

**MENGHITUNG NILAI *VALUE AT -RISK* (VaR) PORTOFOLIO
SAHAM PADA MASA PANDEMI COVID-19
MENGUNAKAN MODEL FAMA-FRENCH DAN SIMULASI
MONTE CARLO**

SKRIPSI

Disusun Untuk Memenuhi Syarat Memperoleh Gelar Sarjana Sains di Jurusan
Matematika



oleh

Virma Widia Putri

1207010076

**JURUSAN MATEMATIKA
FAKULTAS SAINS DAN TEKNOLOGI
UNIVERSITAS ISLAM NEGERI SUNAN GUNUNG DJATI
BANDUNG
2024**