

Daftar pustaka

- Arikunto, Suharsini. 1996. *Prosedur Penelitian: Suatu Pendekatan Praktek*. PT. Rienaka Cipta. Jakarta.
- Anoraga, Panji. 2000. *Pengantar Pasar Modal*. PT.Rineka Cipta. Jakarta.
- Buchdadi, Agung D. 2007. *Penghitungan Value at Risk Portofolio Optimum Saham Perusahaan Berbasis Syariah Dengan Pendekatan EWMA*. Sekolah Tinggi Manajemen PPM.
- Fakhrudin, M. dan Sopian M Hadianto. 2001. *Perangkat dan Model Analisis Investasi di Pasar Modal*. PT Elex Media Komputindo. Jakarta.
- Fakhrudin, Hendi. M. 2008. *Istilah Pasar Modal A-Z*. PT Elex Media Komputindo. Jakarta.
- Fardiansyah, Teddy. 2006. *Penerapan Manajemen Risiko Perbankan Indonesia*. PT Elex Media Komputindo. Jakarta.
- Furchan, Arief. 2004. *Pengantar Penelitian Dalam Pendidikan*. Pustaka Pelajar. Yogyakarta.
- Halim, A. 2005. *Analisis Investasi*. Edisi kedua. Salemba Empat. Jakarta.
- Hanafi, Mamduh M. 2007. *Manajemen Risiko*. Yogyakarta, Sekolah Tinggi Ilmu Manajemen YKPN.
- Hartono, Jogiyanto. 2000. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi kedua. Yogyakarta: BPPE.
- Hartono, Jogiyanto. 2010. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yokyakarta,BPFE-Yokyakarta.
- Husnan, S. 2001. *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Edisi Ketiga. Unit penerbit & percetakan AMP YKPN. Yogyakarta.
- Husnan, S. 1998. *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Edisi Pertama. Unit penerbit & percetakan AMP YKPN. Yogyakarta.
- http://ilerning.com/index.php?option=com_content&view=article&id=2616:rmacam-macam-probabilitas-edit-mar&catid=37:pengantar-statistika-inferensial&Itemid=70 tanggal 18 Desember 2012.

- Jorion, Philippe. 2001. *Value at Risk: New Benchmark for Managing Financial Risk*. Mc Graw-Hill USA.
- Kahar, Yuskar. 2009. *Perhitungan Value at Risk Pada Institusi Perbankan Berdasarkan Metode Variance Covariance*. Akuntabilitas, Maret 2009. hal. 160-181 Vol. 8, No. 2 ISSN 1412-024.
- Khairunnisa, Dyah. 2007. *Penghitungan Taksiran Value at Risk Dengan Metode Simulasi Historis*. Depok, Universitas Indonesia Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Umum.
- Maruddani dan Purbowati. 2009. *Pengukuran Value at Risk Pada Aset Tunggal dan Portofolio Dengan Simulasi Monte Carlo*. Media Statistika, Vol. 2, No. 2, Desember 2009: 93-104.
- Nainggolan, hady, suhardy. 2007. *Economic Value Added dan Implikasinya terhadap Pergerakan Harga Saham Properti di Bursa Efek Indonesia*. Jurnal Akuntansi dan Keuangan.
- Nazir, M. 1988. *Metode Penelitian*. Ghalia Indonesia. Jakarta.
- Nestiana, Desti. *Analisis Perbandingan Tingkat Risiko Investasi pada Bank BUMN dan Bank Swasta dengan Menggunakan Value at Risk (VaR)*. Fakultas Ekonomi Universitas Padjajaran. Bandung.
- Nurhayanto. 2011. *Analisis Risiko Pasar Portofolio Investasi Saham Dengan Metode Value at Risk*. Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia. Jakarta.
- Pohan, Daulat H.H. 2004. *Estimasi Volatilitas Return Reksadana Saham Sebagai Pertimbangan Keputusan Investasi (Perbandingan Model EWMA dan GARCH)*. Karya Akhir. MMUI. Jakarta.
- Riano Karahap, Andi. 2005. *Perhitungan Value at Risk-Foreign Enchange Risk Menggunakan Pendekatan EWMA, GARCH, dan Monte Carlo Simulation (Studi Kasus Bank X)*. Karya Akhir MMUI. Jakarta.
- Rosyidah, Nur. 2009. *Analisis Fundamental dan Risiko Sistematis Terhadap Harga Saham*. Fakultas Ilmu Sosial dan Ilmu Politik Universitas Lampung. Bandar Lampung.
- Rusdin. 2005. *Pasar Modal*. Cetakan Kesatu, Penerbit ALFABETA. Bandung.
- Samsul, Mohamad. 2006. *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Erlangga. Jakarta.

- Sartono, R Agus. 1997. *Manajemen Keuangan*. Edisi ketiga. BPFE Yogyakarta. Yogyakarta.
- Sartono, R Agus. 2006. *VaR Portofolio Optimal: Perbandingan Antara Metode Markowitz dan Mean Absolute Deviation*, *Fakultas Ekonomi Universitas Gadjah Mada*, JSB Vol. 11 No. 1.
- Siamad, Dahlan, 2004. *Manajemen Lembaga Keuangan*. Edisi Keempat, Edisi Keempat, Lembaga Penerbit Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia.
- Situngkir H. dan Surya Y. 2006. *VaR yang Memperhatikan Sifat Statistika Distribusi Return*. Bandung FE Institute. Bandung.
- Sundjaja, Ridwan S dan Barlian, Inge. 2003. *Manajemen Keuangan Jilid 2*. Literata Lintas Media. Jakarta.
- Tambunan, Andy Porman. 2008. *Menilai Harga Wajar Saham*. PT Elex Media Komputindo. Jakarta.
- Tandelilin, Eduardus. 2010. *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Edisi Pertama, Kanisius. Yogyakarta.