

## Daftar Gambar

3.1	Nilai Return Indeks Saham SP100 dan SP600 . . . . .	9
3.2	Flowchart Perancangan Sistem . . . . .	11
4.1	Uji kecocokan distribusi dengan histogram data return SP100 Normal . . . . .	14
4.2	Uji kecocokan distribusi dengan histogram data <i>return</i> SP100 <i>Student-t</i> . . . . .	15
4.3	Uji kecocokan distribusi dengan histogram data <i>return</i> SP600 Normal . . . . .	15
4.4	Uji kecocokan distribusi dengan histogram data <i>return</i> SP100 <i>Student-t</i> . . . . .	16
4.5	Plot tail dependence Model Copula Clayton Normal . . . . .	17
4.6	Plot tail dependence Model Copula Clayton Student-t . . . . .	18
4.7	Plot tail dependence Model Copula Gumbel Normal . . . . .	18
4.8	Plot tail dependence Model Copula Gumbel Student-t . . . . .	19
4.9	Grafik Nilai VaR Copula Clayton Normal dengan tingkat kesalah- lahan 10% . . . . .	19
4.10	Grafik Nilai VaR Copula Gumbel Normal dengan tingkat kesalah- lahan 10% . . . . .	20
4.11	Grafik Nilai VaR Copula Clayton Normal dengan tingkat kesalah- lahan 5% . . . . .	21
4.12	Grafik Nilai VaR Copula Gumbel Normal dengan tingkat kesalah- lahan 5% . . . . .	21
4.13	Grafik Nilai VaR Copula Clayton Normal dengan tingkat kesalah- lahan 1% . . . . .	22
4.14	Grafik Nilai VaR Copula Gumbel Normal dengan tingkat kesalah- lahan 1% . . . . .	23
4.15	Grafik Nilai VaR Copula Clayton Student-t dengan tingkat kesalah- lahan 10% . . . . .	23
4.16	Grafik Nilai VaR Copula Gumbel Student-t dengan tingkat kesalah- lahan 10% . . . . .	24
4.17	Grafik Nilai VaR Copula Clayton Student-t dengan tingkat kesalah- lahan 5% . . . . .	25

4.18	Grafik Nilai VaR Copula Gumbel Student-t dengan tingkat kesalahan 5%	25
4.19	Grafik Nilai VaR Copula Clayton Student-t dengan tingkat kesalahan 1%	26
4.20	Grafik Nilai VaR Copula Gumbel Student-t dengan tingkat kesalahan 1%	27