

**PENGUJIAN MODEL *VALUE AT RISK* DAN *GENERALIZED
AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL HETEROSKEDASTICITY* PADA
PERTUKARAN NILAI MATA UANG PADA MASA KRISIS EKONOMI
DI INDONESIA TAHUN 2005, 2008, DAN 2010**

TESIS

Disusun oleh:

DHANNE SISWANTY PUTRI GINTING

2401160007



**PROGRAM STUDI MAGISTER MANAJEMEN
FAKULTAS EKONOMI DAN BISNIS
UNIVERSITAS TELKOM
BANDUNG
2017**