

Daftar Pustaka

- Adrianto, Achmad Dimas, Khairunnisa, dan Muhammad Azhari. (2018). *“Perhitungan Value at Risk (VaR) dengan Metode Historis dan Monte Carlo pada Saham Sub Sektor Rokok”*. Jurnal Riset Bisnis dan Manajemen Vol.11 No. 1 Februari 2018
- Akbriani, Rosiana. (2015). *“Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Saham dengan Menggunakan Medel Indeks Tunggal”*. Skripsi. Universitas Negeri Yogyakarta
- Akbriani, Rosiana. (2015). *“Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Saham Dengan Menggunakan Model Indeks Tunggal”*. Skripsi. Universitas Negeri Yogyakarta
- Amanda, Tiara Regina. (2019). *“Perhitungan Value at Risk dengan Metode Historical Simulation, Variance Covariance, dan Monte Carlo Simulation (Comparative Study : Perusahaan - Perusahaan yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index)”*. Skripsi. Fakultas Ekonomi Unand
- Anas, Sudijono. (2009). *“Pengantar Statistik Pendidikan”*. Jakarta : Rajawali Pers
- Andi, Dimas. (2018). *“Persepsi Risiko Investasi Indonesia Kian Meningkat, Apa Penyebabnya”*. Diakses 28 April 2020 : <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
- Ary, Tatang Gumanti. (2011). *“Manajemen Investasi - Konsep Teori dan Aplikasi”*. Mitra Wacana Media : Jakarta
- Azwar, Saifuddin. (2007). *“Metode Penelitian”*. Pustaka Pelajar : Yogyakarta
- Basyaib, Fahmi (2007). *“Manajemen Risiko”*. Jakarta : PT Grasindo
- Best, P. (1998). *“Implementing Value at Risk”*. England : John Wiley & Sons, Inc.
- 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

- Djohanputro, Bramantyo. (2008). *“Manajemen Risiko Korporat”* Jakarta : Penerbit PPM
- Fahmi, Irham. (2010). *“Manajemen Risiko: Teori, Kasus, dan Solusi”*. Bandung : Alfabeta
- Farid, Darush, Alireza Rajabipoor Meybodi, dan 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 dengan Metode Value at Risk (VaR) melalui Pendekatan Historical Method (Back Simulation”*. Skripsi. Fakultas Ilmu Matematika Universitas Islam Negeri Sunan Kalijaga Yogyakarta
- Ghozali, Imam. (2007). *“Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS”*. Universitas Diponegoro : Semarang
- 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
- Ikhsan, Aulia, Dwi Ispriyanti, dan Rita Rahmawati. (2014). *“Penggunaan Pendekatan Capital Asset Pricing Model dan Metode Variance-Covariance dalam Proses Manajemen Portofolio Saham Jakarta Islamic Index”*. Jurnal Gaussian, Vol : 3, No. 1
- Indi, Rifka. (2017). *“Analisis Pembentukan dan Pengukuran Risiko Portofolio Optimal Pada Saham LQ 45”*. Skripsi. Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah
- Ismanto, Hadi. (2016). *“Analisis Value at Risk dalam Pembentukan Portofolio Optimal (Studi Empiris pada Saham - Saham yang Terdaftar dalam LQ 45)”*. The 3rd University Research Colloquium 2016

- Jogiyanto. (2008). *“Teori portofolio dan analisis investasi”*. Yogyakarta : BPFE
- Jorion, P. (2007). *“Value at Risk the New Benchmark for Managing Financial (3rd Ed.)”*. USA : Mcgraw Hill
- Jorion, Philippe. (2001). *“Value At Risk: The New Benchmark for Managing Financial Risk”*. 2nd Ed. Mc. Graw Hil. California. North America
- Kahar, Yuskar. (2009). *“Perhitungan Value at Risk Pada Institudi Perbankan Berdasarkan Metode Variance Covariace”*
- Kasidi. (2010). *“Manajemen Risiko”*. Bogor : Ghalia Indonesia
- Kasiram, Moh. (2008). *“Metodologi Penelitian”*. Malang : UIN-Malang Pers
- 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
- Mamduh, M. Hanafi dan Abdul Halim. 2013. *“Analisis Laporan Keuangan”*. Yogyakarta : UNIT PENERBIT DAN PERCETAKAN.
- Morgan, J.P. (1996). *“Risk Metrics Technical Document Fourth Edition”*. New York
- Penza, Pietro dan Bansal, Vipul K. (2001). *“Measuring Market with Value at Risk”*. New York : John Wiley & Sons, Inc.
- Rahmawati, Wahyu Tri. 2020. *“Merosot, Saham Sanurhastra Mitra (MINA) Kena Suspensi”*. Diakses 30 April 2020 : <http://www.investasi.kontan.co.id>
- Rahmita, Yulia. (2012). *“Analisis Validitas Var Dalam Pengukuran Risiko Nilai Tukar Terkait Arahan Implementasi Stressed Var Pada Revisi Bassel IP”*. Tesis Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia
- Rohmaniah, Siti Alfiatur. (2017). *“Calculating of Value at Risk (VaR) with Simulation Monte Carlo (Case Study Stock of PT. XL Axiata Tbk)”*
- Sekaran, Uma. (2009). *“Research Method for Business : Metodologi Penelitian untuk Bisnis. Edisi 4. Buku I”*. Jakarta: Salemba Empat

- Silalahi, Ulber. (2009). *“Metode Penelitian Sosial”*. Bandung : PT. Refika Aditama
- Situmorang, Ria Theresia. 2020. *“Analisis Prospek Saham Grup MAP setelah Laba 2019 Melesat”* Diakses 30 April 2020 : <http://www.Bisnis.com>
- 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
- 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
- Tjiptono. (2001). *“Manajemen Pemasaran dan Analisa Perilaku Konsumen”*. Yogyakarta : BPFE
- Wicaksono, Bayu Hayadi. (2014). *“Perbandingan Metode Variance Covariance dan Historical Simulatiom untuk Mengukur Risiko Investasi Reksadana”*
- Wijaya, Ariyadi. (2012). *“Pendidikan Matematika Realistik, suatu Alternatif Pendekatan Pembelajaran Matematika”*. Yogyakarta : Graha Ilmu
- www.finance.yahoo.com
- www.idx.co.id
- www.sahamok.com