

DAFTAR PUSTAKA

- Anoraga, P. dan Pakarti, P. 2008. *Pengantar Pasar Modal*. Jakarta: Rineka Cipta.
- Brigo *et al.* (2008). A Stochastic Processes Toolkit for Risk Management. *Journal of Risk Management in Financial Institution*. Vol 1(4), 5-13.
- Coles, S. (2001). *An Introduction to Statistical Modelling of Extreme Values*. London: Springer-Verlag.
- Cont, R. dan Tankov, P. (2004). *Financial Modeling with Jump Processes*. Chapman & Hall/CRC Financial Mathematics Series.
- Gilli, M., Kellezi, E. (2003). *An Application of Extreme Value Theory for Measuring Risk*. Elsevier Science.
- Herrhyanto, N. (2003). *Statistika Matematis Lanjutan*. Bandung: Cv Pustaka Setia.
- Hull, J. C. (2009). *Options, Futures, and Other Derivative Securities*. Seventh Edition. New Jersey: Prentice Hall.
- Jorion, P. (2007). *Value at Risk : The New Benchmark for Managing Financial Risk*. New York: McGraw-Hill.
- Kurniawati, Y. dan Sutikno. (2014) Analisis Data Ekstrim Dependen (*Non Stationary*) Pada Kasus Curah Hujan Ekstrim Di Jawa Timur Dengan Pendekatan *Peaks Over Threshold*. *Jurnal Statistika Institut Teknologi Surabaya*.
- Maruddani, D.A.I. dan Trimono. (2017) Valuasi Harga Saham PT Aneka Tambang Tbk sebagai Peraih *IDX Best Blue 2016*. *Jurnal Statistika Universitas Diponegoro Vol. 17 No. 1, 33-43*.
- Oskendal, B. (2003). *Stochastic Differential Equations*. Netherlands: Springer.
- Ross, S.M. (1996). *Stochastic Process*. New York: John Wiley & Sons.

- Widyawati, dkk. (2013) Penggunaan Model *Black Scholes* untuk Penentuan Harga Opsi Jual Tipe Eropa. *Buletin Ilmiah Math. Stat. dan Terapannya (Bimaster) Volume 02 No.1 hal 13-20*.
- Shcherbacov. (2013). A Survey of Forecast Error Measures. *World Applied Science Journal*. Vol 3(24), 171-176.
- Srinadi, I. 2013. *Pengantar Proses Stokastik*. Denpasar: FMIPA Universitas Udayana.
- Sundjaja, R., & Barlian, I. (2001). *Manajemen Keuangan*. Jakarta: Prnhallindo.
- Surya, Y. dan Situngkir, H. (2006). *Value at Risk Yang Memperhatikan Sifat Statistika Distribusi Return*. Munich Personal Repech Archives, <http://mpa.ub.uni-muenchen.de/895>.
- Tandelilin, E. (2007). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Yogyakarta: BPFE.
- Tsay, R. 2002. *Analysis of Financial Time Series*. Canada: John Wiley & Sons, Inc.
- Rajagukguk, R. (2017). *Berhasil Balik Arah, IHSG Menghijau ke 6070*. [Online]. Tersedia di: <http://www.inews.id/finance/read/berhasil-balik-arrah-ihsg-menghijau-ke-6-070>. Diakses 29 November 2017.