

DAFTAR PUSTAKA

- Bain, L. dan Engelhardt, M. (1992). *Introduction to Probability and mathematical Statistics, Second edition*. California : Duxbury Press.
- Corrado, C.J.; dan Su, T.;. (1996(b)). *Skewness and Kurtosis in S&P 500 Indeks Returns Implied by Option Prices*. Journal of Financial Research , 637-659.
- Corrado, C.J. (2007). *The Hidden Martingale Restriction in Gram-Charlier Option Prices*, Journal of Future Markets, 363-378.
- Del Brio, E.B.; Perote J.; Andres Mora-Valencia. (2017) *Risk quatification for Commodity ETFs: Backtesting Value-at-Risk and Expected Shortfall*. Spain : Science Direct.
- Del Brio, E.B.; Perote J. (2012). *Gram-Charlier densities: Maximum likelihood versus the Method of Moments*. Spain : Elsevier.
- Ghalanos, A. (2017). *Introduction to the rugarch package (Version 1.3-1)*.
- Kichen, Nadya N. (2017). *Estimasi Value at Risk (VaR) Portofolio Multivariat Menggunakan Metode GARCH Student t-EVT-Vine Copula*. Skripsi. Universitas Gadjah Mada.
- Kumar, Dilip; Maheswaran, S. (2012). *Modelling asymetry and persistence under the impact of sudden changes in the volatilityof the Indian stock market*. India : Science Dierect.
- Rosadi, Dedi. (2011). *Analisis Ekonometrika & Runtun Waktu Terapan dengan R*. Yogyakarta : Andi.
- Rosadi, Dedi. (2014). *Analisis Runtun Waktu dan Aplikasinya dengan R*. Yogyakarta : Gadjah Mada University Press.
- Rosadi, Dedi. (2012). *Diktat Kuliah Manajemen Risiko Kuantitatif*. Yogyakarta : Program Studi Statistika Fakultas MIPA UGM.
- Subanar. (2013). *Statistika Matematika. Probabilitas, Distribusi, dan Asimtotis dalam Statistika* . Yogyakarta : Graha Ilmu.
- Syahrir, Risqia Fadhilah. (2018). *Metode EGARCH-EVT-VINE Copula untuk Mengestimasi Value at Risk (VaR)Portofolio Multivariat*. Skripsi. Universitas Gadjah Mada.
- Wildani, Z. (2016). *Penentuan Harga Opsi Beli Tipe Eropa Menggunakan Ekspansi Gram Charlier*. Skripsi. Universitas Gadjah Mada.



<https://economy.okezone.com/read/2017/10/04/278/1788558/wihh-jumlah-investor-aktif-di-bei-naik-20>

diunggah pada 9 April 2018 (15.12)