

Lembar Pengesahan

**Value-at-Risk Pada Portofolio Berbasis Model
Glosten-Jagannathan-Runkle Heavy Tail dan Copula**

*Value-at-Risk at Portfolio Based On
Glosten-Jagannathan-Runkle Model Heavy Tail and Copula*

**Alfian Yudha Iswara
NIM: 1107134158**

Tugas Akhir ini diterima dan disahkan untuk memenuhi sebagian dari syarat
untuk memperoleh gelar sarjana Sains Komputasi
Program Studi Sarjana Ilmu Komputasi
Fakultas Informatika Universitas Telkom

Bandung, 7 Agustus 2017
Menyetujui

Pembimbing 1



Rian Febrian Umbara, S.Si., M.Si.
NIP: 08820481-1

Pembimbing 2



Aniq Atiqi Rohmawati, S.Si., M.Si.
NIP: 15881685-1

Mengesahkan,
Kepala Program Studi Ilmu Komputasi



Dr. Deni Saepudin
NIP: 99750181-1