



DAFTAR PUSTAKA

- Abdullah, M. (2015). *Metode Penelitian Kuantitatif*. (Cetakan 1). Aswaja Pressindo.
- Abdullah, M. F. (2005). *Dasar-dasar Manajemen Keuangan* (Edisi Kedua). Penerbitan Universitas Muhammadiyah.
- Adisetiawan. (2009). Hubungan Tingkat Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia (SBI), Inflasi, Dan Indek Harga Saham Gabungan (IHSG). *BENEFIT Jurnal Manajemen Dan Bisnis*, 13(01), 23–33.
- Alshamali, N., Alawadhi, K. M., Alshamali, M., & Behbehani, F. M. (2021). Value-at-risk (VAR) analysis of the UK banking stocks. *Pressacademia*, 8(4), 190–207. <https://doi.org/10.17261/pressacademia.2021.1530>
- Anam, Choirul, Chumaidi, M., & Muhyiddin, Z. A. (2017). Analysis Value At Risk In Single Asset And Portfolio By Monte Carlo Simulation. *IEESE International Journal of Science and Technology (IJSTE)*, 6(3), 16–24.
- Andes, S. L., Puspitaningtyas, Z., & Prakoso, A. (2017). Jurnal Politeknik Caltex Riau Pengaruh Inflasi , Kurs Rupiah dan Suku Bunga terhadap Return Saham. *Jurnal Akuntansi Keuangan Dan Bisnis*, 10(2), 8–16.
- Ang, R. (1997a). *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia*. Mediasoft.
- Ang, R. (1997b). *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia*. Mediasoft.
- Anoraga, P., & Piji Pakarti. (2006). *Pengantar Pasar Modal*. PT Rineka Cipta.
- Arsyad, L. (1999). *Ekonomi Pembangunan*. (4th ed.). STIE YKPN Yogyakarta.
- Artha, D. R., Achsani, N. A., & Sasongko, H. (2014). Analisis Fundamental, Teknikal Dan Makroekonomi Harga Saham Sektor Pertanian. *Jurnal Manajemen Dan Kewirausahaan*, 16(2). <https://doi.org/10.9744/jmk.16.2.175-184>
- Azzahra, M., Yohani, & Fatah, K. (2023). *Analisis Dampak Sebelum Dan Di Saat Pandemi Covid-19 Terhadap Harga Saham Dan Laba Perusahaan Sub Sektor Transportasi Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia* (Vol. 9, Issue 1). <https://www.idx.co.id>.
- Badan Pusat Statistik. (2024, May). *Jumlah Perusahaan Perkebunan Besar Menurut Jenis Tanaman*.
- Banz, R. (1981). The Relationship Between Return and Market Value of Common Stocks. *Journal of Financial Economics*, IX.
- Banz, R. W. (1981). The Relationship between Return and Market Value of Common Stocks. *Journal of Financial Economics*.
- Basuki, A. T. (2016). *Analisis Regresi dalam Penelitian Ekonomi & Bisnis: Dilengkapi Aplikasi SPSS & Eviews*. Rajawali Pers.
- Bodie, Zie, Kane, A., & Markus, A. J. (2014). *Manajemen Portofolio dan Investasi* (9th ed.).
- Bowman. (1980). A risk/return paradox for strategic management. *Sloan Management Review*, 17–31.
- Brigham, E. F., & J. F. Houston. (2010). *Dasar-Dasar Manajemen Keuangan* (Edisi 11). Salemba Empat.
- Butler, C. (1999). *Mastering Value at Risk*. Prentice Hall.
- Darmadji, T., & Fakhruddin. (2001). *Pasar Modal di Indonesia: Pendekatan Tanya Jawab*. Salemba Empat.
- Darmadji, T., & Fakhruddin. (2011). *Pasar Modal di Indonesia* (Edisi 3). Salemba Empat.
- Darman Saputra, Zukhri, N., Altin, D., Agung Nugroho, A., Daddy Setiawan, R., Fitri, T., & Thohari, M. (2023). Value At Risk Analysis Using Historical Method and Monte Carlo Simulation in Banking and Mining Sector Companies. *International Journal of Applied Management and Business*, 1(1), 26–31. <https://doi.org/10.54099/ijamb.v1i1.436>
- Dendawijaya, L. (2003). *Manajemen Perbankan* (2nd ed.). Ghalia Indonesia.



- Dimas Adrianto, A., & Azhari Khairunnisa, M. (2018). Perhitungan Value at Risk (VaR) Dengan Metode Historis dan Monte Carlo pada Saham Sub Sektor Rokok. In *Jurnal Riset Bisnis dan Manajemen* (Vol. 11, Issue 1). www.sahamoke.com
- Dinas Perkebunan Provinsi Kalimantan Timur. (2021). *Laporan tahunan*.
- Diulio, E. A. (1993). *Uang dan Bank*. Erlangga.
- Fatmawati, E., & Hermafiani, N. (2022). Analisis Pengaruh Makroekonomi Dan Faktor Fundamental Terhadap Harga Saham. *Jurnal Perspektif Manajerial Dan Kewirausahaan (JPMK)*, 3(1). <http://jurnal.undira.ac.id/index.php/jpmk/>
- Gazali, M., Thomas, R., & Mustafa, M. (2022). Garch-M Model And The Behavior Of Risk-Return Relationship In Indonesia Stock Market. *Scientific Journal of Economics and Business*, 19(02).
- Ghozali, I. (2007). *Manajemen Risiko Perbankan, Pendekatan Kuantitatif Value at Risk (VaR)*. Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Hadi, N. (2015). *Pasar Modal* (Edisi 2). Graha Ilmu.
- Halim, A. (2018). *Teori Ekonomi Makro* (3rd ed.). Mitra Wacana Media.
- Hartono, J. (2013). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi* (8th ed.). BPFE.
- Hesniati, & Christina, L. (2018). Analisis Pengaruh Fundamental Dan Makroekonomi Terhadap Harga Saham Emiten Yang Terdaftar Di Lq-45 Bursa Efek Indonesia.
- Humayrah, A., & Prima Sari, D. (2023). Analisis Risiko Investasi Saham Tunggal Syariah dengan Value at Risk Menggunakan Simulasi Monte Carlo. *Journal Of Mathematics UNP*, 8(1), 32–35.
- Iswajuni, I., Manasikana, A., & Soetedjo, S. (2018). The effect of enterprise risk management (ERM) on firm value in manufacturing companies listed on Indonesian Stock Exchange year 2010-2013. *Asian Journal of Accounting Research*, 3(2), 224–235. <https://doi.org/10.1108/AJAR-06-2018-0006>
- Iswardono. (1999). Suku Bunga Diturunkan, Investasi akan Meningkatkan. *Jurnal Ekonomi Dan Bisnis Indonesia*, 14.
- Japlani, A. (2015). Apakah Ukuran Itu Penting? *AKUISISI*, 11(1). www.idx.co.id
- Jogiyanto. (2003). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi* (Edisi Ketiga). BPFE.
- Jogiyanto. (2008). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi* (Edisi kelima). BPFE.
- Jorion, P. (2007). *Value at Risk: The New Benchmark Managing Financial Risk* (Third Edition). The Mc Graw-Hill Companies.
- Kapoh, R. C., Murni, S., & Rate, P. Van. (2019). Analisis Faktor Makroekonomi Terhadap Harga Saham Pada Bank Bumn Devisa Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2010-2018. *Jurnal EMBA*, 7(4), 4927–4934.
- Kartikaningsih, D., Nugraha, & Sugiyanto. (2020). Pengaruh Nilai Tukar Terhadap Harga Saham Sektor Infrastruktur Pada Masa Pandemi Covid-19. *Jurnal Ilmiah Akuntansi Dan Keuangan*.
- Kennedy, P. S. J., Ruth Mote, Humala Situmorang, & Franky Sitorus. (2023). Analisis Beda atas Tingkat Pengembalian dan Risiko Beta Saham Sebelum dan Selama Kasus COVID-19 pada Perusahaan Consumer Goods di BEI Periode 2018-2021. *Jurnal IKRAITH-INFORMATIKA*, 06.
- Khoirunisa, D. D., Afiifudin, & Siti Aminah Anwar. (2022). Analisis Dampak Covid-19 Terhadap Return Saham (Studi Kasus Pada Perusahaan Lq-45). *E-JRA*, 10.
- Koto, M., & Ridho, R. (2019). Analisis Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi Harga Saham Industri Makanan Dan Minuman Di Indonesia.
- Kurniawan, A., & Yuniati, T. (2019). Pengaruh Inflasi, Suku Bunga, Dan Nilai Tukar Terhadap Harga Saham Perusahaan Perbankan. *Jurnal Ilmu Dan Riset Manajemen*.
- Lahi, R., Maria Agustina Kleden, & Robertus Dole Guntur. (2023). Perhitungan Risiko Value at Risk (VaR) Aset Tunggal Menggunakan Pendekatan Metode Simulasi Monte Carlo (Studi Kasus: PT. Indofood CBP Sukses Makmur Tbk dan PT. Astra Internasional Tbk). *Cakrawala Ilmiah*.



- Lutfi, A., & Titik, C. S. (2023). Pengaruh Fundamental Perusahaan Dan Pandemi Covid 19 Terhadap Harga Saham Industri Telekomunikasi Di Indonesia. *Buletin Ekonomika Pembangunan*, 4(1). <https://doi.org/10.21107/bep.v4i1.20138>
- Machfoedz, M. (1994). Financial Ratio Characteristic Analysis and The Prediction of Earnings Changes in Indonesia. *Kelola*, 114–133.
- Mar'ati, F. S. (2013). *Pengaruh Firm Size Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Manufaktur Yang Tercatat Di Bursa Efek Indonesia Periode 2004-2009*.
- Markowitz, H. (1952). Portfolio selection. *The Journal of Finance*, 77–91.
- Maruddani, D. A. I., & Purbowati, A. (2009). Pengukuran Value at Risk pada Aset Tunggal dan Portofolio dengan Simulasi Monte Carlo. *Jurnal Media Statistika*, 2.
- Maruddani Di Asih, & Ari Purbowati. (2009). Pengukuran Value At Risk Pada Aset Tunggal dan Portofolio Dengan Simulasi Monte Carlo. *Media Statistika*, 2.
- Nugroho, A. (2005). *Strategi Jitu Memilih Metode Statistic Penelitian dengan SPSS*. Andi Yogyakarta.
- Prasetiono, D. W. (2010). Analisis Pengaruh Faktor Fundamental Ekonomi Makro Dan Harga Minyak Terhadap Saham Lq45 Dalam Jangka Pendek Dan Jangka Panjang. *Journal Of Indonesian Applied Economics*, 4(1), 11–25.
- Priyatno, D. (2009). *SPSS untuk Analisis Korelasi, Regresi, dan Multivariate*. Gava Media.
- Priyatno, D. (2014). *Mandiri Belajar Analisis Data dengan Spss*. Mediakom.
- Pusat Data dan Sistem Informasi Pertanian Kementerian Pertanian. (2023). *ANALISIS PDB SEKTOR PERTANIAN*.
- Rachmawati, M. (2015). Faktor Makroekonomi Yang Mempengaruhi Pergerakan Harga Saham Pada Indeks Saham Syariah Indonesia (Issi) Di Bursa Efek Indonesia (Bei) 1). *JESTT*, Vol. 2.
- Rachmawati, Y. (2015). Pengaruh Inflasi dan Suku Bunga Terhadap Harga Saham Pada Perusahaan Perbankan Yang Terdaftar Di LQ45 Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Media Akuntansi*, Vol.1(2).
- Reilly, F. K., & C. Brown Keith. (2000). *Investment Analysis and Portofolio Management*. The Dryden Press.
- Robbette, N., & Swanepoel, M. J. (2022). Viability of Risk-return Trade-off within a South African Context. *Journal of Accounting and Investment*, 23(3), 413–430. <https://doi.org/10.18196/jai.v23i3.15037>
- Rosadi, D. (2011). *Analisis Ekonometrika & Runtun Waktu Terapan dengan R*. Andi.
- Rosalee, C., & Suhendah, R. (2023). Pengaruh Covid-19 Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Consumer Goods. *Jurnal Multiparadigma Akuntansi*, 5.
- Rubinstein, R. Y. (1981). *Simulation and Monte Carlo Method*. Willey & Sons.
- Safdar, R., & Yan, C. (2015). Information risk, stock returns, and the cost of capital in China. *China Finance Review International*.
- Sakina, P., & Anwar, F. (2023). Analisis Perbandingan Kinerja Portofolio Saham Pada Kelompok Saham Kapitalisasi Besar Dan Kapitalisasi Kecil Di Bursa Efek Indonesia. *MANIS : JURNAL MANAJEMEN, INOVASI BISNIS DAN SRATEGI*, 1. www.jurnal.usk.ac.id/manis
- Samsul, M. (2006). *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Erlangga.
- Santoso, S. (2010). *Statistik Parametrik*. PT Elex Media Komputindo.
- Sarah, S., & Dasman, H. S. (2023). Analisis Faktor Makro Ekonomi Dan Faktor Internal Rasio Keuangan Terhadap Harga Saham Indeks Lq-45 Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (Bei) Periode 2018-2022. *Journal of Economics and Business UBS*, 12.
- Sari, N. F. (2012). *Analisis pengaruh der, cr, roe, dan tat terhadap return saham*.
- Sartono, & R. Agus. (2008). *Manajemen Keuangan : Teori dan Aplikasi*. BPFE.
- Sugiarto, A. (2011). Analisa Pengaruh BETA, Size Perusahaan, DER dan PBV ratio Terhadap Return Saham. *Jurnal Dinamika Akuntansi*, 8–14.



- Sugiyono. (2005). *Memahami Penelitian Kualitatif*. CV. Alfabeta.
- Sugiyono. (2016). *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif dan R&D*. PT. Alfabet.
- Sugiyono. (2017). *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif, dan R&D*. CV. Alfabeta.
- Suniarti, L. (2019). Analisis Faktor Fundamental Yang Memengaruhi Volatilitas Harga Saham (Study Pada Perusahaan Yang Terdaftar Dalam Index Lq45). *Equator Journal of Management and Entrepreneurship*.
- Susanna, Jessica, & Joceline. (2023). Pengaruh Amihud, Bid-Ask Spread, Case Covid-19, Marcap, Dan Mtb Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Financial Yang Terdaftar Di Bei Selama Covid 2019 (Periode Maret 2020 – Maret 2022). *COSTING: Journal of Economic, Business and Accounting*, 6.
- Sutrisno. (2003). *Manajemen Keuangan* (Ekonosia, Ed.). FE UII Yogyakarta.
- Tandeilin, E. (2017). *Pasar Modal Manajemen Portofolio dan Investasi*. Kanisius.
- Tandelilin, E. (2001). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio* (1st ed.). PT. BPPE.
- Tandelilin, E. (2010a). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio* (Edisi Pertama). BPFE UGM.
- Tandelilin, E. (2010b). *Portofolio dan Investasi: Teori dan Aplikasi* (1st ed.). Kanisius.
- Triyono. (2008). Analisis Perubahan Kurs Rupiah Terhadap Dollar Amerika. *Jurnal Ekonomi Pembangunan*, 09.
- Tursina, A., Aminda, R. S., & Nurhayati, I. (2023). Analisis Value At Risk (VAR) Dengan Metode Historis Dan Monte Carlo Dalam Harga Saham Sub Sektor Bank. *JEBI: Jurnal Ekonomi Dan Bisnis*, 1(5). www.finance.yahoo.com.
- Wahyudi, A. S., Beny, & Daniel. (2020). Analisis Pengaruh Kapitalisasi Pasar Dan Rasio Keuangan Terhadap Return Saham. 12(1), 9–16. <http://jurnaltsm.id/index.php/MB>
- Widarjono, A. (2007). *Ekonometrika: Teori dan Aplikasi Untuk Ekonomi dan Bisnis* (Kedua). Ekonisia FE Universitas Islam Indonesia.
- Wijaya, J. H., & Alwansyah, G. (2023). Analisis Pertumbuhan Ekonomi Indonesia Terhadap Harga Saham Perbankan Periode 2010-2021: Sebagai Pertimbangan Investasi Jangka Panjang Pada Sektor Perbankan. *Jurnal Ilmiah Akuntansi Dan Keuangan*, 5(8). <https://journal.ikopin.ac.id/index.php/fairvalue>
- Winarno, W. W. (2015). *Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan Eviews*. UPP STIM YKPN.
- Yuliah, & Leni Triana. (2021). Pengukuran Value At Risk Pada Aset Perusahaan Dengan Simulasi Monte Carlo. *Jurnal Valuasi: Jurnal Ilmiah Ilmu Manajemen Dan Kewirausahaan*, 1.