

**PEMBENTUKAN PORTOFOLIO DENGAN *MULTI INDEX*
MODEL PADA SAHAM *BLUE CHIP* DAN PENGUKURAN
RISIKO DENGAN *EXPECTED SHORTFALL***



SKRIPSI

Disusun Oleh:

RENATA MAJANDRA ADITYA

24050120130112

DEPARTEMEN STATISTIKA

FAKULTAS SAINS DAN MATEMATIKA

UNIVERSITAS DIPONEGORO

SEMARANG

2024