

OPTIMALISASI PORTOFOLIO *MULTI INDEX MODEL*
DENGAN PENGUKURAN RISIKO MENGGUNAKAN
EXPECTED SHORTFALL

**(Studi Kasus : Saham Sektor Kesehatan Di Indonesia Periode
Januari 2019 – Desember 2023)**



SKRIPSI

Disusun Oleh:

NURULLIZA CAMILLA RACHMAN

24050120140148

DEPARTEMEN STATISTIKA
FAKULTAS SAINS DAN MATEMATIKA
UNIVERSITAS DIPONEGORO
SEMARANG

2024