

Daftar Gambar

Gambar 3.1 Alur Perancangan Sistem prediksi <i>Value-at-Risk</i> menggunakan MS-ARCH.....	9
Gambar 3 2 Grafik Data Jakarta Composite Index	10
Gambar 4.1 Close Price Jakarta Composite Index	11
Gambar 4.2 Data Return Jakarta Composite Index.....	11
Gambar 4.3 Volatilitas Jakarta Composite Index.....	12
Gambar 4.4 Grafik <i>Return</i> dan VaR-MS-ARCH(0,1) Pada Tingkat Signifikansi 10%	17
Gambar 4.5 Grafik <i>Return</i> dan VaR-MS-ARCH(0,1) Pada Tingkat Signifikansi 5%	18
Gambar 4.6 Grafik <i>Return</i> dan VaR-MS-ARCH(0,1) Pada Tingkat Signifikansi 1%	19
Gambar 4. 7 Grafik <i>Return</i> dan VaR-MS-ARCH(1,1) Pada Tingkat Signifikansi 10%	20
Gambar 4. 8 Grafik <i>Return</i> dan VaR-MS-ARCH(1,1) Pada Tingkat Signifikansi 5%	21
Gambar 4. 9 Grafik <i>Return</i> dan VaR-MS-ARCH(1,1) Pada Tingkat Signifikansi 1%	22