

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
PERNYATAAN.....	iii
KATA PENGANTAR	vi
DAFTAR ISI.....	viii
DAFTAR TABEL.....	x
DAFTAR GAMBAR	xi
DAFTAR LAMPIRAN.....	xii
INTISARI.....	xiii
ABSTRACT.....	xiv
 BAB I PENDAHULUAN	 1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Tujuan Penulisan	3
1.3 Pembatasan Masalah	4
1.4 Tinjauan Pustaka	4
1.5 Metode Penulisan	4
1.6 Sistematika Penulisan.....	5
 BAB II DASAR TEORI	 6
2.1 Variabel Random.....	6
2.2 Fungsi Massa dan Kepadatan Probabilitas	6
2.3 Karakteristik Distribusi Peluang	8
2.4 Maximum Likelihood Estimation (MLE)	8
2.5 Metode Newton Raphson	10
2.6 Estimasi <i>Probability Weighted Moments</i> (PWM)	11
2.7 Pemilihan Kriteria	12
2.8 Fungsi Kuantil	13
2.9 Analisis Runtun Waktu	14
2.10 Model <i>Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity</i> (GARCH)	15
2.11 Uji <i>Lagrange-Multiplier Engle</i>	17
2.12 Uji <i>Ljung-Box Q-Statistics</i>	18
2.13 Teori Nilai Ekstrem (<i>Extreme Value Theory</i>)	19
2.14 Metode <i>Block Minima</i>	19
2.15 <i>Generalized Extreme Value</i> (GEV).....	21
2.16 Sifat Leptokurtik.....	23
2.17 Risiko.....	23
2.18 <i>Value at Risk</i> (VaR).....	25
2.19 Backtesting	26
 BAB III ESTIMASI <i>VALUE AT RISK</i> DENGAN PEMODELAN GARCH-GEV MENGUNAKAN METODE ESTIMASI <i>PROBABILITY WEIGHTED</i> <i>MOMENTS</i>	 28

3.1	Pemodelan <i>Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity</i> (GARCH)	28
3.1.1	Estimasi Parameter GARCH-t(1,1).....	29
3.2	Pemodelan <i>Generalized Extreme Value Distribution</i>	37
3.3	Estimasi Parameter <i>Generalized Extreme Value Distribution</i>	38
3.3.1	Metode <i>Probability Weighted Moments</i> (PWM)	39
3.3.2	Metode <i>Maximum Likelihood Estimation</i> (MLE)	43
3.4	Estimasi <i>Value at Risk</i> dengan Model GARCH-GEV	49
BAB IV	STUDI KASUS	53
4.1	Deskripsi Data	53
4.2	Permasalahan Studi Kasus.....	55
4.3	Uji Efek ARCH/GARCH	56
4.4	Estimasi Parameter GARCH-t(1,1)	57
4.5	Estimasi Parameter GARCH-GEV dengan PWM	58
4.6	Perhitungan <i>Value at Risk</i>	60
4.7	Backtesting	61
4.8	Perbandingan Hasil Metode Estimasi MLE dan PWM.....	62
BAB V	PENUTUP.....	64
5.1	Kesimpulan.....	64
5.2	Saran	65
DAFTAR PUSTAKA	66