

## DAFTAR PUSTAKA

- Buchdadi, A. D. (2007). Perhitungan Value at Risk Portofolio Optimum Saham Perusahaan Berbasis Syariah dengan Pendekatan EWMA. *Jurnal Akuntansi dan keuangan Indonesia*.
- Darmawi, H. (2013). *Manajemen Risiko*. Jakarta: Bumi Aksara.
- Devi, S. S. (2010). *Analisis Risiko Portofolio dengan Metode Varians Kovarians*. Yogyakarta: Universitas Negeri Yogyakarta.
- Fahmi, I. (2010). *Manajemen Risiko Teori, Kasus, dan Solusi*. Bandung: Alfabeta.
- Fauziah, N., Hoyyi, A., & Maruddani, D. I. (2012). Risiko Kredit Portofolio Obligasi dengan Credit Metrics dan Optimalisasi Portofolio dengan Metode Mean Variance Efficient Portofolio (MVEP). *Jurnal Gaussian*, 159-168.
- Gujarati, D. N. (2004). *Basic Econometrics; Fourth Edition*. The McGraw-Hill Companies.
- Hadi, Y. L., & Fahmi, I. (2009). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Bandung: Alfabeta.
- Holton, G. A. (2003). *Value-at-Risk; Theory and Practice*. California: Academic Press.
- Husnan, S. (1998). *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan AMP YKPN.
- Jorion, P. (2007). *Financial Risk Manager Handbook Fourth Edition*. New Jersey: John Wiley & Sons, Inc.
- Rudiyanto. (2012, Maret 11). *Rudiyanto, Mengenal Cara Kerja Obligasi (2) : Analisa Risiko Harga dan Gagal Bayar Obligasi*. Dipetik Maret 5, 2014, dari Rudiyanto, Berbagai Tentang Perencanaan Keuangan dan Investasi: <http://rudiyanto.blog.kontan.co.id/2012/03/11/mengenal-cara-kerja-obligasi-2-analisa-risiko-obligasi/>

**Faizal Rachman, 2014**

*Penerapan metode Exponentially Weighted Average (EWMA) dan metode semi varians (SV) dalam perhitungan risiko portopolio saham optimal*  
Universitas Pendidikan Indonesia | repository.upi.edu

- Saiful, H., Weng, H., & Zaidi, I. (2011). Different Downside Risk Approaches In Portfolio Optimisation. *Journal of Quality Measurement and Analysis*, 77-84.
- Somantri, A. (2010). *Pengukuran Risiko Kredit Obligasi Korporasi dengan Credit Value at Risk (CVAR) dan optimalisasi portofolio menggunakan metode Mean Variance Efficient Portofolio (MVEP)*. Semarang: Universitas Diponegoro.
- Sukiyanto, S. S. (2011). *Penentuan Nilai Risiko (VaR) Portofolio Saham LQ45 dengan Pendekatan EWMA*. Jakarta: UIN Syarif Hidayatullah.
- Wahyuni, S. (2013). *Perbandingan Optimisaasi Portofolio Metode Mean-Variance dengan Metode Mean-Semivariance*. Yogyakarta: Universitas Atmajaya.
- Wijiharti, D. S. (2011). *Pengukuran risiko Portofolio Investasi Menggunakan Value at Risk*. Bandung: Institut Teknologi Bandung.
- Zubir, Z. (2012). *Portofolio Obligasi*. Jakarta: Penerbit Salemba Empat.

**Faizal Rachman, 2014**

*Penerapan metode Exponentially Weighted Average (EWMA) dan metode semi varians (SV) dalam perhitungan risiko portopolio saham optimal*  
Universitas Pendidikan Indonesia | [repository.upi.edu](https://repository.upi.edu)