

## DAFTAR PUSTAKA

- Astuti, I., & Burhanudin, B. N. S. (2018). Analisis Risiko Portofolio dengan Menggunakan Metode Simulasi *Monte Carlo* (Studi pada Perusahaan yang Terdaftar Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia Periode 2015-2018). *Sumber*, 995(23), 3-29.
- Bain, L. J., & Engelhardt, M. (1987). *Introduction to probability and mathematical statistics*. Brooks/Cole.
- Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. 2008. *Investment*. Seventh Edition. Mc Graw Hill Financial Series.
- Chantasorn, U. (2011). Efficiency comparisons of normality test using statistical packages. *Science and Technology Asia*, 9-25.
- Cumming, G., & Finch, S. (2005). Inference by eye: confidence intervals and how to read pictures of data. *American psychologist*, 60(2), 170.
- Dahlan, S. (2013). Penggunaan Single Index Model Dalam Analisis Portofolio Untuk Meminimumkan Risiko Bagi Investor Di Pasar Modal (Studi Pada Saham Perusahaan Yang Tercatat Dalam Indeks Lq 45 Di Bursa Efek Indonesia Periode 2010-2012). *Jurnal Administrasi Bisnis*, 6(2).
- Danielsson, J., & Zigrand, J. P. (2006). On time-scaling of risk and the square-root-of-time rule. *Journal of Banking & Finance*, 30(10), 2701-2713.
- Danielson, C. Khan, H. (2015). Risk Analysis of project time and cost through Monte Carlo Method (Doctoral dissertation, Tese de doutorado, Stockholm, Sweden).
- Darmadji, T., dan Fakhruddin, H.M., 2001. *Pasar Modal di Indonesia: Pendekatan Tanya Jawab*. Salemba Empat: Jakarta.
- Fabozzi, FJ. 1999. *Manajemen Investasi*. Salemba Empat: Jakarta.
- Gunawan, D., Dang, K. D., Quiroz, M., Kohn, R. Tran, M. N. (2020). Subsampling sequential Monte Carlo for static Bayesian models. *Statistics and Computing*, 30(6), 1741-1758.
- Goldstein, H., & Healy, M. J. (1995). The graphical presentation of a collection of means. *Journal of the Royal Statistical Society: Series A (Statistics in*

*Society*), 158(1), 175-177.

- Hartono, Jogyanto. 2014. *Teori dan Praktik Portofolio Dengan Excel*. Jakarta: Salemba Empat.
- Haryanto, H. (2020). Dampak Covid-19 terhadap Pergerakan Nilai Tukar Rupiah dan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG). *Jurnal Perencanaan Pembangunan: The Indonesian Journal of Development Planning*, 4(2), 151-165.
- Hertz, B. David. 1979. *Risk Analysis in Capital Investment*. Harvard Business Review.
- Kusumawati, W. I. (2011). Simulasi Produksi dan Distribusi Pelayanan Permintaan Sarung Tenun Dengan Metode Monte Carlo.
- Kwak, Y. H. Ingall, L. (2009). Exploring Monte Carlo simulation applications for project management. *IEEE Engineering management review*, 37(2), 83.
- Luthfiyanti, A. M. (2020). Analisis Risiko Investasi pada Portofoliodengan Value at Risk (VaR) Menggunakan Simulasi Monte Carlo. *UNP Journal of Mathematics*, 3(3).
- Lock, R. H., Lock, P. F., Morgan, K. L., Lock, E. F., & Lock, D. F. (2020). *Statistics: Unlocking the power of data*. John Wiley & Sons.
- Nosakhare, U. H. Bright, A. F. (2017). Evaluation of techniques for univariate normality test using Monte Carlo simulation. *American Journal of Theoretical and Applied Statistics*, 6(5-1), 51-61.
- Park, H. M. (2015). Univariate analysis and normality test using SAS, Stata, and SPSS.
- Pradana, D. C., Di Asih, I. M., & Yasin, H. (2015). Penggunaan Simulasi Monte Carlo Untuk Pengukuran Value At Risk Aset Tunggal Dan Portofolio Dengan Pendekatan Capital Asset Pricing Model Sebagai Penentu Portofolio Optimal (Studi Kasus: Index Saham Kelompok Sminfra18). *Jurnal Gaussian*, 4(4), 765-774.
- Putry, G., Sugema, I., & Lubis, D. (2014). Analisis Perbandingan Excess Return Jakarta Islamic Index dan Indeks Harga Saham Gabungan. *Al-Muzara'ah*, 2(2), 121-134.

- Rahman, R., & Suherman, M. (2017). Analisis Harga Saham Melalui Peningkatan Kinerja Keuangan: Studi Pada Perusahaan Yang Terdaftar Di Jakarta Islamic Index. *Jurnal Akuntansi*, 12(2), 135-152.
- Razali, N. M. Wah, Y. B. (2011). Power comparisons of shapiro-wilk, kolmogorov-smirnov, lilliefors and anderson-darling tests. *Journal of statistical modeling and analytics*, 2(1), 21-33.
- Sigal, M. J. Chalmers, R. P. (2016). Play it again: Teaching statistics with Monte Carlo simulation. *Journal of Statistics Education*, 24(3), 136-156.
- Sunariyah. 2003. *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*. Edisi Ketiga. Yogyakarta: UPP AMPK YKPN.
- Suryawati, B. N., Wardani, L., & Sarmo, S. (2018). Analisis Volatilitas Harga Saham terkategori Indeks Konstituen di Bursa Efek Indonesia dengan Penggunaan Simulasi Monte Carlo. *Penelitian PNBPDIPA UNRAM belum dipublikasikan*.
- Sutarti. 2007. Analisis Saham-Saham *Jakarta Islamic Index* untuk Membentuk Portofolio yang Optimal dengan Menggunakan *Single Index Model*: Studi Kasus Pada Bursa Efek Jakarta. *Jurnal Ilmiah Ranggagading* 7(2): 119-124.
- Tandelilin, E. (2010). *Portofolio Dan Investasi: Teori Dan Aplikasi*. Yogyakarta: Kanisius.