

DAFTAR PUSTAKA

- Agustini, S. W., Hadijati, M. dan Fitriyani, N. (2019). Analisis Dependensi Faktor Makroekonomi terhadap Tingkat Harga Emas Dunia dengan Pendekatan Copula. *Eigen Mathematics Journal*, 2(2), 82-91.
- Anaviroh dan Effendie, A. R. (2015). Pemodelan Copula Clayton untuk Prediksi Klaim pada Data Longitudinal dengan Excess Zeros. *Unisda Journal Mathematics and Computer Science*, 1(10), 1-10.
- Best, P. (1998). *Implementing Value at Risk*. John Wiley & Sons Ltd, Chichester.
- Chvosta, J., Erdman, D. J. dan Little, M. (2011). Modeling Financial Risk Factor Correlation with the Copula Procedure. *SAS Global Forum 2011 Statistics and Data Analysis*, 1-14.
- Damayanti. (2018). *Estimasi Nilai Conditional Value at Risk Menggunakan Fungsi Archimedian Copula*. Skripsi: Universitas Islam Negeri Alaudin, Makassar.
- Fauzan, H. A. (2022). Adaro (ADRO) Vs. Bukit Asam (PTBA), Saham Batu Bara Mana yang Lebih Menarik?. *Bisnis.Com*. <https://market.bisnis.com/read/20220307/189/1507828/adaro-adro-vs-bukit-asam-ptba-saham-batu-bara-mana-yang-lebih-menarik>.
- Handini, J. A., Maruddani, D. A. I. dan Safitri, D. (2018). Copula Frank pada Value at Risk (VaR) Portofolio Bivariat. *Jurnal Gaussian*, 7(3), 293-302.
- Ismanto, H. (2016). Analisis Value at Risk dalam Pembentukan Portofolio Optimal (Studi Empiris pada Saham-Saham yang Tergabung dalam LQ45). *Publikasi Ilmiah UMS*, 243-255.
- Jorion, P. (2007). *Value at Risk: The New Benchmark for Managing Financial Risk, Third edition*. McGraw-Hill, New York.
- Mashuri. (2013). Backtesting pada Value at Risk dengan Model Pendekatan Lopez dan Blanco-Ihle. *Jurnal Konvergensi*, 3(2), 1-8.
- Matoviany, M. A. dan Firmansyah, A. (2021). Kepemilikan Investasi Obligasi Perusahaan Perbankan di Indonesia: Dampak Penerapan PSAK 71. *Jurnal Financial and Tax*, 1(1), 11-32.
- Mudjiyono. (2012). Investasi dalam Saham & Obligasi dan Meminimalisasi Risiko Sekuritas pada Pasar Modal Indonesia. *Jurnal STIE Semarang*, 4(2), 1-18.

- Munira, M., Merawati, E. E. dan Astuti, S. B. (2018). Pengaruh ROE dan DER terhadap Harga Saham Perusahaan Kertas di Bursa Efek Indonesia. *Journal of Applied Business and Economics*, 4(3), 191-205.
- Nelsen, R. B. (2006). *An Introduction to Copulas*. Springer, New York.
- Ningrum, O. W., Tarno dan Maruddani, D. A. I. (2017). Perhitungan Value at Risk pada Portofolio Saham Menggunakan Copula. *Jurnal Gaussian*, 6(2), 231-240.
- Pradana, D. C., Maruddani, D. A. I. dan Yasin, H. (2015). Penggunaan Simulasi Monte Carlo untuk Pengukuran Value at Risk Aset Tunggal dan Portofolio dengan Pendekatan Capital Asset Pricing Model sebagai Penentu Portofolio Optimal (Studi Kasus: Index Saham Kelompok SMinfra18). *Jurnal Gaussian*, 4(4), 765-774.
- Prihatiningsih, D. R., Maruddani, D. A. I. dan Rahmawati, R. (2020). Value at Risk (VaR) dan Conditional Value at Risk (CVaR) dalam Pembentukan Portofolio Bivariat Menggunakan Copula Gumbel. *Jurnal Gaussian*, 9(3), 326-335.
- Saputri, A. G., Suharsono, A. dan Haryono. (2019). Analisis Value at Risk pada Investasi Saham Blue Chips dengan Pendekatan Copula. *Jurnal Sains dan Seni ITS*, 8(2), 200-205.
- Sofwan, I. A., Rusgiyono, A. dan Suparti. (2014). Analisis Nilai Risiko (Value at Risk) Menggunakan Uji Kejadian Bernoulli (Bernoulli Coverage Test) (Studi Kasus pada Indeks Harga Saham Gabungan). *Jurnal Gaussian*, 3(2), 233-242.
- Syariah dan Pratiwi, N. (2020). Pengukuran Value at Risk (VaR) Portofolio Optimal pada Investasi Saham Bank Badan Usaha Milik Negara (BUMN) Menggunakan Metode Varian-Covarian dan Metode Simulasi Monte Carlo. *Jurnal Statistika Industri dan Komputasi*, 5(1), 1-10.
- Udayani, L. G., Sumarjaya, I. W. dan Susilawati, M. (2016). Analisis Hubungan Produksi Padi dan Indikator Enso di Kabupaten Tabanan dengan Pendekatan Copula. *E-Jurnal Matematika*, 5(4), 164-169.
- Yulia. (2016). Analisis Pengaruh Rasio Likuiditas terhadap Return Saham. *Jurnal Khatulistiwa Informatika*, 4(2), 192-204.