

DAFTAR PUSTAKA

- Awais, M., & Laber, M. F. (2016). Impact of Financial Literacy and Investment Experience on Risk Tolerance and Investment Decisions: Empirical Evidence from Pakistan. *International Journal of Economics and Financial Issues*, 73-79.
- Conlon, T., & McGee, R. (2020). *Safe Haven Or Risky Hazard? Bitcoin During The Covid-19 Bear Market*. Finance Research Letter.
- Dede Riyaldi, R. B. (2020). PENENTUAN PROPORSI OPTIMAL ASET KEUANGAN. *Biostatistics: Jurnal Statistika Teori dan Aplikasi: Biomedics, Industry & Business And Social* , 39-52.
- Hadinata, S. (2018). Tingkat Pengembalian (Return), Risiko, dan Koefisien Variasi pada Saham Syariah dan Saham Nonsyariah. *Aktsar: Jurnal Akuntansi Syariah*, 171 -186.
- Iriani, N. P., & Akbar, M. S. (2013). Estimasi Value at Risk (VaR) pada Portofolio Saham dengan Copula. *JURNAL SAINS DAN SENI POMITS*, 2337-3520.
- Jondeau, E., & Rockinger, M. (2006). The Copula-GARCH of Conditional Dependencies: An International Stock Market Application. *Journal of International Money and Finance*, 827-853.
- Lusia, N., & Satyahadewi, N. (2021). PERHITUNGAN VALUE AT RISK PORTOFOLIO PADA FUNGSI ARCHIMEDEAN COPULA. *Buletin Ilmiah Mat. Stat. dan Terapannya (Bimaster)*, 175 – 184.
- Mardhiyah, A. (2017, April). PERANAN ANALISIS RETURN DAN RISIKO DALAM INVESTASI. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis*, 2, 1-17.
- Maruddani, D., & Purbowati, A. (2009, Desember). PENGUKURAN VALUE AT RISK PADA ASET TUNGGAL DAN PORTOFOLIO DENGAN SIMULASI MONTE CARLO. *Media Statistika*, 2, 93-104.
- Maulana, D., & Dharmawan, K. (2022). ESTIMASI CVAR PADA PORTOFOLIO SAHAM MENGGUNAKAN METODE GJR-EVT DENGAN PENDEKATAN D-VINE COPULA. *E-Jurnal Matematika*, 127-139.
- Mazid, A., & Listyaningsih, E. (2022). DAMPAK PANDEMI COVID-19 TERHADAP RETURN SAHAM SEKTOR PROPERTY DAN REAL ESTATE YANG

- TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA PERIODE 2020. *Jurnal Manajemen Universitas Bung Hatta*, 43-51.
- Pangestika, R., Novita, M., & Nurrohmah, S. (2018). Application Of Credible Value at Risk in Predicting Indonesia's Stock Market Return. *Journal of Physics: Conference Series*.
- Prasetyo, D. D., & Sudjati, I. L. (2018). Value at-Risk Modeling on Stock Return with Exogenous Variables using ARMAX-GARCHX Approach. *International Conference on Statistics, Mathematics, Teaching, and Research*.
- Quesada, M., & Jose, J. (2003). What are Copula. *Monografias de Semin, Matem*, 499-506.
- Rahayu, A., & Haq, S. (2021). SARANA DAN PRASARANA DALAM Mendukung Pembelajaran dan Riset pada Masa Pandemi COVID-19. *Jurnal Inspirasi Manajemen Pendidikan*, 09, 186-199.
- Saputri, G., & Suharsono, A. (2019). Analisis Value at Risk (VaR) pada Investasi Saham Blue Chips dengan Pendekatan Copula. *JURNAL SAINS DAN SENI ITS*, 8, D200-D205.
- Scholzel, C., & Friederichs, P. (2008). Multivariate non-normally distributed random variables in climate research – introduction to the copula approach. *Nonlin. Processes Geophys*, 761–772.
- Seto Aprilianto, A. E. (2020). BACKTESTING SIMULASI MONTE CARLO DALAM MENGHITUNG VALUE AT.
- Šoja, T., & Senarathne, C. W. (2019). Bitcoin In Portfolio Diversification: The Perspective Of A Global Investor. *Bankarstvo*.
- Tambunan, D. (2020). Investasi Saham di Masa Pandemi COVID-19. *Widya Cipta: Jurnal Sekretari dan Manajemen*, 117-123.
- Taskinsoy, J. (2022). Stress Testing Financial Systems : Macro and Micro Stress Tests, Basel Standards and Value-at-Risk as Financial Stability Measures.
- Wira, I., & Fajrin, A. (2021). DAMPAK PENERAPAN PEMBATAAN SOSIAL BERSKALA BESAR (PSBB) TERHADAP PENGHIDUPAN PEKERJA SEKTOR INFORMAL DI PROVINSI DKI JAKARTA. *Jurnal Pemerintahan dan Keamanan Publik (JP dan KP)*, 68-79.

Zhang, Y., & Nadarajah, S. (2022). A Review of Backtesting For Value at Risk. *Communications in Statistics-Theory and Methods*.

Zuhra, F. (2022). ESTIMASI NILAI RETURN PORTOFOLIO SAHAM LQ-45 DAN JII DENGAN METODE COPULA GAUSSIAN. *Indonesian Journal of Business Economics and Management*, 11-18.