

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 |