

DAFTAR PUSTAKA

- Adnyana, I. M. (2020). Manajemen Investasi dan Protfolio. In *Lembaga Penerbitan Universitas Nasional (LPU-UNAS)*. Lembaga Penerbitan Universitas Nasional (LPU-UNAS)
- Alhidayatullah, A., Siwiyanti, L., & Khairul, M. ; (2023). *Manajemen investasi* (Issue February).
- Almeida, C. S. de. (2016). pengantar teori probabilitas dan statistika. In *Revista Brasileira de Linguística Aplicada* (Vol. 5, Issue 1).
- Anastasia, V., & Subhan, M. (2022). Simulasi Monte Carlo dan Penerapannya dalam Menentukan Probabilitas Pergerakan Saham Indeks LQ-45. *Journal of Mathematics UNP*, 7(4), 1. <https://doi.org/10.24036/unpjomath.v7i4.13769>
- Dana, penenalan reksa. (2016). *Reksa Dana*. Jakarta. <https://reksadana.ojk.go.id/Home/HomePagePublic.aspx?ReturnUrl=%2F>
- Dwi, A. (2023). *Pengertian Investasi dan Jenis-Jenisnya*. Feb Umsu. <https://feb.umsu.ac.id/>
- Erowati, D. (2020). *Tata kelola keuangan pemerintah* (T. Qiara (Ed.)). cv.penerbit qiara media.
- Fahmi, I. (2012). *Manajemen investasi:teori dan soal jawab*. Salemba empat.
- Faisal, M., Sari, I., & Challen, A. . (2021). *KELURAHAN CIJANTUNG*. 1(3), 171–179.
- Glasserman, P. (2013). Monte Carlo Methods in Financial Engineerring. *Journal of Chemical Information and Modeling*, 53(9), 1689–1699.
- Halim, A. (2005). *Analisis Investasi* (kedua). Salemba empat.
- Hardiana, S., Subhan, M., & Murni, D. (2021). Optimalisasi Portofolio Saham dengan Simulasi Monte Carlo untuk Pengukuran Value at Risk (VaR). *UNPjoMath*, 4(1), 70–74. www.yahoofinance.com.
- Hartono, J. (2014). *teori dan praktik portofolio dengan excel*. Salemba empat.
- Husnan, S., & Rosadi, D. (1993). *Dasar-dasar teori portofolio analisis sekuritas di pasar modal*. UPP-AMP YKPN.
- Imf. (2002). *Financial Derivatives*. International Monetary Fund. <https://www.imf.org/external/np/sta/fd/index.htm>
- Indarwati, E., & Kusumawati, R. (2021). Estimation of the Portfolio Risk from Conditional Value at Risk Using Monte Carlo Simulation. *Jurnal Matematika, Statistika Dan Komputasi*, 17(3), 370–380. <https://doi.org/10.20956/j.v17i3.11340>

- Inrawan, A., Hastutik, S., Tonnis, B., Nugroho, H., Manik, E., Indriani, S., Hamdana, Salam, A., Atika, Kusumaningsih, A., Mindosa, B., Wijayangka, C., Djuanda, G., & Firmansyah, H. (2022). *Portofolio dan Investasi*. Widina Bhakti Persada Bandung.
- Khairiyati, C., & Krisnawati, A. (2019). Widina Bhakti Persada Bandung. *Almana*, 3(2), 301–312.
- Lisnawati, I., & Subekti, R. (2018). Estimasi Conditional Value at Risk (CVaR) Pada Portofolio Menggunakan Copula Bersyarat. *Jurnal Kajian Dan Terapan Matematika*, 7(3), 64–72.
- Maniil, C., Kumaat, R. J., & Maramis, M. T. B. (2023). Pengaruh Inflasi, Suku Bunga Bank Indonesia dan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Harga Indeks Saha, LQ45 Pada Bursa Efek Indonesia Periode 2017:Q1-2021Q4. *Jurnal Berkala Ilmiah Efisiensi*, 23(1), 97–108. <https://ejournal.unsrat.ac.id/v3/index.php/jbie/article/view/45165>
- Mappadang, A. (2021). *Buku Ajar Manajemen Investasi & Portofolio*.
- Marwati, L. (2017). *Perbandingan Uji Hasil Simulasi Monte Carlo Dan Simulasi Bootstrap Dalam Analisis Investasi Saham Untuk Menghitung Nilai Value At Risk (VaR) Data*.
- Pangaribuan, I. M., Dharmawan, K., & Sumarjaya, I. W. (2021). Analisis Risiko Portofolio Menggunakan Metode Simulasi Monte Carlo Control Variates. *E-Jurnal Matematika*, 10(4), 192. <https://doi.org/10.24843/mtk.2021.v10.i04.p342>
- Prasetya, L. B., Ispriyanti, D., & Prahutama, A. (2018). Estimasi Value At Risk Portofolio Saham Menggunakan Metode Garch-Copula (Studi Kasus : Harga Penutupan Saham Harian Unilever Indonesia dan Kimia Farma Periode 1 Januari 2013- 31 Desember 2016). *Jurnal Gaussian*, 7(4), 397–407. <https://doi.org/10.14710/j.gauss.v7i4.28867>
- Saham dan obligasi*. (2024). Bursa Efek Indonesiaidx. <https://www.idx.co.id/id>
- Subekti, R., & Matematika, P. S. (2014). *Penerapan Metode Mean Conditional Value At Risk Pada Portofolio Black-Litterman*. 1–8.
- Thariq, M. N. A. (2020). Pengukuran Risiko Value At Risk (Var) Pada Investasi Saham Menggunakan Metode Simulasi Monte Carlo. *Teknologi Industri*, 27.
- Widiyatari, W., Sulistianingsih, E., & Andani, W. (2023). Analisis Value At Risk Portofolio Saham Lq45 Dengan Metode Simulasi Monte Carlo Control Variates. *Epsilon: Jurnal Matematika Murni Dan Terapan*, 17(1), 91. <https://doi.org/10.20527/epsilon.v17i1.9536>