

Daftar Isi

Abstrak	i
Abstract	ii
Lembar Persembahan	iii
Kata Pengantar	iv
Daftar Isi	v
Daftar Gambar	vii
Daftar Tabel	viii
I Pendahuluan	1
1.1 Latar Belakang	1
1.2 Perumusan Masalah	1
1.3 Tujuan	2
1.4 Batasan Masalah	2
II Kajian Pustaka	3
2.1 Saham	3
2.2 Return Saham	3
2.3 Uji Efek ARCH	4
2.4 Model AR(1)	5
2.5 Model GARCH(1,1)	6
2.6 Fungsi Likelihood	6
2.7 Value-at-Risk	10
2.8 VaR <i>Violation</i>	11
2.9 Tingkat <i>Error</i>	11
III Metodologi dan Desain Sistem	12
3.1 Deskripsi Sistem	12
3.2 Analisis Data	12
3.3 Flowchart Sistem	16

IV Hasil dan Pembahasan	17
4.1 Uji Efek ARCH: Data Riil	17
4.2 Model AR (1): Data Riil	17
4.3 Model GARCH (1,1): Data Riil	18
4.4 VaR: Data Riil	19
4.5 VaR <i>violation</i> dan <i>Mean Error</i> : Data Riil	23
V Kesimpulan	24
Daftar Pustaka	25
Lampiran	27