

DAFTAR PUSTAKA

- Adiakso, P. (2011). *ANALISIS INDIKATOR EKONOMI YANG MEMPENGARUHI YIELD-TO-MATURITY (YTM) OBLIGASI PEMERINTAH INDONESIA MENGGUNAKAN METODE PANEL DATA*. Bandung.
- anonymous. (2015, July 9). Dipetik December 16, 2015, dari http://orb.essex.ac.uk/ec/ec372/lecture_notes/volatility.pdf
- Artzner, P., & Delbaen, F. (1998). *Coherent Measures of Risks*.
- Boutelle, S., & Pushner, D. (2012). *The Handbook of Credit Risk Management: Originating, Assessing, and Managing Credit Exposures*. Wiley.
- Bursa Efek Indonesia. (2010). Diambil kembali dari www.idx.co.id/home/information
- Darmawi, H. (2005). *Manajemen Risiko*. Jakarta: Bumi Aksara.
- Elizalde, A. (2005). *Credit Risk Models II: Structural Models*. Madrid: CEMFI.
- Giesecke, K. (2004). *Credit Risk Modeling and Valuation : An Introduction*. London.
- Gitman, L. J. (2011). *Principle of Managerial Finance*. Pearson Australia.
- Hull, J. C. (2006). *Options, Futures, and Other Derivatives*. Upper Saddle River: Prentice Hall.
- Husnan, S. (2005). *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: Unit penerbit & percetakan AMP YKPN.
- Indonesia, B. E. (t.thn.). Diambil kembali dari www.idx.co.id/home/information
- Indonesia, B. E. (2010). *Obligasi*. Diambil kembali dari [idx.co.id](http://www.idx.co.id)
- Jogiyanto. (2000). *Teori Prtfolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPPE.
- Jorion, P. (2007). *Value at Risk : The New Benchmark for Managing Financial Risk*. New York: McGraw-Hill.
- Morgan, J. P. (1996). *Risk Metrics*.
- Ross, S. M. (1996). *Stochastic Process*. New York: John Wiley & Sons.
- Sigman, K. (2005). Dipetik Desember 2015, dari <http://www.columbia.edu/~ks20/FE-Notes/4700-07-Notes-portfolio-I.pdf>
- Sundjaja, R., & Barlian, I. (2001). *Manajemen Keuangan*. Jakarta: Pronhallindo.
- Tandelilin, E. (2007). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Yogyakarta: BPPE.
- Lydia Zayyani Alfyyati, 2016**
PENGUKURAN RISIKO KREDIT OBLIGASI PENDEKATAN FIRST PASSAGE TIME DAN OPTIMISASI PORTOFOLIO DENGAN MEAN VARIANCE EFFICIENT PORTFOLIO
 Universitas Pendidikan Indonesia | repository.upi.edu | perpustakaan.upi.edu

