

Daftar Pustaka

- Adrianto, Achmad Dimas dan Khairunnisa, Muhammad Azhari. (2018). *“Perhitungan Value at Risk (Var) Dengan Meyode Historis dan Monte Carlo Pada Saham Sub Sector Rokok”*. Jurnal Riset Bisnis Dan Manajemen Vol. 11 No. 1 Februari 2018
- Akbriani, Rosiana. (2015). *“Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Saham Dengan Menggunakan Model Indeks Tunggal”*. Skripsi. Universitas Negeri Yogyakarta
- Anas, Sudijono. (2009). *“Pengantar Statistik Pendidikan”*. Jakarta: Rajawali Pers
- Andi, Dimas. (2018). *“Persepsi Risiko Investasi Indonesia Kian Meningkat, Apa Penyebabnya”*. Diakses 18 Maret 2019: <http://www.kontan.co.id/news>
- Arthini, K Dharmawan, Dan Harini. (2012). *“Perhitungan Var Portofolio Saham Menggunakan Data Historis Dan Data Simulasi Monte Carlo”*. e- journal Matematika, Vol. 1, No. 1 Agustus 2012.
- Aziz, Abdul. (2010). *“Manajemen Investasi Syariah”*. Bandung: Alfabeta
- Azwar, Saifuddin. (2007). *“Metode Penelitian”*. Yogyakarta: Pustaka Pelajar
- Basel Comitte on Banking Supervision. (2011). *“Revision to the Basel II Market Risk Framework”*. Bis, Basel, Switzerland
- Basyaib, Fahmi (2007). *“Manajemen Risiko”*. Jakarta: PT Grasindo
- Best, P. (1998). *“Implementing Value at Risk”*. England: John Wiley & Sons, Inc.
- Buchdadi, Agung D. (2008). *“Perhitungan Value at Risk Portofolio Optimum Saham Perusahaan Berbasis Syariah Dengan Pendekatan Ewma”*. Jurnal Akuntansi dan Keuangan Indonesia, Vol. 5, No. 2
- Devi, Silvia Shita. (2010). *“Analisis Risiko Portofolio dengan Metode Variance Covariance (Studi Kasus: Harga Penutupan Saham Harian PT. Astra Internasional dan PT. Indosat Juli- Desember 2009)”*. Skripsi. Universitas Negeri Yogyakarta
- Dewan Syariah Nasional (Dsn) Majelis Ulama Indonesia (MUI). *“Fatwa Dewan Syariah Nasional”*. Jakarta
- Djohanputro. (2008). *“Manajemen Risiko Korporat”*. Jakarta: PPM
- Fahmi, Irham. (2010). *“Manajemen Risiko: Teori, Kasus, dan Solusi”*. Bandung: Alfabeta

- Farid, Darush. Alireza Rajabipoor Meybodi, Seyed Heydar Mirfakhraddiny. (2010). "*Investment Risk Management in Tehran Stock Exchange (Tse) Using Technique Of Monte Carlo Simulation (MCS)*". Journal of Financial Crime Vol. 17 No. 2, 2010
- Fauzi, Ahmad. (2013). "*Analisis Risiko Portofolio Metode Value at Risk (VAR) Melalui Pendekatan Historical Method (Back Simulation)*". Skripsi. Universitas Islam Negeri Sunan Kalijaga
- Ghozali, Imam. (2007). "*Manajemen Risiko Perbankan Pendekatan Kuantitatif Value at Risk (VAR)*". Semarang: BPUP Semarang
- Gumanti, Ary Tatang. (2011). "*Manajemen Investasi- Konsep, Teori dan Aplikasi*". Jakarta: Mitra Wacana Media
- Hardila. (2015). "*Pengukuran Value at Risk Dengan Metode Historical Simulation, Variance Covariance, dan Monte Carlo Simulation (Studi Pada Perusahaan Perbankan yang Terdaftar di Bursa Index LQ 45 Tahun 2014)*". Skripsi. Fakultas Ekonomi Universitas Andalas
- Heryanti, Sri Astuti. (2017). "*Perhitungan Value at Risk pada Portfolio Optimal: Studi Perbandingan Saham Syariah dan Saham Konvensional*". Journal of Islamic Economics and Business Volume 2, No. 1
- Indi, Rifka. (2017). "*Analisis Pembentukan dan Pengukuran Risiko Portofolio Optimal Pada Saham LQ 45*". Skripsi. Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah
- Iskana, Febrina Ratna. (2018). "*Ini Kata PGN Soal Penurunan Laba Lima Tahun Berturut*". Diakses Februasri 2019: <http://www.kontan.co.id/news>
- Ismanto, Hadi. (2016). "*Analisis Value at Risk dalam Pembentukan Portofolio Optimal (Studi Empiris Pada Saham-Saham Yang Tergabung dalam LQ 45)*". The 3rd University Research Colloquium 2016
- Jorion, Philippe. (2001). "*Value At Risk: The New Benchmark for Managing Financial Risk*". 2nd Ed. Mc. Graw Hil. California. North America
- Jorion, P. (2007). "*Value at Risk the New Benchmark for Managing Financial (3rd Ed.)*". USA: Mcgraw Hill
- Jogiyanto. (2008). "*tori portofolio dan analisis investasi*". Yogyakarta: BPFE
- Kahar, Yuskar. (2009). "*Perhitungan Value at Risk Pada Institudi Perbankan Berdasarkan Metode Variance Covariace*"
- Kasidi. (2010). "*Manajemen Risiko*". Bogor: Ghalia Indonesia

- Kupiec, Paul H. (1995). *“Techniques for Verifying the Accuracy of Risk Management Models”*. The Journal of Derivatives. A Publication of Institutional Investor. New York
- Lestdwinanto, Handoyo. (2016). *“Perbandingan Metode Value at Risk Antara Metode Risk Metric, Historical Back Simulation, dan Monte Carlo Simulation dalam Rangka Memprediksi Risiko Investasi Pada Properti Periode 2008-2014”*. Jurnal Ekonomi, Manajemen Dan Perbankan, Vol. 2 No. 1 April 2016
- Maruddani, Di Asih I Dan Purbowati, Ari. (2009). *“Pengukuran Value at Risk Pada Asset Tunggal dan Potofolio Dengan Simulasi Monte Carlo (Studi Kasus Pt. Telekomunikasi Dan Pt. Astra International)”*. Media Statistika. Vol. II, No. 2.
- Morgan, J.P. (1996). *“Risk Metrics Technical Document Fourth Edition”*. New York
- Prasetyo, Yoyok. (2018). *“Perbandingan Risiko dan Return Investasi Pada Indeks LQ 45 dengan Indeks Jakarta Islamic Index (JII)”*. Jurnal Ekonomi Islam. Islamic Economic S Journal Vol. 6 No. 2
- Penza, Pietro dan Bansal, Vipul K. (2001). *“Measuring Market with Value at Risk”*. New York: John Wiley & Sons, Inc.
- Purnomo, Herdaru. (2018). *“Dalam Lima Bulan 2018 Risiko Investasi RI Melambung”*. Diakses 25 Maret 2019: <http://www.cnbcindonesia.com/market>
- Rahma, Riska. (2018). *“Tahun 2017, Unilever Indonesia Catat Kenaikan Laba 9,6%”*. Diakses Februari 2019: <http://www.kontan.co.id/news>
- Rahmita, Yulia. (2012). *“Analisis Validitas Var Dalam Pengukuran Risiko Nilai Tukar Terkait Arah Implementasi Stressed Var Pada Revisi Basel II”*. Tesis Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia
- Sari, Nila Nurmala. (2014). *“Analisis Risiko Estimasi Value at Risk (VAR) Model Volatilitas Asymmetric GJG dan GJR (GJR) Pada Jakarta Islamic Index”*. Skripsi UIN Sunan Kalijaga Yogyakarta
- Sekaran, Uma. (2009). *“Research Method for Business: Metodologi Penelitian untuk Bisnis. Edisi 4. Buku 1”*. Jakarta: Salemba Empat
- Silalahi, Ulber. (2009). *“Metode Penelitian Sosial”*. Bandung: PT. Refika Aditama

Sofiana, Nita. (2011). “*Pengukuran Value at Risk pada Portofolio dengan Simulasi Monte Carlo (Studi Kasus: Harga Penutupan Saham Harian PT. Telekomunikasi Indonesia Tbk dan PT. Unilever Indonesia Tbk Bulan Januari – Desember 2010)*”. Skripsi Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam Universitas Negeri Yogyakarta

Sugiyono. (2014). “*Metode Penelitian Pendidikan Pendekatan Kuantitatif, Kualitatif, dan R&D*”. Bandung: Alfabeta

Suhadi. (2012). “*Evaluasi Perhitungan Value at Risk dengan Simulasi Monte Carlo Dan Simulasi Hitoris pada Tiga Bank Badan Usaha Milik Negara (BUMN)*”. Skripsi Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia

Sukiyanto, Safitri Setyo Utami. (2011). “*Penentuan Nilai Risiko (Value at Risk) Portofolio Optimum Saham LQ45 Dengan Pendekatan Ewma*”. Skripsi. Fakultas Ekonomi Dan Bisnis, Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah

Susanti dan Sahyunan. (2013). “*Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Saham dengan Menggunakan Model Index Tunggal Studi Pada Saham LQ45 di BEI Periode Agustus 2009-2012*”. Jurnal Media Informasi Manajemen, Volume 1. No. 4

Sunaryo, T. (2007). “*Manajemen Risiko Finansial*”. Jakarta: Salemba Empat

Tandelilin, Enduardus (2010). “*Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi*”. Yogyakarta: Kanisius

Tarlan, Shefa. (2016). “*Analisis Volatilitas dan Value at Risk Pada Sukuk Indonesia dengan Menggunakan Model ARCH/GARCH*”. Skripsi. Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah

Wicaksono, Bayu Hayadi. (2014). “*Perbandingan Metode Variance Covariance dan Historical Simulatiom untuk Mengukur Risiko Investasi Reksadana*”

Wirayani, Prima. (2018). “*Lonjakan Laba Bawa Saham Induk Google Melesat*”. Diakses 25 Maret 2019: <http://www.cnbcindonesia.com/market>

www.finance.yahoo.com

www.idx.co.id

www.sahamok.com