

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
HALAMAN MOTTO DAN PERSEMBAHAN	iv
KATA PENGANTAR	v
DAFTAR ISI	vii
DAFTAR TABEL	ix
DAFTAR GAMBAR	x
INTISARI	xi
ABSTRACT	xii
BAB I PENDAHULUAN	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Tujuan Penulis	4
1.3 Pembatasan Masalah	4
1.4 Tinjauan Pustaka	5
1.5 Metode Penulisan	6
1.6 Sistematika Penulisan.....	7
BAB II DASAR TEORI	9
2.1 Variabel Random.....	9
2.2 Distribusi Bersama Kontinu	11
2.3 Distribusi Bersyarat.....	11
2.4 Invers Fungsi Distribusi	12
2.5 Analisis Runtun Waktu	12
2.6 Metode Maksimum <i>Likelihood</i>	19
2.7 Matematika Optimasi	20
2.8 Metode Newton Raphson	22
2.9 Dependensi	23
2.10 Copula	25
2.11 <i>Extreme Value Theory</i>	27
2.12 Metode Analitik untuk Menentukan Copula Terbaik.....	32
2.13 <i>Value at Risk (VaR)</i>	33
2.14 <i>Backtesting</i> Model VaR.....	33
BAB III ESTIMASI VALUE AT RISK (VaR) PORTOFOLIO MULTIVARIAT MENGGUNAKAN METODE GJR GARCH-EVT- VINE COPULA	35
3.1 Fungsi Copula.....	35

3.2	Keluarga Copula.....	36
3.3	<i>Vine Copula</i>	40
3.4	Estimasi Parameter.....	44
3.5	Estimasi <i>Value at Risk</i> (VaR) Berbasis <i>Vine Copula</i>	67
BAB IV STUDI KASUS		70
4.1	Deskripsi Data.....	70
4.2	Perangkat Lunak yang Digunakan.....	70
4.3	Permasalahan.....	70
4.4	Karakteristik Data.....	71
4.5	Perhitungan <i>Value at Risk</i> Berbasis Copula.....	73
4.6.	<i>Backtesting</i>	84
BAB V PENUTUP		85
5.1	Kesimpulan.....	85
5.2	Saran.....	87
DAFTAR PUSTAKA		88
LAMPIRAN		
A	DATA HARGA PENUTUPAN DAN RETURN INDEKS SAHAM	89
B	SINTAKS KARAKTERISTIK DATA DAN MODEL GJRGARCH- EVT-VINE COPULA.....	91
C	SINTAKS ESTIMASI VaR.....	101
D	OUTPUT KARAKTERISTIK DATA.....	102
E	OUTPUT ESTIMASI PARAMETER GARCH(1,1) dan GJRGARCH(1,1).....	104
F	OUTPUT ESTIMASI PARAMETER GPD.....	107
G	OUTPUT ESTIMASI PARAMETER COPULA (GPD).....	111
H	OUTPUT ESTIMASI VaR DAN UJI KUPIEC DENGAN GJRGARCH-EVT-VINE COPULA.....	112
I	ESTIMASI PARAMETER COPULA.....	113