

Daftar Tabel

2.1	Keterangan Variabel model GARCH	5
3.1	Hasil Statistika Deskriptif	10
4.1	Parameter GARCH (1,1) SP100	13
4.2	Parameter GARCH (1,1) SP600	13
4.3	Hasil Parameter Fitting Distribusi Normal	14
4.4	Hasil Parameter <i>Fitting</i> Distribusi <i>Student-t</i>	15
4.5	Hasil Parameter <i>Fitting</i> Distribusi Normal	16
4.6	Hasil Parameter <i>Fitting</i> Distribusi <i>Student-t</i>	16
4.7	Hasil Parameter Copula	17
4.8	Nilai VaR Normal terhadap return portofolio pada hari ke 2609	27
4.9	Nilai VaR Student-t terhadap return portofolio pada hari ke 2609	28
4.10	Hasil Nilai VaR <i>Violation</i> dan Mean Error Normal	28
4.11	Hasil Nilai VaR <i>Violation</i> dan Mean Error Student-t	28