

**MENGUKUR RISIKO SISTEMIK PERBANKAN  
DI INDONESIA: APLIKASI MODEL  
*CONDITIONAL VALUE-AT-RISK* ( $\Delta\text{CoVaR}$ )**



**SKRIPSI**

Diajukan sebagai salah satu syarat  
untuk menyelesaikan Program Sarjana (S1)  
pada program Sarjana Fakultas Ekonomika dan Bisnis  
Universitas Diponegoro

Disusun oleh:

**ERWIN**

**NIM 12010111130088**

**FAKULTAS EKONOMIKA DAN BISNIS  
UNIVERSITAS DIPONEGORO  
SEMARANG  
2015**