

DAFTAR PUSTAKA

- [1] Mulyono. (2015). Peran dan Fungsi Pasar Modal dan Penatalaksanaannya Dalam Pembangunan Perekonomian Nasional. Indonesia.
- [2] Dharmawan, Komang. (2012). Estimasi Nilai VaR Dinamis Indeks Saham Menggunakan *Peak-Over Threshold* dan *Block Maxima*. Universitas Udayana, Bali.
- [3] Pratama, Alvan. (2014). Peramalan Data Runtun Waktu dengan Model ARIMAX-GARCH dalam Pasar Modal Syariah. Skripsi. UIN Sunan Kalijaga, Yogyakarta, Indonesia.
- [4] Farida, Nur; Nelliawati; Fauzana, Rhinta; Kurniaty, Vinta. (2012). *Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity (GARCH)*. Universitas Riau, Pekanbaru.
- [5] Marcucci, Juri. (2005). Forecasting Stock Market Volatility with Regime Switching GARCH Models. University of California, San Diego, United States.
- [6] Haryono; Akbar, M. Sjahid; Zuhara Umami. (2012). “Penggunaan Metode VaR (*Value at Risk*) dalam Analisis Risiko Investasi Saham dengan Pendekatan *Generalized Pareto Distribution (GPD)*”. Jurnal Sains dan Seni ITS,(1),(1). ISSN: 2301-928X
- [7] Ross, A Stephen. Westerfield, Randolph W. Jordan, Bradford D. (2003). Fundamentals of Corporate Finance Sixth edition. New York: Mc Graw-Hill.

- [8] Marvillia, Bunga Lety. (2013). *Pemodelan dan Peramalan Penutupan Harga Saham PT. Telkom dengan Metode ARCH – GARCH*. Universitas Negeri Surabaya, Indonesia.
- [9] Bollerslev, Tim. *Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity*, *Econometrics* 31 (1986), 307-327.
- [10] Augustsson, Viktor. (2014). *Evaluating Switching GARCH Volatility Forecasts During the Recent Financial Crisis*. Master Thesis. Lund University.
- [11] Malika, Rosna; Sutikno. *Declustering Peaks Over Threshold Pada Data Curah Hujan Ekstrem Dependen di Sentra Produksi Padi Jawa Timut*. FMIPA, Institut Teknologi Sepuluh Nopember, Indonesia.
- [12] Cai, J. (1994). *A Markov Model of Switching-Regime ARCH*. *Journal of Business and Economic Statistics*.
- [13] Suhadi. (2012). *Evaluasi Perhitungan Value at Risk dengan simulasi Monte Carlo dan Simulasi Historis pada Tiga Bank Badan Usaha Milik Negara(BUMN)*. Universitas Indonesia, Indonesia.
- [14] Paridi; Noviyanti, Lienda; Handoko, Budi. (2015). *Estimasi Value at Risk Dinamis Menggunakan Metode Block Maxima*. Universitas Padjajaran, Bandung, Indonesia.
- [15] Arifin, Yulianto Nur. (2014). *Ukuran Risiko Pada Portofolio Aset*. Tugas Akhir. Institut Teknologi Bandung, Indonesia.