

DAFTAR PUSTAKA

- Agus, Sartono, 2006, Manajemen Keuangan : Teori dan Aplikasi, edisi keempat, cetakan pertama, penerbit : BPFE, Yogyakarta
- Alexander, Carol. (Editor). (2001). Operational Risk. Prentice Hall.
- Ang, Robert (1997), Buku Pintar Pasar Modal Indonesia, Jakarta, Mediasoft Indonesia.
- Arikunto, S. (2009). Prosedur Penelitian Suatu Pendekatan Praktek. Jakarta: Rineka Cipta.
- Asep hermawan. 2009. Penelitian Bisnis. Jakarta : PT. Grasindo
- Best, Philip. (1999). Implementing *Value at Risk*. Chicester: John Wiley & Sons.
- Butler, Cormac (1999), Mastering *Value at Risk: A Step-By-Step guide to Understanding and Applying VaR*, Prentice Hall Inc, New Jersey, London, Inggris
- Stambaugh, F. 1996. *risk and Value at Risk*. european Management Journal. Vol14, pp.612-621.
- Brigham dan Houston. 2010. Dasar-dasar Manajemen Keuangan (Edisi 11). Jakarta: Salemba Empat.
- Candra, Susi Kartika. (2011). Analisis Value At Risk Untuk Pengukuran Volatilitas Dan Risiko Pasar Sebagai Dasar Pengambilan Keputusan Pada Kontrak Berjangka Olein Di Jakarta Futures Exchange Periode 2010-2013
- Cheng-Te Chen, H.-C. C.-S. (2007). Forecasting *Value at Risk (VAR)* in the futures market using Hybrid method of Neural Networks and GARCH model.
- Choudhry, Moorad. 2006. An Intoduction to *Value at Risk*, Fourth Edition. John Wiley & Sons, Ltd. The Atrium, Southern Gate, Chichester, England.
- Christianti, A. (2010). Risiko Pasar: Perbandingan Model EWMA dan GARCH Pada Nilai Tukar Rupiah Terhadap Us Dollar.
- Crouhy, Michel et al. 2001. *Risk Management-Comprehensive Chapter on Market, Credit and Operational Risk*. Mcgraw Hill. NewYork.
- Cruz, M.G.2003. Modeling Measuring and Hedging Operational *Risk* Englanad. John Willey & Sons Ltd.

Culp, Christopher L. (2001). *The Risk Management Process*. Singapore. John Willey
& Sons Ltd.

- Darmawi, Hermawan (2005) "Manajemen Risiko" Jakarta, PT. Bumi Aksara
- D. Mphil Nachrowi, Hardius Usman, Pendekatan Populer dan Praktis Ekonometrika untuk Analisis Ekonomi dan Keuangan, 2006.
- Eliyawati, W. Y. (2014). Penerapan Model Garch (Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity) Untuk Menguji Pasar Modal Efisien Di Indonesia (Studi pada Harga Penutupan (Closing Price) Indeks Saham LQ 45 Periode 2009-2011).
- Enders, Walter. (2004). Applied Econometric Time Series. New York : John Wiley
- Fahmi, Irham dan Yovi Lavianti Hadi. 2009. Teori Portofolio dan Analisis Investasi. Bandung: Alfabeta
- Firmansyah. (2006). Analisis Volatilitas Harga Kopi Internasional. 17
- Griffin, W. R., 2002, Manajemen, Jilid I, Erlangga, Jakarta. Hartono, Jogiyanto. (2007). Teori Portofolio dan Analisis Investasi Edisi 2007. BPFE. Yogyakarta.
- Gujarati, Damodar N. (2010). Dasar-Dasar Ekonometrika (Buku 1, edisi ke-5). Jakarta: Salemba Empat.
- Hanafi, M. 2006. Manajemen Risiko. Yogyakarta: Unit Penerbit Dan Percetakan Sekolah Tinggi Manajemen YKPN.
- Harry, Suwanda. (2001). Tetap Untung Ketika Saham Turun. Jakarta: PT. Gramedia Pustaka Utama
- Hull, John C. 2006. Option, Futures, & Other Derivatives. Fift Edition. Prentice Hall. [HJ]
- Husein Umar, 2005. Metode Penelitian. Jakarta : Salemba Empat
- Jogiyanto. 2000. Teori Portofolio dan Analisis Investasi. Edisi keenam. Yogyakarta: BPFE.
- Jorion, Philippe. (2001). Financial Risk Manager Handbook, Chichester: John Wiley & Sons Ltd.
- Jorion, Philipe. (2002). *Value at Risk*, second edition. New York. Mc. Grawhill Co.
- Jorion Philippe. (2007). Fourth Edition, Value At Risk, Mc Graw-Hill Co.

Kuncoro, Mudrajad. (2009). Metode Riset Untuk Bisnis dan Ekonomi. Jakarta :
Erlangga

Setia Akbar, 2016

*PENGUKURAN VALUE AT RISK DENGAN ESTIMASI VOLATILITAS MENGGUNAKAN METODE
GENERALIZED AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL HETEROSKEDASTICITY (GARCH)*

Universitas Pendidikan Indonesia | repository.upi.edu | perpustakaan.upi.edu

- Manganelli, S., dan Engle, R. F. (2001). *Value at Risk Models in Finance*. Working Paper no 75 European Central Bank (ECB) Germany.
- Manurung. (2005). Volatilitas Pasar di Bursa Efek Indonesia periode 1998 sampai dengan Juni 2005 dengan menggunakan model ARCH dan GARCH.
- Margaretha, Farah. 2007. *Manajemen Keuangan Bagi Industri & Jasa*. Grasindo. Jakarta.
- Martono dan D. Agus Harjito. (2002). *Manajemen Keuangan*. Yogyakarta: Ekonosia.
- Morgan, J.P. (1996) : *Risk Metrics - Tehnical Document*, 4th edition, New York.
- Nachrowi, Djalal Nachrowi, Hardius Usman. 2006. *Pendekatan Populer dan Praktis Ekonometrika untuk Analisis Ekonomi dan Keuangan*, Lembaga Penerbit Universitas Indonesia, Jakarta
- Nainggolan, R. P. (2008). Penerapan Model ARCH/GARCH pada Perhitungan Volatilitas Saham Produsan CPO.
- Oei, Istijanto. 2009. *Kiat Investasi Valas, Emas, Saham*. PT. Ikrar Mandiri: Jakarta
- Ruppert, D. 2004. *Empirical Methods in Financial Engineering*. New York : Springer.
- Santoso, Habib Dwi dan Andri Prastiwi, 2012. “Analisis Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Kebijakan Dividen”, *Jurnal Akuntansi Universitas Diponegoro*, Volume 1 Nomor 1, hal 1-12.
- Schwert, G.W. dan Clifford W. Smith, Jr. (1992). *Empirical Research in Capital Market*, McGraw-Hill, Inc, USA.
- Sensarma R., Jayadev. M. (2009). Are Bank Stock Sensitive to Risk Management?. *Journal of Risk Finance*. Vol 10 No. 1. Hal 7-22.
- Suad Husnan, 2003, *Manajemen Keuangan Teori dan Penerapan (keputusan Jangka Pendek)*, Edisi keempat, BPFE, Yogyakarta
- Sugiyono. 2010. *Metode Penelitian Kuantitatif dan Kualitatif dan R & D*. Bandung : CV.Afabeta
- Tandelilin, Eduardus. 2010. *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi*. Edisi pertama. Yogyakarta : Kanisius.
- Waruwu, Sonia. (2014). *Analisis Value At Risk Untuk Pengukuran Volatilitas Dan Risiko Pasar Sebagai Dasar Pengambilan Keputusan Pada Kontrak Berjangka Olein Di Jakarta Futures Exchange Periode 2010-2013*.

Setia Akbar, 2016

PENGUKURAN VALUE AT RISK DENGAN ESTIMASI VOLATILITAS MENGGUNAKAN METODE GENERALIZED AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL HETEROSKEDASTICITY (GARCH)

Universitas Pendidikan Indonesia | repository.upi.edu | perpustakaan.upi.edu

Zikmund, William G., et al. (2010). *Business Research Methods (eight edition)*.
SouthWestern, USA: Cengage Learning.

Sumber lain :

<http://www.ift.co.id>

<http://www.sahamok.com>

<http://www.yahoo.finance.com>

Setia Akbar, 2016

**PENGUKURAN VALUE AT RISK DENGAN ESTIMASI VOLATILITAS MENGGUNAKAN METODE
GENERALIZED AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL HETEROSKEDASTICITY (GARCH)**

Universitas Pendidikan Indonesia | repository.upi.edu | perpustakaan.upi.edu

