

DAFTAR PUSTAKA

- Abidin, S. and Jaffar, M.M. 2014 Forecasting Share Prices of Small Size Companies in Bursa Malaysia. *Applied Mathematics and Information Sciences*, 8, 107-112.
- Adrianto, A. D., Azhari, M., dan Khairunnisa, K. 2017. Analisis Perhitungan Value At Risk (var) Dengan Metode Historis, Dan Monte Carlo Serta Penerapannya Dalam Sub Sektor Rokok (studi Kasus Pada Saham Gudang Garam, Dan Hm Sampoerna). *eProceedings of Management*, 4(2).
- Agustini, W. F., Affianti, I. R., dan Putri, E. R. 2018. Stock price prediction using geometric Brownian motion. In *Journal of physics: conference series* (Vol. 974, No. 1, p. 012047). IOP Publishing.
- Aryawati, N. P. A. 2006. Manajemen keuangan. Penerbit Tahta Media Group.
- Badriah, N., Siti Nazifah, Z. A., & Maheran, M. J. 2018. Forecasting Share Prices Accurately For One Month Using Geometric Brownian Motion. *Pertanika Journal of Science & Technology*, 26(4).
- Bain, L.J dan M. Engelhardt. 1992. Introduction to Probability and Mathematical Statistics 2nd Edition. California. Duxbury Press.
- Bursa Efek Indonesia. 2021. *BBCA Annual Report 2021*. BEI. Jakarta.
- Croghan, J., Jackman, J. K., dan Min, K. J. 2017. Estimation of geometric Brownian motion parameters for oil price analysis.
- Danielsson, J. 2011. Financial risk forecasting: The theory and practice of forecasting market risk with implementation in R and Matlab. Vol. 558, John Wiley & Sons.
- Darmadji, T. F. 2012. Pasar Modal Di Indonesia. Edisi Ketiga. Jakarta: Salemba Empat. *International Journal of Business and Commerce*, 4(02).

- Dempster, M. A. H. 2002. Risk Management: Value at Risk and Beyond. Cambridge University Press.
- Dhone, B. 2010. Peramalan Jumlah Pengunjung Objek Wisata Kebun Raya Cibodas Dengan Metode Dekomposisi (Doctoral dissertation, Universitas Pendidikan Indonesia).
- Dmouj, A. 2006. Stock price modelling: Theory and Practice. *Masters Degree Thesis, Vrije Universiteit*.
- Fama, E. 2007. Random walks in stock market prices. *Financial Analysis Journal* 51(1): 75-80.
- Fitria, I., Handayati, K. N., dan Hasanah, P. 2021. The application of Geometric Brownian Motion in stock forecasting during the coronavirus outbreak in Indonesia. In *Journal of Physics: Conference Series* (Vol. 1821, No. 1, p. 012008). IOP Publishing.
- Ginting, R. 2007. Sistem Produksi (Edisi pertama). Yogyakarta: Graha ilmu
- Harianto, F dan Siswanto, S. 1998. Perangkat dan Teknik Analisis Investasi di Pasar Modal Indonesia. Jakarta: PT. Bursa Efek Jakarta.
- Heizer, J., dan Render, B. 2009. Operation Management. Buku 1. Jakarta: Salemba Empat.
- Hendricks, D. 1996. Evaluation of value-at-risk models using historical data. *Economic policy review*, 2(1).
- Hull, J. C. 2009. Option, Futures, and Other Derivatives Seventh Edition. New Jersey: Pearson Education.
- Husnan, S. 2005. Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas. Edisi keempat. Yogyakarta: UPP AMD YKPN.
- Jorion, P. 2007. Value at Risk: the new benchmark for managing financial risk (3rd ed.). New York: McGraw-Hill.

- Kustodian Sentral Efek Indonesia. 2021. *Statistik Pasar Modal Indonesia*. Desember. KSEI. Jakarta.
- Lawrence, K. D., Klimberg R. K., dan Lawrence S. M. 2009. *Fundamentals of forecasting using excel*. Washington : Industrial Press Inc.
- Makridakis, S. 1993. *Metode dan Aplikasi Peramalan*. Jakarta: Airlangga.
- Maruddani, D.A.I. dan Purbowati, A. 2009. Pengukuran Value At Risk pada Aset Tunggal dan Portofolio dengan Simulasi Monte Carlo. *Media Statistika*. Vol 2(2), 93-104.
- Otoritas Jasa Keuangan. 2019. *Statistika Pasar Modal 2019*. OJK. Jakarta.
- 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(01), 1-10.
- Purnaningrum, E. 2018. Renewable Stock Price Model Sebagai Pendukung Investasi Saham: Studi Kasus Saham JII. *KOLEGIAL*, 6(2), 97-110.
- Purnomo, D. Y. 2008. Pengaruh ukuran perusahaan, pertumbuhan aktiva dan profitabilitas terhadap hutang dan pengaruh hutang terhadap return saham (Studi Kasus Pada Perusahaan Manufaktur Go Public di Bursa Efek Jakarta Tahun 2001–2006) (Doctoral dissertation, UNS (Sebelas Maret University)).
- Reddy, K., dan Clinton, V. 2016. Simulating stock prices using geometric Brownian motion: Evidence from Australian companies. *Australasian Accounting, Business and Finance Journal*, 10(3), 23-47.
- Ross, J. V. 2010. Computationally exact methods for stochastic periodic dynamics: Spatiotemporal dispersal and temporally forced transmission. *Journal of theoretical biology*, 262(1), 14-22.

- Ruppert, D. 2011. *Statistics and Data Analysis for Financial Engineering*. New York: Springer.
- Sa'diah, A. 2021. Penerapan Geometric Brownian Motion pada peramalan nilai tukar rupiah terhadap dolar Amerika Serikat. Doctoral dissertation, Universitas Islam Negeri Maulana Malik Ibrahim.
- Situngkir, H. 2006. Value at Risk yang memperhatikan sifat statistika distribusi return.
- Sofwan, I. A., Rusgiyono, A., dan Suparti, S. 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.
- Susilawati, C. D. K. 2012. Analisis Perbandingan Pengaruh Likuiditas, Solvabilitas, dan Profitabilitas Terhadap Harga Saham pada Perusahaan LQ 45. *Jurnal Akuntansi*, 4(2), 165-174.
- Tersine, R. J. 1994. *Principles of inventory and materials management*.
- Toby, A. J., dan Agbam, S. A. 2021. Stochastic Forecasting of Stock Prices in Nigeria: Application of Geometric Brownian Motion Model. *International Journal of Finance*, 6(2), 1-35.
- Trimono, T., Di Asih, I. M., dan Ispriyanti, D. 2017. Pemodelan Harga Saham Dengan Geometric Brownian Motion Dan Value At Risk PT Ciputra Development Tbk. *Jurnal Gaussian*, 6(2), 261-270.
- Tsay, R.S. 2006. *Analysis of Financial Time Series*. Financial Econometrics, University of Chicago.
- Tupan, L. P., Manurung, T., dan Prang, J. D. 2013. Pengukuran Value at Risk pada Aset Perusahaan dengan Metode Simulasi Monte Carlo. *Jurnal MIPA*, 2(1), 5-11.

- Zakia, H. I. 2017. Prediksi Harga Komoditas Minyak Mentah Menggunakan Model Geometric Brownian Motion (Doctoral dissertation, Institut Teknologi Sepuluh Nopember).
- Otoritas Jasa Keuangan. 2019. *Statistika Pasar Modal 2019*. OJK. Jakarta.
- Dhone, B. 2010. Peramalan Jumlah Pengunjung Objek Wisata Kebun Raya Cibodas Dengan Metode Dekomposisi (Doctoral dissertation, Universitas Pendidikan Indonesia).
- Fama, E. 2007. Random walks in stock market prices. *Financial Analysis Journal* 51(1): 75-80.
- Purnaningrum, E. 2018. Renewable Stock Price Model Sebagai Pendukung Investasi Saham: Studi Kasus Saham JII. *KOLEGIAL*, 6(2), 97-110.
- Jorion, P. 2007. Value at Risk: the new benchmark for managing financial risk (3rd ed.). New York: McGraw-Hill.
- Adrianto, A. D., Azhari, M., dan Khairunnisa, K. 2017. Analisis Perhitungan Value At Risk (var) Dengan Metode Historis, Dan Monte Carlo Serta Penerapannya Dalam Sub Sektor Rokok (studi Kasus Pada Saham Gudang Garam, Dan Hm Sampoerna). *eProceedings of Management*, 4(2).
- Agustini, W. F., Affianti, I. R., dan Putri, E. R. 2018. Stock price prediction using geometric Brownian motion. In *Journal of physics: conference series* (Vol. 974, No. 1, p. 012047). IOP Publishing.
- Purnomo, D. Y. 2008. Pengaruh ukuran perusahaan, pertumbuhan aktiva dan profitabilitas terhadap hutang dan pengaruh hutang terhadap return saham (Studi Kasus Pada Perusahaan Manufaktur Go Public di Bursa Efek Jakarta Tahun 2001–2006) (Doctoral dissertation, UNS (Sebelas Maret University)).

- Susilawati, C. D. K. 2012. Analisis Perbandingan Pengaruh Likuiditas, Solvabilitas, dan Profitabilitas Terhadap Harga Saham pada Perusahaan LQ 45. *Jurnal Akuntansi*, 4(2), 165-174.
- Ruppert, D. 2011. *Statistics and Data Analysis for Financial Engineering*. New York: Springer.
- Ross, J. V. 2010. Computationally exact methods for stochastic periodic dynamics: Spatiotemporal dispersal and temporally forced transmission. *Journal of theoretical biology*, 262(1), 14-22.
- Dmouj, A. 2006. Stock price modelling: Theory and Practice. *Masters Degree Thesis, Vrije Universiteit*.
- Abidin, S. and Jaffar, M.M. 2014 Forecasting Share Prices of Small Size Companies in Bursa Malaysia. *Applied Mathematics and Information Sciences*, 8, 107-112.
- Maruddani, D.A.I. dan Purbowati, A. 2009. Pengukuran Value At Risk pada Aset Tunggal dan Portofolio dengan Simulasi Monte Carlo. *Media Statistika*. Vol 2(2), 93-104.
- Danielsson, J. 2011. *Financial risk forecasting: The theory and practice of forecasting market risk with implementation in R and Matlab*. Vol. 558, John Wiley & Sons.
- Jorion, P. 2007. *Value at Risk: the new benchmark for managing financial risk* (3rd ed.). New York: McGraw-Hill.