



**ANALISIS *VALUE AT RISK* (VaR) DENGAN  
MODEL EWMA, GARCH DAN EVT POT:  
STUDI KASUS PADA IHSG, LQ45 DAN KURS IDR/USD**



**KARYA AKHIR**

UNIVERSITAS  
MERCU BUANA

**OLEH:**

**HARI YUWONO**

**5510 7110 064**

**UNIVERSITAS MERCU BUANA  
PROGRAM PASCASARJANA  
PROGRAM MAGISTER MANAJEMEN  
2010**