

DAFTAR PUSTAKA

- Arthini, K Dharmawan, dan Harini. (2012). *Perhitungan Var Portofolio Saham Menggunakan Data Historis Dan Data Simulasi Monte Carlo*. *e-Journal Matematika*, Vol. 1, No. 1 Agustus 2012.
- Ben Rejeb, A. (2012). *Value-at-Risk Analysis for the Tunisian Currency Market*. *International Journal of Economics and Financial Issues*, Vol. 2, No. 2.
- Berry, R. (2008). *Investment Analytics and Consulting* (December ed.). JP Morgan Chase & Co.
- Berry, R. (2008). *Investment Analytics and Consulting* (September ed.). JP Morgan Chase & Co.
- Brown and Reilly. (2011). *Investment Analysis and Portfolio Management* (Tenth ed.). Canada: South-Western.
- Cakir HM dan Uyar M. (2013). *Portfolio Risk Management with Value at Risk: A Monte-Carlo Simulation on ISE-100*. *International Research Journal of Finance and Economics*.
- Čorkalo, Š. (2011). *Comparison Of Value At Risk Approaches On A Stock*. *Croatian Operational Research Review (CRORR)*, Vol. 2.
- Damodaran, A. (2010). *Applied Corporate Finance*. New Jersey, USA: John Wiley & Sons.
- Damodaran, A. (2010). *Value at Risk (VAR)*. USA: New York University.
- Darmaji, T dan M.H Fakhrudin. (2016). *Pasar Modal di Indonesia Pendekatan*. Jakarta: Salemba Empat.
- Fahmi, I. (2012). *Manajemen Investasi: Teori dan Soal Jawab*. Jakarta: Salemba.
- Fahmi, I. (2014). *Pengantar Manajemen Keuangan Teori dan Soal Jawab* (3rd ed.). Bandung: Alfabeta.
- Funny Money. (2016, 17 Januari). *15 Perusahaan Terbesar di Indonesia*. Tersedia: <https://www.cermati.com/artikel/15-perusahaan-terbesar-di-indonesia> [Desember 24, 2016]
- Hao Li, Xiao Fan, Yu Li, Yue Zhou, Ze Jin, Zhao Liu. (2012). *Approaches to VaR*. Stanford University.
- Indrawati. (2015). *Metode Penelitian Manajemen dan Bisnis Konvergensi Teknologi Komunikasi dan Informasi*. Bandung: Refika Aditama.

- Jogiyanto, H. (2010). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi* (7th ed.). Yogyakarta: BPFE.
- Jorion, P. (2007). *Value at Risk The New Benchmark for Managing Financial* (3rd ed.). USA: McGraw Hill.
- Jorion, Philippe and GARP. (2007). *Financial Risk Manager Handbook* (4th ed.). USA: John Wiley & Sons, Inc.
- Julianto, P. A. (2016, April 28). *HM Sampoerna Lakukan "Stock Split", Sahamnya Jadi Rp 3.700 per Lembar*. Tersedia: <http://bisniskeuangan.kompas.com/read/2016/04/28/064958226/HM.Sampoerna.Lakukan.Stock.Split.Sahamnya.Jadi.Rp.3.700.per.Lembar> [15 Desember 2016]
- Leony P, Manurung T, dan Prang JD. (2013). *Pengukuran Value at Risk pada Aset Perusahaan dengan Metode Simulasi Monte Carlo . Jurnal Mipa Unsrat Online*.
- Jefriando, M. (2015, 29 September). *Mulai 2016, PPN Rokok Cs Naik Jadi 8,7%*. Tersedia: <http://finance.detik.com/ekonomi-bisnis/3030819/mulai-2016-ppn-rokok-cs-naik-jadi-87> [30 Maret 2016]
- Maruddani dan Purbowati. (2009). *Pengukuran Value at Risk pada Aset Tunggal dan Portofolio dengan Menggunakan Simulasi Monte Carlo (Studi Kasus PT. Telekomunikasi dan PT. Astra International)*. *Media Statistika, Vol. II, No. 2*.
- Simanjuntak, P.L. (2013). *Menkes : Jumlah Perokok Aktif di Indonesia Peringkat Ketiga Tertinggi di Dunia*. Dipetik Maret 26, 2016, dari <http://www.beritarayaonline.com/2013/05/menkes-jumlah-perokok-aktif-di.html#.VxUQifl97IV>.
- Saham Oke. (2016). *Sub Sektor Rokok di Bursa Efek Indonesia*. Tersedia: <http://www.sahamok.com/emiten/sektor-industri-barang-konsumsi/sub-%09sektor-rokok/> [24 Desember 2016]
- Setianto, B. (2011). *Analisa Sub Sektor Rokok*. Tersedia: <https://books.google.co.id/books?id=J7tUCgAAQBAJ&printsec=frontcov%09er#v=onepage&q&f=false> [24 Desember 2016]
- Sugiyono. (2016). *Metode penelitian kuantitatif, kualitatif, dan R&D*. Bandung: Alfabeta.
- Sukirno. (2016, 28 April). *Stok Split HMSP: Harga Saham Rokok HM Sampoerna Kini Rp3.924/Lembar*. Tersedia: <http://market.bisnis.com/read/20160428/192/54>

2449/stok-split-hmsp-harga-saham-rokok-hm-sampoerna-kini-
rp3.924lembar [1 Desember 2016]

Sukmana, Y. (2016, Agustus 17). *Dipertimbangkan, Kenaikan Harga Rokok Jadi Rp 50.000 Per Bungkus*. Tersedia: <http://bisniskeuangan.kompas.com/read/2016/08/17/155528326/dipertimbangan.kenaikan.harga.rokok.jadi.rp.50.000.per.bungkus> [12 Desember 2016]

Tandelilin, E. (2010). *Portofolio dan Investasi, Teori, dan Aplikasi* (1st ed.). Yogyakarta: KANISIUS.

Boddie Z., Kane A., Marcus A.J. (2014). *Investment* (Tenth ed.). USA: McGraw-Hill Education.