

DAFTAR PUSTAKA

- Ariany, Farida., Kuswanto, Heri., & Suhartono. (2012). *Estimasi Value at Risk pada Portofolio Nilai Tukar Mata Uang dengan Pendekatan Copula*. Jurnal Sains dan Seni ITS, Vol. 1, No. 1, pp. 265-270.
- Balibey, Mesut, & Turkyilmaz, Serpil. (2014). *Value-at-Risk Analysis in the Presence of Asymmetry and Long Memory: The Case of Turkish Stock Market*. International Journal of Economic and Financial Issues, Vol. 4, No. 4, pp. 836-848.
- Brigham, Eugene F., & Houston, Joel F. (2010). *Dasar-dasar Manajemen Keuangan* (Edisi 11). Jakarta: Salemba Empat.
- Chan, N. H., & Wong H. Y. (2013). *Handbook of Financial Risk Management, simulation and case study*. New Jersey: Wiley.
- Cooper, D.R., & Schindler, P.S. (2008). *Business Reaserch Methods* (10th Edition). New York: McGraw Hill.
- Darmawi, H. (2016). *Manajemen Risiko* (Edisi 2). Jakarta: Bumi Aksara.
- Darmawi, H. (2002). *Manajemen Risiko*. Jakarta: Bumi Aksara.
- Fadhila, Hasna (2013). *Analisis Tingkat Risiko Menggunakan Model Value at Risk (VaR) setelah Krisis Global 2008 Studi Kasus Saham Bank Mandiri, Bank BRI, dan Bank BNI pada Tahun 2009-2011*. Institut Manajemen Telkom: Tidak diterbitkan.
- Fahmi, Irham. (2014). *Manajemen Risiko: Teori, Kasus, dan Solusi*. Bandung: Alfabeta.
- Fauziyah, Nur A. (2014). *Analisis Risiko pada Portofolio Syariah dengan Pemodelan Value at Risk (VaR) Block Maxima – Generalized Extreme Value*. Jurnal Konvergensi, Vol. 4, No. 1, pp. 53-60.
- Gitman, L. J. (2009). *Principles of Managerial Finance*, 12th Edition. USA: Pearson International Edition.
- Haryanto, Anton S. (2015). *Analisis Perhitungan Value at Risk (VaR) dengan Metode Historis dan Variansi Kovariansi serta Penerapannya dalam Portofolio*. Skripsi pada FI Telkom University: tidak diterbitkan.
- Halim, Abdul. (2015). *Analisis Investasi Aset Keuangan*. Jakrta: Mitra Wacana Media.
- Hidayat, Taufik. (2010). *Buku Pintar Investasi, Reksadana, Saham, Opsi Saham, Valas & Emas*. Jakrta: Mediakita.

- Jorion, Philippe. (2007). *Value at Risk, The New Benchmarking for Managing Financial Risk* (3rd Edition). USA: McGraw Hill.
- Juido, Kevin, & Pasaribu, Rowlan B. (2013). *Value at Risk Portofolio Saham Likuid: Kapitalisasi Besar dan Kapitalisasi Kecil (Studi Kasus Saham LQ-45 di BEI Januari 2011 – Desember 2012)*. Proceeding PESAT, Vol. 5, pp. 235-241.
- Keown et. al. (2008). *Manajemen Keuangan: Prinsip dan Penerapan*, (Edisi Kesepuluh, Jilid 1). Jakarta: Indeks.
- Latumaerissa, Julius R. (2012). *Bank dan Lembaga Keuangan Lain*. Jakarta: Salemba Empat.
- Maringga, Firdaus (2015). *Perhitungan Value at Risk untuk Portfolio Saham dengan Metode Varian-Kovarian dan Simulasi Monte Carlo, Studi Kasus Harga Penutupan Saham Harian LQ-45 Bulan Agustus 2013 sampai Januari 2014*. Skripsi pada Prodi Ilmu Komputasi Telkom University: tidak diterbitkan.
- May, Ellen. (20, Januari 2016). Jokowi Kebut Infrastruktur, Saham Konstruksi Menguat. *DetikFinance*. Diakses tanggal 25 September 2016, <http://finance.detik.com/marketresearch/d3122354/jokowikebutinfrastruktur-sahamkonstruksimenguat>
- Mohamed, Amaraja M., Ismail, Nouriszura, & Razali, Ahmad M. (2012). *A comparative study on value at risk and conditional value at risk with an application to the Malaysian financial market*. African Journal of Business Management, Vol. 6 (10), pp. 3767-3778.
- Noor, Henry F. (2009). *Investasi, Pengelolaan Keuangan Bisnis dan Pengembangan Ekonomi Masyarakat*. Jakarta: Indeks.
- Poornima, BG., Reddy, Y Srujan., & Reddy YV. (2014). *Indian Currency Market Risk Analysis: Value at Risk Approach*. The IUP Journal of Financial Risk Management, Vol. XI, No. 4, pp. 45-56.
- Pratama, I Gede AD., Dharmawan, Komang, & Harini, Luh PI. (2015). *Penentuan Nilai Value at Risk pada Saham IHSG Menggunakan Model Geometric Brownian Motion dengan Lompatan*. E-Jurnal Matematika, vol. 4 (2), pp. 67-73.
- Putri, Nurisalma A., Hoyyi, Abdul, & Safitri, Diah. (2013). *Pengukuran Value at Risk menggunakan Prosedur Volatility Updating Hull and White berdasarkan Exponentially Weighted Moving Average*. Jurnal Gaussian, Vo. 2, No. 4, pp. 351-359.

- Salazar, Jesus R., & Tella Roberto. (2015). *Portfolio Construction Based on Implied Correlation Information and Value at Risk*. EconoQuantum, Vol. 12, No. 1, pp. 125-144.
- Saputra, Noval (2016). *Pengukuran Risiko Untuk Perbankan Pemerintah Indonesia Menggunakan Value at Risk Dengan ARMA dan GARCH Berbasis Basel III (Studi Kasus pada perusahaan BUMN bidang Perbankan yang Go Public Periode Oktober 2013 – Mei 2015)*. Skripsi pada FEB Telkom University: tidak diterbitkan.
- Saunders, M., Lewis, P., & Thornhill, A. (2009). *Research Methods for Business Students* (5th Edition). England: Pearson Education.
- Sekaran, Uma. (2011). *Research Methods for Business* (Edisi 4). Jakarta: Salemba Empat.
- Suwandi, Putri Anggi P. (2010). *Kajian Manajemen Risiko pada Proyek dengan Sistem Kontrak Lump Sum dan Sistem Kontrak Unit Price (Studi Kasus pada Proyek Jalan dan Jembatan, Gedung, Bangunan, Bangunan Air)*. Tesis. Penerbit: Eprints UNDIP.
- Widoatmodjo, Sawidji. (2015). *Pengetahuan Pasar Modal*. Jakarta: Kompas Gramedia.
- Yoshita, Kaifu (2013). *Pengukuran Value at Risk pada Investasi Saham Melalui Pendekatan Simulasi Historis dan Simulasi Monte Carlo (Studi Kasus pada Perusahaan BUMN bidang Perbankan yang Go-Public Periode Mei 2011 – Mei 2013)*. Skripsi pada FEB Telkom University: tidak diterbitkan.
- Yovanda, Yanuar R. (12 Oktober 2016). ASMI Terbitkan Obligasi Rp30 Triliun untuk Pembangunan Infrastruktur. *Sindonews*. Diakses tanggal 1 November 2016, dari <http://ekbis.sindonews.com/read/1146727/32/smiterbitkanobligasirp30triliununtukpembangunaninfrastruktur147628487>