

DAFTAR GAMBAR

Gambar 3.1	Hubungan Risiko dan Imbal Hasil.....	15
Gambar 3.2	VaR _{99%}	18
Gambar 3.3	Data kontinu dan data diskret.....	29
Gambar 3.4	Contoh gambar data homoscedastis.....	31
Gambar 3.5	Contoh gambar data heteroscedastis.....	31
Gambar 3.6	POT (<i>Peak Over Threshold</i>), dengan nilai batas u	40
Gambar 3.7	Model Kerangka Pemikiran.....	45
Gambar 4.1	Pergerakan IHSG dari tahun 1996 sampai Desember 2008	48
Gambar 4.2	Quantil-Quantil Plot.....	55
Gambar 5.1	Kurva IHSG dan LQ45 periode Juli 1994 sampai Juli 2009.....	61
Gambar 5.2	Kurva kurs IDR/USD periode Juli 1994 sampai Juli 2009.....	61
Gambar 5.3	Kurva Imbal Hasil (<i>return</i>) IHSG periode Juli 1994 sampai Juli 2009.....	63
Gambar 5.4	Kurva Imbal Hasil (<i>return</i>) LQ45 periode Juli 1994 sampai Juli 2009.....	63
Gambar 5.5	Kurva Imbal Hasil (<i>return</i>) kurs IDR/USD periode Juli 1994 sampai Juli 2009.....	64
Gambar 5.6	Kurva Imbal Hasil (<i>return</i>) IHSG, LQ45 dan kurs IDR/USD periode Juli 1994 sampai Juli 2009.....	64
Gambar 5.7	QQ-plot IHSG periode Juli 1994 sampai Juli 2009.....	68
Gambar 5.8	QQ-plot Imbal Hasil IHSG periode Juli 1994 sampai Juli 2009.....	68

Gambar 5.9	QQ-plot LQ45 periode Juli 1994 sampai Juli 2009.....	69
Gambar 5.10	QQ-plot Imbal Hasil LQ45 periode Juli 1994 sampai Juli 2009.....	69
Gambar 5.11	QQ-plot Kurs IDR/USD periode Juli 1994 sampai Juli 2009.....	70
Gambar 5.12	QQ-plot Imbal Hasil Kurs IDR/USD periode Juli 1994 sampai Juli 2009.....	70
Gambar 5.13	VaR IHSG model EWMA 1 – 5 – 10 – 25 hari Keyakinan 99%.....	87
Gambar 5.14	VaR LQ45 model EWMA 1 – 5 – 10 – 25 hari Keyakinan 99%.....	88
Gambar 5.15	VaR Kurs IDR/USD model EWMA 1 – 5 – 10 – 25 hari Keyakinan 99%.....	88
Gambar 5.16	VaR IHSG model EWMA Harian Keyakinan 90% – 95% - 99%.....	89
Gambar 5.17	VaR IHSG dan LQ45 model EWMA Harian Keyakinan 99%.....	90
Gambar 5.18	VaR IHSG model EWMA, GARCH(1,1) dan EVT POT Harian Keyakinan 99%.....	90
Gambar 5.19	VaR LQ45 model EWMA, GARCH(1,1) dan EVT POT Harian Keyakinan 99%.....	91
Gambar 5.20	VaR Kurs IDR/USD model EWMA, GARCH(1,1) dan EVT POT Harian Keyakinan 99%.....	91

Gambar 5.21 Dana Antisipasi Risiko Investasi pada LQ45 sebesar IDR 500 Milyar Menurut Amandemen Basel 1996, Periode 10 hari, Keyakinan 99%.....	96
Gambar 5.22 Dana Antisipasi Risiko Kurs dalam Transaksi IDR 500 Milyar Menurut Amandemen Basel 1996, Periode 10 hari, Keyakinan 99%.....	97

