

Daftar Isi

Daftar Isi	x
Daftar Pustaka	x
1 Pendahuluan	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah	2
1.3 Batasan Masalah	2
1.4 Tujuan	3
1.5 Metodologi Penyelesaian Masalah	3
1.6 Sistematika Penulisan	4
2 Tinjauan Pustaka	6
2.1 Saham	6
2.2 <i>Return</i> Saham	7
2.3 Fungsi <i>Likelihood</i>	8
2.4 Fungsi Distribusi	9
2.4.1 Fungsi Distribusi Univariat	9
2.4.2 Fungsi Distribusi Bivariat	9
2.5 Ukuran Asosiasi	10
2.5.1 Koefisien Korelasi Pearson	10
2.5.2 Koefisien Korelasi <i>Kendall's Tau</i>	11
2.6 Teorema Sklar	12

<i>Daftar Isi</i>	2
2.7 Teori <i>Copula</i>	12
2.7.1 <i>Copula Gaussian</i>	13
2.7.2 <i>Copula Archimedean</i>	13
2.8 Portofolio	15
2.8.1 Portofolio Dua Aset	15
2.9 Karakteristik Ukuran Risiko	16
2.9.1 Standar Deviasi	17
2.9.2 <i>Value-at-Risk</i>	18
2.9.3 <i>VaR Violation</i>	19
3 Perancangan Sistem	20
3.1 Data	20
3.2 Alur Perancangan Sistem	21
4 Implementasi Hasil	23
4.1 Return Saham Honda dan Saham Toyota	23
4.2 Uji Kecocokan Distribusi	24
4.3 Model <i>Copula</i>	27
4.4 Value-at-Risk(VaR)	29
4.5 Violation VaR	33
5 Kesimpulan dan Saran	34
5.1 Kesimpulan	34
5.2 Saran	35
Daftar Pustaka	36
Lampiran 1 : Distribusi <i>t location-scale</i>	38
Lampiran 2 : Kode MATLAB	39