

DAFTAR ISI

HALAMAN JUDUL.....	i
HALAMAN PENGESAHAN.....	ii
HALAMAN PERNYATAAN	iii
MOTTO DAN PERSEMBAHAN	vi
PRAKATA.....	v
DAFTAR ISI.....	vi
DAFTAR TABEL.....	vii
DAFTAR GAMBAR	viii
DAFTAR LAMPIRAN	ix
INTISARI.....	x
ABSTRACT	xi
BAB I. PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Batasan Masalah	4
1.4 Tujuan Penelitian	4
1.5 Manfaat Penelitian	4
1.6 Tinjauan Pustaka	4
1.7 Metode Penulisan	5
1.8 Sistematika Penulisan	6
BAB II. LANDASAN TEORI	
2.1 Investasi	7
2.2 Return	8

2.3	Risiko.....	11
2.4	Distribusi Normal	12
2.5	Distribusi Multivariat Normal	13
2.6	Distribusi Gamma.....	13
2.7	Distribusi Invers Gamma.....	15
2.8	Distribusi Student-T	17
2.9	Fungsi Bessel Turunan Ketiga.....	19
2.10	<i>Generalized Inverse Gaussian Distribution (GIG)</i>	19
2.11	<i>Generalized Hyperbolic Distribution (GH)</i>	19
2.12	<i>Maximum Likelihood Estimation (MLE)</i>	21
2.13	<i>Uji Kolmogorov-Smirnov</i>	22
2.14	Value at Risk	23
 BAB III. ESTIMASI VaR DENGAN <i>SKewed-T DISTRIBUTION</i>		
3.1	<i>Skewed-T Distribution</i>	26
3.2	VaR dengan <i>Skewed-T Distribution</i>	30
3.2.1	<i>Skewed-T Distribution</i> untuk skewness positif.....	31
3.2.1	<i>Skewed-T Distribution</i> untuk skewness negatif.....	32
 BAB IV. SIMULASI DATA DAN STUDI KASUS		
4.1	Simulasi Data	35
4.2	Studi Kasus	38
 BAB V. PENUTUP		
5.1	Kesimpulan	42
5.2	Saran	42
DAFTAR PUSTAKA.....		43