

DAFTAR PUSTAKA

- Abdurakhman, 2013, *Diktat Manajemen Investasi*, UGM Yogyakarta
- Ahimud, Y., dkk, December 1986, "Asset Pricing and the Bid –Ask Spread," *Journal Financial Economic* 17:223-249
- Anton, H & Rosses, C., 2004, *Aljabar Linear Elementer*, versi aplikasi, Edisi kedelapan, Jakarta: Erlangga
- Badan Sertifikasi Manajemen Risiko, 2008, *Buku Pedoman Manajemen Risiko*, BSMR, Jakarta
- Bain, L.J. dan Engelhardt, M., 1992, *Introduction to Probability and Mathematical Statistics*, Duxbury Press, California.
- Bangia, A., dkk 1999, " *Modeling Liquidity risk with implication for traditional market risk measurement and management Working paper*", *The Wharton Financial Institutions Center*
- Cahyani, R.I., 2014, " *Pengukuran Value at Risk pada portofolio saham dengan metode bootstrapping*", skripsi, Universitas Negeri Yogyakarta
- Dowd, K., 2005, " *Measuring Market Risk Second Edition*", John Wiley & Sons, Ltd, Canada.
- Khoirul, A., 2013, " *Risiko Likuiditas Dan Dampaknya Terhadap Kinerja Perbankan Di Indonesia*", Program Studi Manajemen, STIE Nahdatul Ulama, Jepara
- Muranaga, J., & Ohsawa, M., 2002, " *Measurement of liquidity risk in the context of market risk calculation*", working paper, Institute for monetary and Economic Studies, Bank of Japan, Tokyo



- Nuryani, E., 2008, “ *Penentuan momen ke-3 dan ke-4 dari distribusi gamma, beta dan weibul* ”, Skripsi, Universitas Islam Negeri Malang.
- Pratiwi, N., 2011, “ *Estimasi Penyesuaian Likuiditas Pada Value At Risk Dari Data Historis*”, Thesis, Universitas Gajah Mada Yogyakarta
- Raharjo, F., 2007, *Ekonomi Teknik Analisis Pengambilan Keputusan*, Yogyakarta : Penerbit Andi.
- Rosadi, D., 2012, *Manajemen Resiko Kuantitatif*, UGM Yogyakarta
- Subanar., 2013, *Statistika Matematika; Probabilitas, Distribusi dan Asimtotis dalam Statistika*, Yogyakarta : Graha Ilmu.
- Sunaryo, T., 2007, *Manajemen Risiko Finansial*, Salemba Empat, Jakarta.
- Yahoo Finance, *Data harga dan volume perdagangan saham BBKA, BBNI, INDF, LMAS, FREN, APLI dari 24 April 2013-24 April 2015*, data di unduh dari finance.yahoo.com pada 25 April 2015.