

**PENGUKURAN *VALUE AT RISK* DENGAN ESTIMASI VOLATILITAS  
MENGUNAKAN METODE *GENERALIZED AUTOREGRESSIVE  
CONDITIONAL HETEROSKEDASTICITY (GARCH)*  
(Studi Kasus Pada Sub Sektor Perkebunan yang Terdaftar di BEI Periode  
2009-2014)**

**SKRIPSI**

Diajukan untuk Memenuhi Salah Satu Syarat  
Memperoleh Gelar Sarjana Pendidikan  
Program Pendidikan Manajemen Bisnis



Oleh  
Setia Akbar  
1204159

**FAKULTAS PENDIDIKAN EKONOMI DAN BISNIS  
UNIVERSITAS PENDIDIKAN INDONESIA  
2016**

**PENGUKURAN *VALUE AT RISK* DENGAN ESTIMASI VOLATILITAS  
MENGUNAKAN METODE *GENERALIZED AUTOREGRESSIVE  
CONDITIONAL HETEROSKEDASTICITY (GARCH)*  
(Studi Kasus Pada Sub Sektor Perkebunan yang Terdaftar di BEI Periode  
2009-2014)**

Oleh  
Setia Akba  
1204159

Sebuah Skripsi yang diajukan untuk memenuhi salah satu syarat memperoleh gelar Sarjana pada fakultas Pendidikan Ekonomi dan Bisnis.

©Setia Akbar  
Universitas Pendidikan Indonesia  
April 2016

Hak Cipta dilindungi undang-undang  
Skripsi ini tidak boleh diperbanyak seluruhnya atau sebagian, dengan dicetak ulang, difotokopi, atau cara lainnya tanpa ijin dari penulis.

**LEMBAR PENGESAHAN**

**PENGUKURAN *VALUE AT RISK* DENGAN ESTIMASI VOLATILITAS  
MENGUNAKAN METODE *GENERALIZED AUTOREGRESSIVE  
CONDITIONAL HETEROSKEDASTICITY (GARCH)*  
(Studi Kasus Pada Sub Sektor Perkebunan yang Terdaftar di BEI Periode  
2009-2014)**

**Skripsi ini disetujui dan disahkan oleh:**

Pembimbing I

Pembimbing II

Mayasari, SE., MM  
NIP. 19710705 200401 2 001

Rini Andari, S.Pd., SE.Par., MM  
NIP. 19810916 200812 2 001

Mengetahui,

Dekan Fakultas  
Pendidikan Ekonomi dan Bisnis  
Universitas Pendidikan Indonesia

Ketua Program Studi  
Pendidikan Manajemen Bisnis  
Universitas Pendidikan Indonesia

Prof. Dr. H. Disman, M.S  
NIP. 19590209 198412 1 001

Dr. Lili Adi Wibowo, S.Sos., S.Pd., M.M  
NIP. 19690404 199903 1 001

Tanggung Jawab Yuridis  
Ada pada Penulis

Setia Akbar  
NIM.1204159