



**PERBANDINGAN MODEL *INTEGRATED GENERALIZED
AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL HETEROSCEDASTICITY*
(IGARCH) DAN *GENERALIZED AUTOREGRESSIVE
CONDITIONAL HETEROSCEDASTICITY IN MEAN* (GARCH-
M) UNTUK PERHITUNGAN *VALUE AT RISK***

SKRIPSI

Diajukan sebagai salah satu syarat untuk memperoleh gelar Sarjana Statistika

Oleh

ANDIKA FAJAR RAMADHANA

B2A017007

**PROGRAM STUDI S1 STATISTIKA
FAKULTAS MATEMATIKA DAN ILMU PENGETAHUAN ALAM
UNIVERSITAS MUHAMMADIYAH SEMARANG
2021**