC* (GARCH)**

**TUGAS AKHIR**



**Gita Sandy Ariadne  
14611208**

**PROGRAM STUDI STATISTIKA  
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM  
UNIVERSITAS ISLAM INDONESIA  
YOGYAKARTA  
2018**