

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL	i
HALAMAN PENGESAHAN	ii
HALAMAN PERNYATAAN BEBAS PLAGIASI.....	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 Penulisan	5
1.3 Pembatasan Masalah.....	6
1.4 Tinjauan Pustaka	7
1.5 Metode Penulisan	10
1.6 Sistematika Penulisan	10
BAB II DASAR TEORI.....	13
2.1 Variabel Random.....	13
2.2 Distribusi Bersama Kontinu	18
2.3 Distribusi Bersyarat	20
2.4 Invers Fungsi Distribusi	20
2.5 Analisis Metode Runtun Waktu	21
2.6 Uji <i>Weighted Lagrange-Multiplier Engler</i>	25
2.7 Uji <i>Weighted Ljung Box Q-Statistics</i>	26
2.8 Metode <i>Maximum Likelihood</i>	28
2.9 Matematika Optimasi.....	31
2.10 Metode Newton Raphson.....	36

2.11 Dependensi	38
2.12 Copula	41
2.13 <i>Extreme Value Theory</i> (EVT)	56
2.14 Portfolio Saham	63
2.15 Ukuran Risiko	66
2.16 <i>Backtesting</i> Ukuran Risiko	72
BAB III ESTIMASI <i>CONDITIONAL VALUE AT RISK</i> (CVaR) PORTFOLIO MULTIVARIAT SAHAM-SAHAM LQ45 DENGAN METODE GARCH-STUDENT-T-EVT-VINE COPULA	76
3.1 Fungsi Copula Bivariat	77
3.2 Keluarga Copula	79
3.3 Vine Copula	85
3.4 Estimasi Parameter Model	92
3.5 Estimasi <i>Conditional Value at Risk</i> (CVaR) Berbasis Vine Copula	125
BAB IV STUDI KASUS	131
4.1 Deskripsi Data	131
4.2 Perangkat Lunak yang Digunakan	131
4.3 Permasalahan	132
4.4 Karakteristik Data	133
4.5 Perhitungan <i>Conditional Value at Risk</i> (CVaR) Berbasis Vine Copula	136
4.6 <i>Backtesting</i>	152
BAB V PENUTUP	154
5.1 Kesimpulan	154
5.2 Saran	155
DAFTAR PUSTAKA	157
LAMPIRAN	161
A. DATA HARGA PENUTUPAN, <i>LOG RETURN</i> DAN <i>LOG RETURN</i> KUADRAT SAHAM ADRO, GGRM DAN PTBA	161
B. SYNTAX ESTIMASI CVaR DENGAN PEMODELAN GARCH-STUDENT-T-EVT-VINE COPULA	164
C. OUTPUT HASIL ANALISIS	177