

**PERHITUNGAN *VALUE-AT-RISK* UNTUK PORTOFOLIO
SAHAM DENGAN METODE VARIAN - KOVARIAN DAN
SIMULASI MONTE CARLO**

Studi Kasus: Harga Penutupan Saham Harian LQ 45 bulan Agustus 2013 sampai Januari 2014

**VALUE-AT-RISK MEASUREMENT FOR PORTFOLIO
MARKET WITH VARIANCE - COVARIANCE AND MONTE
CARLO SIMULATION**

Study Case : Daily closed index LQ 45 August 2013 until January 2014

Tugas Akhir

Diajukan untuk memenuhi sebagian dari syarat
untuk memperoleh gelar Sarjana Komputasi
Prodi Ilmu Komputasi
TELKOM UNIVERSITY

**Firdaus Maringga
1107090040**



**Prodi Ilmu Komputasi
Telkom University
Bandung
2015**