

## DAFTAR REFERENSI

- Accurate. 2020. Pengertian Tentang Saham. Diunduh tanggal 4 Januari 2021, <https://accurate.id/ekonomi-keuangan/pengertian-saham>
- Berry, Y. 2017. Perhitungan Value at Risk dengan Pendekatan Varian-Kovarian. *Jurnal Riset Bisnis dan Manajemen*, Volume. VII No. 2. ISSN 2338-292X.
- Darmadji, Tjiptono dan Hendy, M. Fakhruddin. 2011. *Pasar Modal di Indonesia*. 3<sup>rd</sup>. Jakarta : Salemba Empat.
- Fahmi, Irham. 2013. *Pengantar Manajemen Keuangan*. Jakarta : Salemba Empat.
- Hartono, Jogiyanto. 2013. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. 8<sup>th</sup>. Yogyakarta: BPFE
- Heryani, S. A. 2017. Perhitungan Nilai Risiko Pada Portofolio Optimal: Studi Perbandingan Saham Syariah dan Saham Konvensional. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Islam*, Volume 2, No 1. ISSN 2527-3434.
- Ismanto, H. 2016. Analisis Value at Risk dalam pembentukan portofolio optimal (Studi kasus pada saham-saham yang Tergabung dalam LQ45). *The 3<sup>rd</sup> University Research Colloquium*, 243-255, ISSN 2407-9189.
- Investing, 2018. Pengertian Kapitalisasi Pasar. Diunduh tanggal 22 januari 2021, <https://id.investing.com/analysis/pengertian-kapitalisasi-pasar-200204546>
- Lestdwinanto, H. 2016. Perbandingan Metode Value at Risk antara Metode Risk Metric, Historical Back Simulation, dan Monte Carlo Simulation dalam Rangka Memprediksi Risiko Investasi pada Properti Periode 2008-2014, dari PT. Paramount Land Development. *Jurnal Ekonomi, Manajemen dan Perbankan*, Vol. 2 No.1. ISSN 2302-4119.
- Okezonefinance. 2017. Manfaat Pasar Modal Bagi Perekonomian Negara. Diunduh Tanggal 28 Oktober 2020, <http://economy.okezone.com>
- Pasaribu, R. B. F. 2019. Nilai Risiko dari Strategi Investasi Momentum: Likuid Indonesia Portofolio Saham. *Jurnal Manajemen Indonesia*, Vol. 19(1), hlm. 30-45. ISSN 2502-3713.
- Rafat, M. 2018. Hubungan Interaktif antara Ekonomi Pertumbuhan dan Investasi Asing Langsung (FDI): Analisis VaR. *Jurnal Iran Econ Rev*, Vol. 22 No. 1 hlm. 163-185. ISSN 2441-3974

Republika 2017. Perkembangan Pasar Modal di Indonesia. Diunduh tanggal 28 Oktober 2020, <http://m.republika.co.id>

Suryawati, B. N. Nidhal, L. U. 2016. Nilai Berisiko sebagai Ukuran Risiko Pasar di Pasar Syariah Berkembang: Studi Perbandingan Antar Indeks dalam Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Konferensi Internasional Pertama Studi Asia Tenggara*, Volume 2018. ISSN 2327-5528.

Wahidah, N. R. Nasution, Y. N. Rizki, N. A. 2018. Analisis Value at Risk Portofolio Saham Menggunakan Metode Varian-Covarian (Studi Kasus: Harga Penutupan Saham Harian PT. Astra Agro Lestari Tbk dan PT. PP London Sumatra Indonesia Tbk bulan Juli-Desember). *Jurnal Eksponensial*, Volume. 9 Nomor. 2. ISSN 2085-7829

Website :

<https://pusatis.com/2020/02/04/50-kapitalisasi-pasar-saham-terbesar-indonesia-di-bei-tahun-2019>

<http://britama.com/index.php/2012/06/sejarah-dan-profil-singkat-unvr/>

<http://britama.com/index.php/2012/10/sejarah-dan-profil-singkat-icbp/>

<https://britama.com/index.php/2012/11/sejarah-dan-profil-singkat-hmsp/2/>

<http://britama.com/index.php/2012/11/sejarah-dan-profil-singkat-ggrm/>

<http://britama.com/index.php/2012/11/sejarah-dan-profil-singkat-klbf/>

**Lampiran 1. Daftar lima saham sector consumer goods yang termasuk dalam indeks LQ45**