

Daftar Pustaka

- Best, Philip. (1998). *Implementing Value at Risk*. Chicester: John Wiley & Sons.
- Blanchard, Olivier. *Macroeconomics*. 4th Edition, Pearson Prentice Hall, 2006.
- Bodie, Kane & Marcus. (2008). *Investments* (7th ed.). New York: McGraw-Hill.
- Butler, Cormac. *Mastering Value at Risk*. Pearson Prentice Hall, 1999.
- Crouchy, Galai & Mark. (2001). *Risk Management*. New York: McGraw-Hill
- Eviews 4 User's Guide. (2000). Quantitative Micro Software, LLC, USA. Management.
- Jorion, Phillippe. (2003). *Financial Risk Manager Handbook* (2nd ed.). New Jersey: John Wiley & Sons.
- Jorion, Phillippe. (2007). *Value At Risk, The New Benchmark For Managing Financial Risk* (2nd ed.). New York: MGrav-Hill.
- Manurung, Adler H. *Lima Bintang Untuk Agen Penjual Reksadana*. Jakarta: Ghalia Indonesia, 2002
- Manurung, Adler H. *Berinvestasi, Pendirian dan Pembubaran Reksadana: Pegangan Untuk Investor dan Manajer Investasi*. Jakarta: PT.Adler Manurung Press, 2003
- Nachrowi, D. Hardius Usman. (2006). *Pendekatan Populer dan Praktis Ekonometrika Untuk Analisis Ekonomi dan Keuangan*. Jakarta: Lembaga Penerbit FEUI
- Penza, Pietro, dan Bansal, Vipul K. *Measuring Market Risk with Value At Risk*. John Wiley & Sons, Inc, 2001.
- Pohan, Daulat. *Estimasi Volatilitas return Reksadana Saham Sebagai Pertimbangan Keputusan Investasi: Perbandingan Model EWMA dengan ARCH/GACRH*, MMUI 2004

- Pindyck, Robert S, dan Daniel L. Rubinfeld. *Econometric Models and Econometric Forecasts*. 4th Edition, McGraw-Hill, 1998.
- Tamba, Jhon Fernando. *Implementasi Model ARCH/GARCH Pada Pengukuran Value at Risk Reksadana Pendapatan Tetap PT.XYZ*. Karya Akhir, Program Magister Manajemen Universitas Indonesia, Jakarta, 2006.
- Undang-Undang No.8 tahun 1995 tentang Pasar Modal
Universitas Indonesia. *Pedoman Teknis Penulisan Tugas Akhir Mahasiswa Universitas Indonesia*. Depok, 2008.
- Winarno, Wing Wahyu. (2007). *Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan Eviews*. Yogyakarta: UPP STIM YKPN
- Sugiarto, Agus. *Prinsip Kehati-hatian Bank Dalam Kegiatan Reksadana*. Kompas, 11 Sept 2003, hal.27
- Dowd, Kevin. *Beyond Value at Risk: The New Science of Risk Management*. Chichester, Wt Sussex John Willey Ltd, 1998