

DAFTAR PUSTAKA

- Artzner, P., Eber, F. Delbaen, Eber, J. M. & Heath, D. (1997). Thinking Coherently. *Risk*, 10, 68-71.
- Artzner, P., Delbaen, F., Heath, D. D., & Jean-Marc E. (1999). Coherent Measures of Risk. *Mathematical Finance*, 9 (3), 203-228.
- Dowd, K. (1998). *Beyond Value at Risk: The New Science of Risk management, Fronters in Finance Series*. England: John Wiley and Sons. .
- Epriyanti, W., Yundari., & Martha, S. (2022). Perhitungan Expected Shortfall pada investasi saham dengan pendekatan ekspansi cornish fisher. *Buletin Ilmiah Math.Stat.dan Terapannya* (bimaster),11 (4), 667-676.
- Fadilah, N, Subartini, B, & Sukono, F. (2020). Optimasi portofolio expected shortfall pada saham sektor energi dan pertambangan. *Jurnal Publikasi Ilmiah Matematika*, 5 (1).
- Herrhyanto, N & Gantini, T. (2011). *Pengantar statistika matematika*. Bandung: Yrama widya.
- <http://finance.yahoo.com>. Diakses pada tanggal 8 Mei 2023.
- <https://ssms.co.id>. Diakses pada tanggal 4 Juni 2023.
- Jewan, D., Guo, R, & Witten, G. (2008). Copula marginal expected tail loss rfficient frontiers for CDOs of bespoke portpolios. *Proceeding of the world congress on engineering*, 2, 3-7.

Kusumawardani, R. A. (2019). Analisis ukuran risiko expected shortfall pada indeks pasar saham. *E-proceeding of engineering*, 6 (1), 2403-2416.

Letmark & Mattias. (2010). Robustness of conditional value at risk (CvaR) when measuring market risk across different asset clases, royal institute of technology.

Manurung, A. H., & Rizky, L. T., (2009), *Successful financial planner: A complete guide*. Jakarta: Grasindo.

Ridha, M. N. N., & Khoiruddin, M. (2018). Konsistensi pengukuran value at risk pada saham syariah dengan metode historis. *Management analysis journal*, 7(1), 1-14.

Sulistiowati, D., Syahrul, M. S., & Rianjaya, I. D. (2021). Analisis risiko harga jual emas antam menggunakan *Expected Shortfall* pada masa pandemi covid-19. *Jurnal Matematika, Statistik dan Komputasi*, 17 (3), 428-437.

Sumaji, Y, M, P., Hsu, W, L., & Salim, U. (2017). Analisis risiko pasar pada investasi sahan menggunakan metode value at risk. *Asia-Pacific management and business application*, 6 (1), 1-14.

Siegel, S. (1997). *Statistik nonparametrik: Untuk ilmu-ilmu social*. Jakarta: Gramedia pustaka utama.

Putranto, L, S. (2022). *Statistik dan probabilitas*. Daerah Istimewa Yogyakarta: Andi

Yulia, & Triana, L. (2021). Pengukuran value at risk pada aset perusahaan dengan simulasi monte carlo. *Jurnal Ilmiah ilmu Manajemen dan Kewirausahaan*, 1 (1), 48-57.