

## DAFTAR PUSTAKA

- Aldilla, G., Evy S. dan Setyo W. R. (2018). *ANALISIS PERBANDINGAN NILAI VALUE AT RISK PADA METODE SIMULASI HISTORIS DAN METODE TRANSFORMASI JOHNSON (Studi Kasus Pada PT. Astra Agro Lestari, Tbk.). Buletin Ilmiah Mat, Stat, dan Terapannya (Bimaster)*. Vol. 08, No. 1, hal 133-140.
- Adrianto, A. D., Azhari, M. dan Khairunnisa. (2017). *ANALISIS VALUE AT RISK DENGAN METODE HISTORIS, DAN MONTE CARLO DALAM SAHAM SUB SEKTOR ROKOK (STUDI KASUS PADA SAHAM GUDANG GARAM DAN HM SAMPOERNA)*. *E-Proceeding of Management*. Vol.4. No.2. .
- Asosiasi Penyelenggara Jasa Internet Indonesia. (2018). *LAPORAN SURVEI PENETRASI & PROFIL PERILAKU PENGGUNA INTERNET INDONESIA*. Ver: S 20190518.
- Berry, R. (2008). *INVESTMENT ANALYTICS AND CONSULTING (SEPTEMBER ED.)*. JP Morgan Chase & Co.
- Bodie, Zvi, Kane, Alex dan Marcus, Alan J. (2014). *MANAJEMEN PORTOFOLIO DAN INVESTASI. Edisi sembilan*. Jakarta: Salemba Empat.
- Brandolini, D. dan Colucci, S. (2011). *BACKTESTING VALUE-AT-RISK: A COMPARISON BETWEEN FILTERED BOOTSTRAP AND HISTORICAL SIMULATION*. *Symphonia Sgr*.
- Brown and Reilly. (2011). *INVESTMENT ANALYSIS AND PORTFOLIO MANAGEMENT. Edisi sepuluh*. Canada: South-Western.
- Darmawi, H. (2016). *MANAJEMEN RISIKO. Edisi kedua*. Jakarta: Bumi Aksara.
- Fahmi, I. (2012). *MANAJEMEN INVESTASI: TEORI DAN SOAL JAWAB*. Jakarta: Salemba
- Fahmi, I. (2014). *PENGANTAR MANAJEMEN KEUANGAN TEORI DAN SOAL JAWAB. Edisi ketiga*. Bandung: Alfabeta.
- Fahmi, I. (2015). *PENGANTAR TEORI PORTOFOLIO DAN ANALISIS INVESTASI*. Bandung: Alfabeta.
- Giriningtyas T.D., Ruli S. D. dan Batara M. S. (2015). *PENERAPAN MODEL VAR DALAM PENGUKURAN RISIKO PENURUNAN OPERATIONAL*

- REVENUE PADA INDUSTRI TELEKOMUNIKASI. Jurnal Ekonomi, Manajemen dan Perbankan. Vol. 1 No. 2.*
- Indrawati. (2015). *METODE PENELITIAN MANAJEMEN DAN BISNIS KONVERGENSI TEKNOLOGI KOMUNIKASI DAN INFORMASI.* Bandung: Refika Aditama.
- Jogiyanto, Hartono. (2016). *TEORI PORTOFOLIO DAN ANALISIS INVESTASI.* Yogyakarta: BPF.
- Jorion, P. (2007). *VALUE AT RISK THE NEW BENCHMARK FOR MANAGING FINANCIAL.* Edisi ketiga. USA : McGraw Hill.
- Jorion, P. (2007). *FINANCIAL RISK MANAGER HANDBOOK.* John Wiley & Sons, Inc., Hoboken, New Jersey.
- Kusumaningtyas, A. dan Abdul A. (2016). *METODE HISTORIS UNTUK PERHITUNGAN VALUE AT RISK PADA MODEL GENERALIZED AUTOREGRESSIVE CONDITIONAL HETEROSCEDACITY IN MEAN.* *Jurnal Matematika "Mantik", Vol.2, No.1.*
- Lovelock, Christopher dan Wirtz, Jochen. (2011). *SERVICE MARKETING IN ASIA. Edisi kedua.* Pearson Education International. New Jersey.
- Machfiroh, Ines S. (2016). *PENGUKURAN RISIKO PORTOFOLIO INVESTASI DENGAN VALUE AT RISK (VAR) MELALUI PENDEKATAN METODE VARIANSI-KOVARIANSI DAN SIMULASI HISTORIS.* *Jurnal Sains & Informatika.* Vol.2, No. 2.
- Nieppola, Olli. (2009). *BACKTESTING VALUE AT RISK MODELS.* *Master's Thesis in Economics.* Helsinki School of Economics.
- OJK. (2015). *BIJAK BER-EBANKING.*
- OJK. (2018). *PERATURAN OTORITAS JASA KEUANGAN NOMOR 12/POJK.03/2018 TENTANG PENYELENGGARAAN LAYANAN PERBANKAN DIGITAL OLEH BANK UMUM.*
- Pinheiro, M. C. dan Fernandes, B. V. (2019). *INTERNATIONAL VAR APPROACH: BACKTESTING FOR DIFFERENT CAPITAL MARKETS.* *Revista Contabilidade & Finanças.* Vol.3, No.83.

- Pitoko, Ridwan A. (2018). *TANTANGAN PERBANKAN DIGITAL*. [online]. <https://ekonomi.kompas.com/read/2018/09/27/192500126/4-tantangan-perbankan-digital?page=all>. [20 Juli 2020].
- Prabowo, Sandy I. (2011). *APLIKASI VALUE AT RISK METODE HISTORICAL SIMULATION TERHADAP 10 SAHAM BANK TERBESAR BERDASARKAN ASET VERSI BANK INDONESIA DI BEI TAHUN 2010*. Tugas Akhir. Bandung.
- PwC Indonesia. (2018). *SURVEI PWC INDONESIA: PERBANKAN DIGITAL DI INDONESIA 2018 “STRATEGI DIGITAL SEBAGAI STRATEGI PERUSAHAAN”*. [online]. <https://www.pwc.com/id/en/media-centre/press-release/2018/indonesian/perbankan-digital-indonesia-survei-2018.html>. [20 Juli 2020].
- Ridha, M. dan Khoiruddin, M. (2018). *KONSISTENSI PENGUKURAN VALUE AT RISK PADA SAHAM SYARIAH DENGAN METODE HISTORIS*. *Management Analysis Journal*. Vol. 7. No. 1.
- Sidik, Syahrizal. (2020). *INI DIA BANK BUKU IV PALING MENGUNTINGKAN DI RI*. [online]. <https://www.cnbcindonesia.com/market/20200225113717-17-140297/ini-dia-bank-buku-iv-paling-menguntungkan-di-ri>. [24 Juli 2020].
- Smart, Scott B., Gitman, Lawrence J., dan Joehnk M.D. (2017). *FUNDAMENTAL OF INVESTING*. Edisi tiga belas. Global Edition: Pearson.
- Sujarweni, V. Wiratna. (2015). *METODE PENELITIAN BISNIS & EKONOMI*. Yogyakarta: Pustaka Baru Press.
- Susanti, Emi. (2019). *INOVASI DIGITAL BANKING DAN KINERJA PERBANKAN DI INDONESIA*. Tugas Akhir. Surakarta
- Syariah dan Noviana P. (2020). *PENGUKURAN VALUE AT RISK (VaR) PORTOFOLIO OPTIMAL PADA INVESTASI SAHAM BANK BADAN USAHA MILIK NEGARA (BUMN) MENGGUNAKAN METODE VARIAN COVARIAN DAN METODE SIMULASI MONTE CARLO*. *Jurnal Statistika Industri dan Komputasi*. Vol. 5. No. 1.

- Syarifudin R. dan Viverita. (2014). *PENGARUH MOBILE BANKING TERHADAP KINERJA PERBANKAN INDONESIA*. Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia.
- Tandelilin, E. (2010). *PORTOFOLIO DAN INVESTASI, TEORI DAN APLIKASI*. Edisi pertama. Yogyakarta: KANISIUS.
- Website. <https://finance.yahoo.com/>. Diakses pada 27 Juli 2020.
- Website resmi Bank CIMB Niaga. <https://www.cimbniaga.co.id/>. Diakses pada 20 Juli 2020.
- Website resmi Bank Rakyat Indonesia. <https://bri.co.id/>. Diakses pada 20 Juli 2020.
- Website resmi Otoritas Jasa Keuangan. <https://www.ojk.go.id/>. Diakses pada 10 Desember 2020.
- Wirayani, Prima. (2018). *5 Strategi Bank Sentral Hadapi Risiko Ekonomi Digital*. [online]. <https://www.cnbcindonesia.com/tech/20181010183558-37-36869/5-strategi-bank-sentral-hadapi-risiko-ekonomi-digital>. [20 Juli 2020].