

DAFTAR PUSTAKA

- Abi, F. P. P. 2016. *Semakin Dekat dengan Pasar Modal Indonesia*. Yogyakarta: Deepublish.
- Adnyana, I. M. 2020. *Buku: Manajemen Investasi dan Portofolio*. Jakarta: LPU-UNAS.
- Best, P.W. 1998. *Implementing Value at Risk*. West Sussex: John Willey & Sons Inc.
- Brigham, E. F., dan Daves, P. R. 2004. *Intermediate Financial Management*. Edisi 11. South-Western Cengage Learning.
- Bursa Efek Indonesia. 2023. *Press Release: Melalui Berbagai Pencapaian Tahun 2023, Pasar Modal Indonesia Tunjukkan Optimisme Hadapi Tahun 2024*. <https://www.idx.co.id/en/news/press-release/2080>. Diakses : 15 Januari 2024.
- Daniel, W. 1989. *Statistika Nonparametrik Terapan*. Jakarta: PT Gramedia.
- Darmadji, T., dan Fakhruddin, H. M. 2011. *Pasar Modal di Indonesia*. Jakarta: Salemba Empat.
- Dewi, E. K., Ispriyanti, D., dan Rusgiyono, A. 2021. *Expected Shortfall Pada Portofolio Optimal Dengan Metode Single Index Model (Studi Kasus pada Saham IDX30)*. Jurnal Gaussian, 10(2), 269-278.
- Dowd, K. 2002. *Measuring Market Risk*. Second Edition. West Sussex: John Willey & Sons, Ltd.
- Driels, M. R. 2004. *Determining The Number of Iteration for Monte-Carlo Simulations of Weapon Effectiveness*. California: NPS.

- Fabozzi, F. J. 1995. Manajemen Investasi. Tim Penerjemah Salemba Empat, penerjemah. Jakarta: Salemba Empat. Terjemahan dari : *Investment Management*.
- Fahmi, I. 2015. Teori Portofolio dan Analisis Investasi. Bandung : Alfabeta.
- Halim, A. 2005. Analisis Investasi. Edisi Kedua. Jakarta: Salemba Empat.
- Hartono, J. 2016. Teori Portofolio dan Analisis Investasi. Yogyakarta: BPFE-Yogyakarta.
- Herlianto, D. 2010. Seluk Beluk Investasi di Pasar Modal Indonesia. Yogyakarta: Gosyan Publishing.
- Heyer, D. D. 2001. *Stochastic Dominance: A Tool for Evaluating Reinsurance Alternatives*. CAS (Casualty Actuarial Society) Forum.
- Huda, N., dan Nasution, M. E. 2008. Investasi pada Pasar Modal Syariah. Cetakan 2. Jakarta: Kencana.
- Husnan, S. 1993. Teori Portofolio dan Implikasinya bagi Manajemen Keuangan. Yogyakarta : BPFE – Yogyakarta.
- Husnan, S. 2009. Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas Edisi Keempat. Yogyakarta: UPP STIM YKPN.
- Johnson, R.A., dan Wichern, D.W. 2007. *Applied Multivariate Statistical Analysis*. Sixth Edition. New York:Prentice Hall.
- Jones, C. P. 2004. *Investments: Analysis and Management*. Sixth edition. Willey.
- Jorion, P. 2002. *Value at Risk: The New Benchmark for Managing Financial Risk* . Second Edition. New York: The McGraw-Hill Companies, Inc.
- Juliati, Y. S. 2015. Peranan Pasar Modal dalam Perekonomian Negara. HUMAN FALAH: Jurnal Ekonomi dan Bisnis Islam, 2(1), 95-112.

Kamus Besar Bahasa Indonesia (KBBI). Dominasi. Diakses dari <https://kbbi.web.id/dominasi>.

Khairunnisa, K., Kusnandar, D., dan Aprizkiyandari, S. 2021. OPTIMALISASI PORTOFOLIO SAHAM INDEKS LQ-45 DENGAN METODE STOCHASTIC DOMINANCE. Bimaster: Buletin Ilmiah Matematika, Statistika dan Terapannya, 10(4).

Kjetsaa, R., dan Kieff, M. 2003. *Stochastic Dominance Analysis of Equity Mutual Fund Performance*. Journal of American Business Review, Vol. 21, No. 1, 1-8.

Klugman, S.A., Panjer, H.H., dan Willmot, G.E. 2019. *Loss Models from Data to Decisions*. Fifth Edition. Hoboken: John Wiley & Son, Inc.

Kurniawan, R., dan Yuniarto, B. 2016. Analisis Regresi Dasar dan Penerapannya dengan R. Jakarta: Kencana.

Kuswandanu, E. 2015. Analisis Portofolio Optimum Saham Syariah Menggunakan *Stochastic Dominance*. Jurnal Fourier, 4(1), 43642.

Marques de Sa, J.P. 2007. *Applied Statistics Using SPSS, STATISTICAL, MATLAB, and R*. Springer Berlin Heidelberg. New York.

Maruddani, D. A. I. & Purbowati, A. 2009. Pengukuran *Value at Risk* pada Aset Tunggal dan Portofolio dengan Simulasi Monte Carlo. Media Statistika, 2(2), 93-104.

Maruddani, D. A. I. 2019. *Value at Risk* untuk Pengukuran Risiko Investasi Saham: Aplikasi dengan Program R. Ponorogo: PT Wade Group.

Nasaruddin, M.I., dan Surya, I. 2004. Aspek Hukum Pasar Modal Indonesia. Jakarta: Prenada Media.

- Noor, H. F. 2009. *Investasi: Pengelolaan Keuangan Bisnis dan Pengembangan Ekonomi Masyarakat*. Jakarta: PT Indeks.
- Otoritas Jasa Keuangan. 2017. *UU Nomor 8 Tahun 1995 (official)*.
[https://www.ojk.go.id/id/kanal/pasar-modal/regulasi/undang-undang/Documents/Pages/undang-undang-nomor-8-tahun-1995-tentang-pasar-modal/UU%20Nomor%208%20Tahun%201995%20\(official\).pdf](https://www.ojk.go.id/id/kanal/pasar-modal/regulasi/undang-undang/Documents/Pages/undang-undang-nomor-8-tahun-1995-tentang-pasar-modal/UU%20Nomor%208%20Tahun%201995%20(official).pdf).
 Diakses : 15 Januari 2024.
- Otoritas Jasa Keuangan. 2019. *Siaran Pers: Jelang Tutup Tahun 2019 Kinerja Pasar Modal Positif Jumlah Investor Saham Meningkat*.
<https://ojk.go.id/id/berita-dan-kegiatan/siaran-pers/Pages/Siaran-Pers-Jelang-Tutup-Tahun-2019-Kinerja-Pasar-Modal-Positif-Jumlah-Investor-Saham-Meningkat-.aspx>. Diakses : 15 Januari 2024.
- Phasa, A. S., dan Astuti, Y. P. 2021. Analisis Perilaku Brand Switching Dengan Metode Rantai Markov. *MATHunesa: Jurnal Ilmiah Matematika*, 9(1), 212-219.
- Post, T. 2003. *Empirical Tests for Stochastic Dominance Efficiency*. *Journal of Finance*, Vol. 58, No. 5, 1905-1931.
- Praptono, M. A. 1986 *Pengantar Proses Stokastik I*. Jakarta: Karunika. Universitas Terbuka.
- Rockafellar, R.T., dan Uryasev, S., 2000. *Optimization of Conditional Value at Risk*. *Journal of Risk*, Vol. 2, No. 3.
- Rosadi, D. 2011. *Analisis Ekonometrika & Runtun Waktu Terapan dengan R*. Andi. Yogyakarta.

- Sharpe, W. F., Alexander, G. J., dan Bailey, J. V. 2005. “*Investasi*”. Edisi Keenam. Jilid I. Edisi Bahasa Indonesia. PT. Indeks Kelompok Gramedia. Jakarta.
- Sillaban, A. 2007. Analisis Faktor-faktor yang Mempengaruhi Return Saham Perusahaan Manufaktur yang Go Publik Di Bursa Efek Indonesia. Jurnal Majalah Ekonomi, 6 (1): h: 23-35.
- Syamsuar, G. 2020. Modul Workshop Statistika (EKM235): Analisis Data Non-Parametrik. STIE Indonesia Jakarta. <http://repository.stei.ac.id/6424/>.
- Tandelilin, E. 2017. Portofolio dan Investasi, Teori dan Aplikasi. Yogyakarta: Kanisius.
- Tsay, R.S. 2005. *Analysis of Financial Time Series*. Second Edition. John Willey and Son. New York.