

**ANALISIS *VALUE AT RISK* MENGGUNAKAN METODE
VARIANCE – COVARIANCE SERTA PEMBENTUKAN
PORTOFOLIO OPTIMAL MENGGUNAKAN METODE *MEAN
VARIANCE EFFICIENT PORTFOLIO***

(Studi Kasus: PT Aneka Tambang (Persero) Tbk, PT Bank Mandiri
(Persero) Tbk, dan PT Mayora Indah Tbk)



SKRIPSI

Disusun Oleh:

KANZA NAUTICA SENJA

24050122140185

**DEPARTEMEN STATISTIKA
FAKULTAS SAINS DAN MATEMATIKA
UNIVERSITAS DIPONEGORO
SEMARANG**

2026