

DAFTAR PUSTAKA

- Akbar, I., Dharmawan, K. & Asih, N. M. (2019). Aplikasi Metode Rotated Gumbel Copula untuk Mengestimasi Value at Risk pada Indeks Saham Pasar Asia. *E-Jurnal Matematika*. 8(3), 211-216.
- Anam, K., Maruddani, D. A. I., & Kartikasari, P. (2020). Pengukuran Value at Risk pada Portofolio Obligasi dengan Metode Varian-Kovarian. *Jurnal Gaussian*. 9(4), 434-443.
- Astuti, I., Burhanudin, B., & Suryawati, B. N. (2020). Analisis Risiko Portofolio dengan Menggunakan Metode Simulasi Monte Carlo. *Distribusi-Journal of Management and Business*, 8(1), 105–124.
- Christova, R., Satyahadewi, N. & Rizki, S. R. (2022). Analisis Value at Risk pada Portofolio Saham dengan Student T-Copula. *Buletin Ilmiah Mat. Stat. dan Terapannya (Bimaster)*. 11(3), 461-468.
- Firdaus, S., Azmi, U. & Siswono, G. O. (2022). Pengukuran Value at Risk Portofolio Saham Optimal Menggunakan Copula-Garch dengan Pendekatan Single Index Model. *Jurnal Sains dan Seni ITS*. 11(6), 351-357.
- Hadinata, S. (2018). Tingkat Pengembalian (*Return*), Risiko, dan Koefisien Variasi pada Saham Syariah dan Saham Nonsyariah. *AKTSAR : Jurnal Akutansi Syariah*. 1(2), 171-186.
- Haugh, M. (2016). Model Risk. *IEOR E4602: Quantitative Risk Management*, 1-21.
- Hidayat, D. (2023). Pengaruh Dividend Per Share, Earning Per Share, dan Price Earning Ratio terhadap Harga Saham. *BanKu: Jurnal Perbankan dan Keuangan*. 4(1), 1-10.
- Hidayati, H., Dharmawan, K., & Sumarjaya, I. W. (2015). Estimasi Nilai Conditional Value at Risk Menggunakan Fungsi Gaussian Copula. *E-Jurnal Matematika*. 4(4), 188-194.
- Indarwati, E. & Kusumawati, R. (2021). Aplikasi Metode Simulasi Monte Carlo untuk Menghitung VaR dan CVaR pada Saham PT. Bank Negara Indonesia (Persero) TBK dan PT. Bank Tabungan Negara (Persero) TBK. *Jurnal Matematika, Statistika & Komputasi*. 17(3), 370-380.
- Khairiati, A., Budiarti, R. & Purnaba, I. G. P. (2022). Perbandingan Analisis Regresi Linear dengan Analisis Regresi Copula pada Data Keuangan. *Jambura Journal of Mathematics*. 4(2), 209-219.
- Maronrong, R., Hermasturi, P., & Muntahak, S. M. I. A. A. (2022). Analisis Value at Risk untuk Keputusan Interval Menggunakan Simulasi Historis. *Jurnal Akuntansi STEI*. 5(2), 21-30.
- Maruddani, D. A. I. (2019). Value at Risk untuk Pengukuran Risiko Investasi Saham: *Aplikasi dengan Program R*. Ponorogo: Wade Group.
- Mulyani, S. S. S., Jamaluddin, J., & Huda, B. (2021). Pengaruh Earning Per Share dan Bi-7 Day Reverse Repo Rate Terhadap Harga Saham PT Bank Tabungan Negara (Persero) Tbk Periode 2016-2020. *Jurnal Dimamu*. 1(1), 61-69.
- Ningrum, O. W., Tarno & Maruddani, D. A. I. (2017). Perhitungan Value at Risk pada Portofolio Saham Menggunakan Copula. *Jurnal Gaussian*. 6(2), 231-240.

- Ningsih, S. & Arsal, A. (2022). Penerapan Simulasi Monte Carlo untuk Pengukuran *Value at Risk (VaR)*. *Research in the Mathematical and Natural Sciences*. 1(2), 8-16.
- Prihatiningsih, D. R., Maruddani, D. A. I. & 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.
- Reilly, F. K., & Norton, E. A. (2007). *Investments*. Mason, Ohio: Thomson/South-Western
- Saputri et al. (2020). Analisis Value at Risk (VaR) pada Investasi Saham Blue Chips dengan Pendekatan Copula. *Jurnal Sains dan Seni ITS*. 8(2), 200-205.
- Sartika, Q. R., Widiyarih, T. & Mukid, M. A. (2019). *Value at Risk in Stock Portofolio Using T-Copula: Case Study of PT. Indofood Sukses Makmur, Tbk. and Bank Mandiri (Persero)*, Tbk. *Media Statistika*, 12(2), 175-187.
- Sudina, N. W. U. Y. A., Dharmawan, K. & Sumarjaya I. W. (2019). Estimasi Nilai Conditional Value at Risk (CVaR) Portofolio Menggunakan Metode EVT-GJR-VINE Copula. *E-Jurnal Matematika*. 8(1), 15-26.
- Tambunan, D. (2020). Investasi Saham di Masa Pandemi COVID-19. *Widya Cipta: Jurnal Sekretari dan Manajemen*. 4(2), 117-123.