

**SKRIPSI**

**ANALISIS PERFORMA MODEL DERET WAKTU  
ARMA-GARCH DAN VARMA DALAM MERAMALKAN  
PERGERAKAN HARGA *FUTURES* MINYAK MENTAH**

Ditulis untuk memenuhi sebagian persyaratan akademik  
guna memperoleh gelar Sarjana Matematika

**Oleh:**

**NAMA : CARLOS OCTAVENO HANAFIAH**

**NPM : 01112170020**



**PROGRAM STUDI MATEMATIKA  
FAKULTAS SAINS DAN TEKNOLOGI  
UNIVERSITAS PELITA HARAPAN  
JAKARTA  
2022**