

DAFTAR PUSTAKA

- Abdullah, S., Susilo, S., Ula, S., Aswata, Valentika, N., & Chasanah, S. I. (2020). Algoritma Membangkitkan Proses Poisson Majemuk dengan Komponen Proses Poisson Nonhomogen Fungsi Linier dan Komponen Berdistribusi Eksponensial. *Statmat (Jurnal Statistika dan Matematika)*, 81-93.
- Abdurakhman, & Maruddani, D. A. (2018). Pengaruh Skewness dan Kurtosis dalam Model Valuasi Obligasi. *Media Statistika*, 39 - 51.
- Aniska, M., Maruddani, D. A., & Suparti. (2020). Valuasi One Period Coupon Bond dengan Aset Mengikuti Model Geometric Brownian Motion with Jump Diffusion. *Indonesian Journal Of Applied Statistics*, 94 - 108.
- Binekasri, R. (2022, Juni 27). *Top! Jumlah Investor RI 9 Juta Lebih, Mayoritas Anak Muda*. Retrieved from CNBC Indonesia: <https://www.cnbcindonesia.com/market/20220627162829-17-350749/top-jumlah-investor-ri-9-juta-lebih-mayoritas-anak-muda>
- Bjerring, T. T. (2019, November 04). *Portfolio Optimization using Conditional Value at Risk*. Retrieved from Bjerring.github: <https://bjerring.github.io/equity/2019/11/04/Portfolio-Optimization-using-CVaR.html>
- Ditasari, P., Rohaeti, E., & Kamila, I. (2022). Aplikasi Geometric Brownian Motion dengan Jump Diffusion dalam Memprediksi Harga Saham Liquid Quality 45. *EULER: Jurnal Ilmiah Matematika, Sains dan Teknologi*, 111-119.
- Fika, N. (2022). Penentuan Value At Risk Saham PT Telkom Indonesia Tbk Menggunakan Model Jump Diffusion Pada Simulasi Monte Carlo. *Skripsi*.
- Herrhyanto, N., & Gantini, T. (2009). *Pengantar Statistika Matematis*. Bandung: Yrama Widya.
- Hidayati, M.Pd, T., Handayani, I., & Iksari, I. H. (2019). *Statistika Dasar*. Puewokerto: CV. Pena Persada.
- Jaadhav, D., T. V. ramanathan, & Nimbalkar, U. (2009). Modified Estimators of the Expected Shortfall. *Journal of Emerging Market Finance*, 87 - 107.
- Koor, A., & Page, B. (2012). Transfer And Generalisation Of Financial Risk Metrics To Discrete Event Simulation.
- Lidwina, A. (2021, Juni 27). *Tren Harga Saham Unilever Menurun Sejak Awal 2021*. Retrieved from databoks:

<https://databoks.katadata.co.id/datapublish/2021/06/27/tren-harga-saham-unilever-menurun-sejak-awal-2021>

- Ilyas, I. A., Puspita, E., & Rachmatin, D. (2018). Prediksi Harga Saham Menggunakan Model Jump Diffusion. *Eurekamatika*, 33 - 42.
- Maruddani, D. (2018). Pengaruh Data Ekstrim Aset Perusahaan Pada Valuasi Obligasi. *Seminar Nasional Variansi 2018*.
- Maruddani, D. A., & Trimono. (2017). Prediksi Harga Saham Pt. Astra Agro Lestari Tbk. Dengan Jump Diffusion Model. *JRAMB*, 57 - 67.
- Melani, A. (2021, Oktober 07). *Saham UNVR Paling Aktif Ditransaksikan Pada 7 Oktober 2021*. Retrieved from Liputan 6: <https://www.liputan6.com/saham/read/4678554/saham-unvr-paling-aktif-ditransaksikan-pada-7-oktober-2021>
- Nikasari, N., Dharmawan, K., & Srinadi, I. (2017). Estimasi Nilai Average Value At Risk Pada Saham Portofolio dengan Menggunakan Metode Analisis Komponen Utama. *E-Jurnal Matematika*, 56 - 64.
- Nurhayati. (2019). Pemodelan Matematika Laju Aliran Panas Pada Wajan Pembuatan Arang Aktif-13 dengan menggunakan Metode Beda Hingga (Finite Difference method). *SN-SMIAP*, 125-130.
- Prihatiningsih, D. R., Maruddani, D. A., & Rahmawati, R. (2020). Value at Risk dan Conditional Value at Risk (CVAR) dalam Pembentukan Portofolio Bivariat Menggunakan Copula Gumbel. *Jurnal Gaussian*, 326 -335.
- Purnomo, H. (2017). *Manajemen Operasi*. Yogyakarta: CV. Sigma.
- Purwanti, T. (2022, Maret 28). *Harga Saham Terus Turun, Direktur UNVR Justru Borong Saham*. Retrieved from CNBC Indonesia: <https://www.cnbcindonesia.com/market/20220328181831-17-326685/harga-saham-terus-turun-direktur-unvr-justru-borong-saham>
- Putri, A. M. (2022, September 06). *Terbaru! Ini 10 Saham Dengan Market Cap Terbesar di RI*. Retrieved from CNBC Indonesia: <https://www.cnbcindonesia.com/market/20220906132216-17-369712/terbaru-ini-10-saham-dengan-market-cap-terbesar-di-ri>
- Putri, C. N. (2022). Peramalan Harga Saham Subsektor Perbankan Menggunakan Metode Geometric Brownian Motion (GBM) dan Estimasi Value At Risk (VaR). *Skripsi*.
- Rahmawati, R., Rusgiyono, A., Hoyyi, A., & Maruddani, D. A. (2019). Expected Shoerfall dengan Simulasi Monte Carlo untuk Mengukur Risiko Kerugian Petani Jagung. *Media Statistika*, 117 - 128.

- Ramadhani, P. I. (2022, November 03). *Mengintip Prospek Saham Unilever Usai Rilis Laporan Keuangan Kuartal III 2022*. Retrieved from Liputan 6: <https://www.liputan6.com/saham/read/5114949/mengintip-prospek-saham-unilever-usai-rilis-laporan-keuangan-kuartal-iii-2022>
- Ratnawati, T., Aprilianto, D., & Luqyana, I. (2020). Kecerdasan Finansial Calon Investor LQ-45. *JEB17 (Jurnal Ekonomi & Bisnis)*, 60 - 66.
- Rizani, N. F., Mustafid, & Suparti. (2019). Penerapan Metode Expected Shortfall pada Pengukuran Risiko Investasi saham dengan Volatilitas Model Garch. *Jurnal Gaussian*, 184 - 193.
- Saepudin, Y., Yasin, H., & Santoso, R. (2017). Analisis Risiko Investasi Saham Tunggal Syariah dengan Value at Risk (VaR) dan Expected Shortfall (ES). *Jurnal Gaussian*, 271 - 280.
- Setyawan, G. R. (2009). Model Pergerakan Harga Saham Menggunakan Random Walk dan Gerak Brown. *Skripsi*.
- Situmorang, P. (2022, Oktober 31). *Saham Unilever (UNVR) ARB, Apa Penyebabnya?* Retrieved from investor: <https://investor.id/market-and-corporate/311424/saham-unilever-unvr-arb-apa-penyebabnya>
- Situngkir, H. (2006). Value At Risk Yang Memperhatikan Sifat Statistika Distribusi Return. *MPRA (Munich Personal RePEc Archive)*, 1-10.
- Trimono, & Maruddani, D. A. (2017). Valuasi Harga Saham PT Aneka Tambang Tbk sebagai Peraih IDX Best Blue 2016. *Statistika*, 33 – 43.
- Trimono, Maruddani, D. A., & Ispriyanti, D. (2017). Pemodelan Harga Saham Dengan Geometric Brownian Motion Dan Value At Risk Pt Ciputra Development Tbk. *Jurnal Gaussian*, 261-270.
- Trimono, Maruddani, D., & Ispriyanti, D. (2017). Pemodelan Harga Saham dengan Geometric Brownian Motion dan Value At Risk PT Ciputra Development Tbk. *Jurnal Gaussian*, 261 - 270.
- Utama, R. E., Gani, N. A., Jaharuddin, & Priharta, A. (2019). *Manajemen Operasi*. Jakarta: UM Jakarta Press.
- Utami, R., Respatiwan, & siswanto. (2017). Proses Poisson Majemuk dan Penerapannya pada Penentuan Ekspektasi Jumlah Penjualan Saham PT Sri Rejeki Isman Tbk. *Makalah*, 1 - 10.
- Wijayanti, R. I. (2022, Juni 06). *7 Perusahaan FMCG Terbesar di Indonesia, Apa Saja?* Retrieved from IDXChannel: <https://www.idxchannel.com/milenomic/7-perusahaan-fmcg-terbesar-di-indonesia-apa-saja>

Zimmerman, R., Lounibos, L., Nishimura, N., Galardo, A., Galardo, C., & Arruda, M. (2013). Nightly Biting Cycles of Malaria Vectors in a Heterogeneous Transmission Area of Eastern Amazonian Brazil. *Malaria Journal*, 1 - 17.

