

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**