

**VALUE-AT-RISK MENGGUNAKAN MODEL *MARKOV*  
*SWITCHING AUTOREGRESSIVE*  
(STUDI KASUS SAHAM PT. ASTRA  
INTERNASIONAL)**

**Tugas Akhir**

**Diajukan untuk memenuhi salah satu syarat menyelesaikan Program S1 Ilmu  
Komputasi Fakultas Informatika Universitas Telkom**

**ACHMAD SYARIEF FADHOLY**

**1107134149**



**Program Studi Sarjana Ilmu Komputasi**

**Fakultas Informatika**

**Universitas Telkom**

**Bandung**

**2017**