

DAFTAR PUSTAKA

- Al Maidah, F., 2015, *Perbandingan Model Volatilitas Return dengan Menggunakan Model Glosen-Jagannathan-Runkle GARCH (GJR-GARCH) dan Exponential GARCH (EGARCH)* (Doctoral dissertation, Universitas Gadjah Mada).
- Ambarsari, A., Sudarno, S., & Tarno, T., 2016, Perbandingan Pendekatan Generalized Extreme Value dan Generalized Pareto Distribution untuk Perhitungan Value at Risk pada Portofolio Saham, *Jurnal Gaussian*, 5(3), 361-371.
- Bain, J. L., & Engelhardt, M., 1992, *Introduction to Probability and Mathematical Statistics* (2nd ed.), Duxbury.
- Balkema, A.A. dan de Haan, L., 1990, *A convergence rate in extreme-value theory*. J. Appl. Probab. 27, 577-585.
- Brilliantya, S. N., Nisa, K., Saidi, S., & Setiawan, E., 2022, Model EGARCH dan TGARCH untuk Mengukur Volatilitas Asimetris Return Saham, *Jurnal Siger Matematika*, 3(2), 45-52.
- Brook, C., 2008, *Introductory Econometrics for Finance* (2nd ed.), Cambridge University Press.
- Bollerslev, T., 1986, Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity, *Journal of Econometrics*, 31, 307-327.
- Committee on the Global Financial System, 2000, Stress Testing by Large Financial Institutions: Current Practice and Aggregation Issues, *CGFS Publications*, No. 14.
- Crouhy, M., Galai, D., & Mark, R., 2005, *The Essentials of Risk Management*, McGraw Hill Professional, USA.
- Daniel, W. W., 1989, *Statistik Non Parametrik Terapan*. Diterjemahkan oleh Alex Tri Kantjono W, Jakarta: PT. Gramedia.
- Demos, A., & Kyriakopoulou, D., 2010, *Bias Correction of ML and QML Estimators in the EGARCH(1,1) Model*.
- Dharmawan, K., 2012, Estimasi Nilai VaR Dinamis Indeks Saham Menggunakan Peak-Over Threshold dan Block Maxima, *Jurnal Matematika*, 2(2), 1-12.

- Dowd, K., 2007, *Measuring Market Risk 2nd Edition*, John Wiley & Sons Ltd, England.
- Dwipa, N. M. S., 2016, *Aplikasi EGARCH untuk Peramalan VaR* [Tesis], Universitas Gadjah Mada.
- Embrechts, P., C. Kluppelberg dan T. Mikosch, 1997, *Modelling Extremal Events for Insurance and Finance*, Springer.
- Floros, C., 2005, Forecasting The UK Unemployment Rate: Model Comparisons, *International Journal of Applied Econometrics and Qunatitative Studies*, Vol. 2-44, 57-72.
- Fisher, T. J., & Gallagher, C. M., 2012, New Weighted Portmanteau Statistics for Time Series Goodness Of Fit Testing. *Journal of the American Statistical Association*, 107(498), 777-787.
- Ghozali, I., 2007, *Manajemen Risiko Perbankan*, BPUNDIP, Semarang.
- Hastaryta, R., & Effendie, A. R., 2006, Estimasi Value-At-Risk dengan Pendekatan Extreme Value Theory-Generalized Pareto Distribution (Studi Kasus IHSG 1997-2004), *BIMIPA*, 16(2), 1-6.
- Hayes, A., 2022, Stocks: What They Are, Main Types, How They Differ From Bonds, <https://www.investopedia.com/terms/s/stock.asp>, diakses 20 Januari 2023.
- Hendrawan, R., & Yanida, P., 2014, Analisis Perbandingan Kinerja Value at Risk Berbasis ARCH, GARCH, dan EGARCH Sebelum, Saat, dan Setelah Krisis Global Tahun 2008 Pada JKSE, KLSE, STI, PSEI, HIS, KOSPI, SSE DAN N225, *Jurnal Manajemen Indonesia*, 14(1), 91-109.
- Hermansah, 2012, *Estimasi Value At Risk Dan Expected Shortfall Untuk Heteroskedastik Runtun Waktu Finansial Dengan Generalized Pareto Distribution*, Tesis, UGM.
- Hull, J.C., 2018, *Risk management and financial institutions* (5th ed.), John Wiley & Sons, New Jersey.
- Indriati, A.P., 2010, *Analisis Stress Testing VaR Pada Risiko Pasar Portofolio Efek PT DA*, Program Studi Magister Manajemen, Universitas Indonesia, Jakarta.
- Inlistya, V. A., 2017, Perbandingan Metode Antara GJR-GARCH dan EGARCH Pada Analisis Volatilitas Indeks Saham Syariah Indonesia, *Departemen*

Matematika, Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam, Institut Teknologi Sepuluh Nopember. Surabaya.

Jorion, P., 2007, *Value at Risk 3rd Edition: The New Benchmark for Managing Financial Risk*, McGraw-Hill Education, Spanyol.

Juliarini, N. K., Sumarjaya, I. W., & Sari, K., 2021, Peramalan Volatilitas dan Estimasi Value at Risk (VaR) Saham Blue Chip Pada Sektor Perbankan, *E-Jurnal Matematika*, 10(4), 198-208.

Kichen, N. N., 2017, *Estimasi Value at Risk (VaR) portofolio multivariat menggunakan metode GARCH Student T-EVT-VINE Copula* (Doctoral dissertation, Universitas Gadjah Mada).

KSEI, 2022, Statistik Pasar Modal Indonesia Desember 2021, https://www.ksei.co.id/files/Statistik_Publik_Desember_2021.pdf, diakses 25 Agustus 2022.

McNeil, A. J., 1999, *Extreme Value Theory for Risk Managers*, Zurich: Departement Mathematic ETH Zentrum.

Nelson, D., 1991, Conditional Heteroskedasticity in Asset Returns: A New Approach, *Econometrica*, 59(2), 347–370.

Omari, C., Mundia, S., & Ngina, I., 2020, Forecasting value-at-risk of financial markets under the global pandemic of covid-19 using conditional extreme value theory, *Journal of Mathematical Finance*, 10, 569-597.

Palias, F., 2023, *Analisis Volatilitas Cryptocurrency untuk Estimasi Value at Risk Menggunakan Model Exponential Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (EGARCH)* (Doctoral dissertation, Universitas Gadjah Mada).

Rohmah, S. M., & Suharsono, A., 2017, Estimasi Value at Risk dalam Investasi Saham Subsektor Perbankan di Bursa Efek Indonesia dengan Pendekatan Extreme Value Theory, *Jurnal Sains dan Seni ITS*, 6(2), D204-D209.

Rosadi, D., 2011, *Analisis Ekonometrika & Runtun Waktu Terapan dengan R*, Yogyakarta: Andi Offset.

Rosadi, D., 2012, *Diktat Kuliah Manajemen Resiko Kuantitatif*, Program Studi Statistika FMIPA UGM, Yogyakarta.

Rosadi, D., 2014, *Analisis Runtun Waktu dan Aplikasinya dengan R*, Yogyakarta.

- Sari, L. K., Achsani, N. A., & Sartono, B., 2017, Pemodelan volatilitas return saham: Studi kasus pasar saham Asia, *Jurnal Ekonomi Dan Pembangunan Indonesia*, 18(1), 3.
- Sari, Y.D.W., dan Sutikno., 2013, “Estimasi Parameter Generalized Pareto Distribution pada Kasus Identifikasi Perubahan Iklim di Sentra Produksi Padi Jawa Timur”, *Jurnal Sains dan Seni POMITS*, 2(2), 2337-3520.
- Sinambela, N. H., Di Asih, I. M., & Hakim, A. R., 2022, Value at Risk with Performing Exponential Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity–Generalized Pareto Distribution, *Jurnal ILMU DASAR*, 23(1), 1-8.
- Sugiyarto, 2021, *Pengantar Statistika Matematika 2*, Program Studi Matematika FSTT UAD, Yogyakarta: Magnum Pustaka Utama.
- Syahrir, R. F., 2018, *Metode EGARCH-EVT-Vine Copula untuk Mengestimasi Value at Risk (VaR) Portofolio Multivariat* (Doctoral dissertation, Universitas Gadjah Mada).
- Tandelilin, E., 2010, Dasar-dasar manajemen investasi, *Manajemen Investasi*, 34.
- Tsay, R. S., 2005, *Analysis of Financial Time Series Second Edition* (2nd ed.), John Wiley & Sons.
- Wei, W. W. S., 2006, *Time Series Analysis, Univariate and Multivariate Methods*, Addison Wesley Publishing Company.
- Wirawati, I., 2007, *Pemodelan Efek Asimetris dalam Volatilitas dengan EGARCH* [Skripsi], Universitas Brawijaya.
- Zuhara, U., Akbar, M. S., & Haryono, H., 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), D56-D61.