

DAFTAR PUSTAKA

- Amanda, W. B. B. A., & Pratomo, W. A. (2013). Analisis Fundamental dan Resiko Sistematis Terhadap Harga Saham Perbankan yang Terdaftar Pada Indeks LQ 45. *Jurnal Ekonomi dan Keuangan*, 1(3), 14728.
- Azizah, S., Sugito., dan Prahutama, A.2014. Pengukuran Kinerja Portofolio Saham Menggunakan Model Black-Litterman Berdasarkan Indeks Treynor, Indeks Sharpe, dan Indeks Jensen (Studi Kasus Saham-Saham yang Termasuk dalam Jakarta Islamic Index Periode 2009-2013). *Jurnal Gaussian* Vol.3, No.4: 859-868.
- Butler, C. (1999). *Mastering Value at Risk*. New York: Prentice Hall.
- Gito Sudarmo, Indriyo.1999. Manajemen Keuangan. Yogyakarta: BPFE.
- Hadad, M. D., Wibowo, S., Pertiwi, D., & Novianti. (2004). Indeks Saham Perbankan.
- Hartono, Jogiyo. (2016). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi* (Edisi 10). Yogyakarta: BPFE
- Husnan, S. 2001. *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Edisi Ketiga. Yogyakarta : UPP AMP YKPN.
- Iksan C.B., dan Nur M.A . (2020). Ancaman krisis ekonomi global dari dampak penyebaran virus corona (covid-19). Vol 17 No 1.
- Jorion, P. 2006. *Value at Risk: The New Benchmark for Managing Financial Risk*. Third Edition. Singapore: McGraw-Hill International Edition.
- Khaerunnisa, R., & Situmorang, B. (2024, Mei 13). OJK: Kinerja industri perbankan nasional tetap resilien dan stabil. Antara News.
- Lubis, Rafi Ramadhan. 2023. Analisis Perbandingan Metode Variance-Covariance, Simulasi Historis dan Simulasi Monte Carlo Untuk Perhitungan Nilai Value At Risk (VAR) Aset Tunggal dan Portofolio Optimal Menggunakan Model Indeks Tunggal Terhadap Saham-Saham Sub Sektor Telekomunikasi. Skripsi, Program Studi Matematika, Fakultas Sains dan Teknologi, UIN Starif Hidayatullah Jakarta.
- Minchatur Rohmah, S. (2017). Estimasi Value at Risk dalam Investasi Saham Perusahaan Subsektor Perbankan di Bursa Efek Indonesia dengan Pendekatan Theory. Program Studi Sarjana, Departemen Statistika, Fakultas n Ilmu Pengetahuan Alam, Institut Teknologi Sepuluh Nopember,
- '4). Analisis Value at Risk pada Portofolio Saham IDX30 Metode Variance-Covariance dan Simulasi Historis. Skripsi,



Fakultas Ekonomi dan Bisnis, UIN Syarif Hidayatullah Jakarta.

- Putri, R. D., & Moeliono, N. (2015). Penilaian Harga Saham Subsektor Perbankan dalam Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia Menggunakan Metode Dividend Discount Model. Eproc.
- Situmorang, D. C. Z., Harahap, N. S. D., Noviyana, N., & Arsyadona, A. (2025). Analisis ketidakpastian dan risiko dalam investasi: Pendekatan strategis untuk mitigasi kerugian. *Jurnal Ilmiah Nusantara*, 2(2), 84–95.
- Tandelilin, E. (2001). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Yogyakarta: BPFE.
- Tandelilin, E. (2010). *Portofolio dan Investasi: Teori dan Aplikasi* (Edisi ke-7). Yogyakarta: Kanisius.
- Wahidah, N. R. Nasution, Y. N. Rizki, N. A. 2018. Analisis Value at Risk Portofolio Saham Menggunakan Metode Varian-Kovarian (Studi Kasus: Harga Penutupan Saham Harian PT. Astra Agro Lestari Tbk dan PT. PP London Sumatra Indonesia Tbk bulan Juli-Desember 2016). *Jurnal Eksponensial*, Volume. 9 Nomor. 2. ISSN 2085-7829

