

# Daftar Isi

<b>Abstrak</b>	<b>i</b>
<b>Abstract</b>	<b>ii</b>
<b>Lembar Persembahan</b>	<b>iii</b>
<b>Kata Pengantar</b>	<b>v</b>
<b>Daftar Isi</b>	<b>vi</b>
<b>Daftar Gambar</b>	<b>viii</b>
<b>Daftar Tabel</b>	<b>x</b>
<b>I Pendahuluan</b>	<b>1</b>
1.1 Latar Belakang . . . . .	1
1.2 Perumusan Masalah . . . . .	2
1.3 Tujuan . . . . .	2
1.4 Rencana Kegiatan . . . . .	2
<b>II Kajian Pustaka</b>	<b>4</b>
2.1 Portofolio Saham . . . . .	4
2.1.1 Return Portofolio . . . . .	4
2.1.2 Return Saham . . . . .	4
2.2 Model GARCH . . . . .	5
2.3 Fungsi Distribusi Univariat dan Bivariat . . . . .	6
2.4 Copula . . . . .	6
2.4.1 Gaussian Copula . . . . .	6
2.4.2 Archimedian Copula . . . . .	7
2.5 Value-at-Risk (VaR) . . . . .	7
<b>III Metodologi dan Desain Sistem</b>	<b>9</b>
3.1 Analisis Data . . . . .	9
3.2 Alur Perancangan Sistem . . . . .	10

<b>IV Hasil Dan Pembahasan</b>	<b>12</b>
4.1 Fungsi Likelihood Model GARCH (1,1) . . . . .	12
4.2 Fitting Distribusi Marginal . . . . .	14
4.3 Copula . . . . .	16
4.4 Value-at-Risk (VaR) . . . . .	19
4.5 VaR Violation . . . . .	28
<b>V Kesimpulan dan Saran</b>	<b>29</b>
5.1 Kesimpulan . . . . .	29
5.2 Saran . . . . .	29
<b>Daftar Pustaka</b>	<b>30</b>
<b>Lampiran</b>	<b>31</b>