

**ESTIMASI *VALUE at-RISK* (VaR) PADA PERAMALAN
HARGA INDEKS SAHAM AKIBAT TERKENA GERAKAN
BOYCOTT, DIVESTMENT, SANCTION (BDS)
MENGUNAKAN MODEL ARMAX-GARCH**

SKRIPSI

Disusun untuk memenuhi syarat memperoleh gelar Sarjana Sains
di Jurusan Matematika UIN Sunan Gunung Djati Bandung



Oleh

Karin Nafisa

1217010039

**JURUSAN MATEMATIKA
FAKULTAS SAINS DAN TEKNOLOGI
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI SUNAN GUNUNG DJATI
BANDUNG**

2025 M / 1447 H