

## DAFTAR PUSTAKA

- Ali, M. (2006). *Manajemen Risiko; Strategi Perbankan Dan Dunia Usaha Menghadapi Tantangan Globalisasi Bisnis*. Jakarta: PT Rajagrafindo Persada.
- Alijoyo, F. A. (2010). *Risiko Reputasi Perusahaan: Pengenalan*. Diakses dari <http://antoniusalijoyo.com/writings/>. [1 Juni 2011].
- Andaiyani. (2010). *Pengertian Bank BUMN*. Diakses dari <http://id.shvoong.com/business-management/investing/2077013-pengertian-bank-bumn/>. [18 April 2011].
- Bank Indonesia. *Peraturan Bank Indonesia No. 5/8/PBI/2003 tentang Penerapan Manajemen Risiko Bagi Bank Umum*. Gubernur Bank Indonesia. Jakarta.
- \_\_\_\_\_. *Peraturan Bank Indonesia No. 9/13/PBI/2007 tentang Kewajiban Penyediaan Modal Minimum Bank Umum dengan Memperhitungkan Risiko Pasar*. Gubernur Bank Indonesia. Jakarta.
- \_\_\_\_\_. *Peraturan Bank Indonesia No. 11/25/PBI/2009 tentang Perubahan Atas PBI No.5/8/PBI.2003 tentang Penerapan Manajemen Risiko Bagi Bank Umum*. Gubernur Bank Indonesia. Jakarta.
- \_\_\_\_\_. *Surat Edaran No. 5/21/DPNP tanggal 29 September 2003 tentang Penerapan Manajemen Risiko bagi Bank Umum*. Gubernur Bank Indonesia. Jakarta.
- \_\_\_\_\_. *Surat Edaran No. 9/31/DPNP tanggal 12 Desember 2007 tentang Pedoman Penggunaan Model Internal dalam Perhitungan Kewajiban Penyediaan Modal Minimum Bank Umum dengan Memperhitungkan Risiko Pasar*. Gubernur Bank Indonesia. Jakarta.
- Batuparan, D. S. (2001). *Kerangka Kerja Risk Management*. *BEI News* (Edisi 2) Tahun I, Juni-Juli 2000.

- Besral. (2005). *Uji Beda Rata-Rata Independen*. Depok: Dept. Biostatistika dan Kependidikan Fakultas Kesehatan Masyarakat UI.
- BPPK. (2011). Manajemen Risiko Di Lingkungan Pemerintah; Pengertian Manajemen Risiko. *Jurnal Akuntansi Pemerintah*. Diakses dari <http://www.bppk.depkeu.go.id/index.php/2008050881/jurnal-akuntansi-pemerintah/>. [11 Mei 2011].
- Buchadadi, A. D. (2007). Perhitungan Value At Risk Portofolio Optimum Saham Perusahaan berbasis Syariah Dengan Pendekatan EWMA (Studi Empiris Terhadap Saham-Saham Yang Tergabung Dalam JII Selama 2005-2006). *The 1st PPM National Conference on Management Research "Manajemen di Era Globalisasi"*.
- Budiman, Billy. Prospek Saham BBRI Makin Cerah. Diakses dari <http://www.seputar-indonesia.com/edisicetak/content/view/378064/>, [15 September 2011].
- BUMN *Track*. Ranumnya Laba Bank BUMN. Diakses dari [http://www.bumntrack.com/index.php/rubrik/show\\_rubrik\\_detail/30/440](http://www.bumntrack.com/index.php/rubrik/show_rubrik_detail/30/440), [15 September 2011].
- Burnes, B. dan Khan, O. (2007). Risk and Supply Chain Management: Creating A Research Agenda. 21 Desember 2010. *Journal of Logistic Management*. Vol. 18 No. 2, pp. 197-216.
- Hae-Ching C. dan Cheng-Te C. (2008). Using Cluster Method for Estimating Value At Risk (VAR) in US Stock Futures Market. *The Business Review, Cambridge*. Vol. 11 No. 1, pp. 65-70.
- Direktorat Penelitian dan Pengaturan Perbankan. (2003). *Pedoman Standar Penerapan Manajemen Risiko bagi Bank Umum, Lampiran SE No.5/21/DPNP tanggal 29 September 2003*. Gubernur Bank Indonesia. Jakarta.

- Hadad, M. D., Sugiarto, A., Purwanti, W., Hermanto, M. J. (2003). Kajian Mengenai Struktur Kepemilikan Bank Di Indonesia. Diakses dari <http://www.bi.go.id/NR/>, [18 April 2011].
- Jorion, P. (2001). *Value At Risk; The New Benchmark for Managing Financial Risk*. United States of America: Mc Graw Hill.
- Kahar, Y. (2009). Perhitungan Value At Risk pada Institusi Perbankan Berdasarkan Metode Variance Covariance. *Akuntabilitas Jurnal*. Vol. 8 No. 2, pp. 160-181.
- Kasmir. 2008. Manajemen perbankan. Jakarta: Rajawali Pers
- Kountur, R. (2004). *Manajemen Risiko Operasional; Memahami Cara Mengelola Risiko Operasional Perusahaan*. Jakarta: PPM.
- Lalamentik, R. A. (2007). Pengaruh *Market Share* Berdasarkan Dana Pihak Ketiga Dan Pemberian Kredit Terhadap Profitabilitas Perbankan Indonesia Berdasarkan *Return On Asset* dan *Net Interest Margin* [skripsi]. Jakarta: Departemen Manajemen, Fakultas Ekonomi, Universitas Indonesia.
- Lam, J. (2003). *Enterprise Management; From Incentives Controls*. New Jersey: John Wiley dan Sons, Inc.
- Lesmana, I. (2007). Risiko Strategik, Risiko Legal, Risiko Kepatuhan dan Risiko Reputasi Dalam Industri Perbankan Di Indonesia (*Strategic Risk, Legal Risk, Compliance Risk and Reputation Risk in the Banking Industry in Indonesia*). *Proceeding PESAT Gunadarma*. Vol. 2, pp. A166-A173.
- Maghyereh, A. I. dan Al-Zoubi, H. A. (2006). Value-At-Risk Under Extreme Values: The Relative Performance in MENA Emerging Stock Markets. *Journal of Managerial Finance*. Vol. 2 No. 2, pp. 154-172.
- Manganelli, S. dan Engle, R.F. (2001). Value At Risk Models in Finance. *Working Paper Series, European Central Bank*. No. 75.

- Mustafa, H. (2000). Teknik Sampling. Diakses dari <http://home.unpar.ac.id/>, [27 Maret 2011].
- Muthmainnah. (2006). Pengaruh Kepemilikan Bank Pemerintah dan Swasta Pada *X-Efficiency*[tesis]. Universitas Gajah Mada.
- Nestiana, N. (2010). Analisis Perbandingan Tingkat Risiko Investasi Pada Bank BUMN dan Bank Swasta Dengan Menggunakan Metode *Value At Risk (VaR)*[skripsi]. Bandung: Jurusan Manajemen Keuangan, Fakultas Ekonomi, Universitas Padjadjaran.
- Pafka, S. dan Kondor, I. (2001). Evaluating the RiskMetrics Methodology in Measuring Volatility and Value-at-Risk in Financial Markets. *Quantitative Finance Papers*. No. 0103107.
- Redja, G. E. (2011). *Principles of Risk Management and Insurance, (11st ed)*. New Jersey: Prentice Hall.
- Republik Indonesia. *Undang-Undang Republik Indonesia Nomor 3 Tahun 2004 tentang Perubahan Atas Undang-Undang Republik Indonesia Nomor 23 Tahun 1999 Tentang Bank Indonesia*. Presiden Republik Indonesia. Jakarta.
- \_\_\_\_\_. *Undang-Undang Republik Indonesia Nomor 10 Tahun 1998 tentang Perubahan Atas Undang-Undang Nomor 7 Tahun 1992 tentang Perbankan*. Presiden Republik Indonesia. Jakarta.
- Saputra, K. A. *et al.* (2002). Pengaruh Risiko Sistematis dan Likuiditas Terhadap Tingkat Pengembalian Saham Badan-Badan Usaha yang Go-Public di Bursa Efek Jakarta Pada Tahun 1999. *Jurnal Manajemen dan Kewirausahaan*. Vol. 4 No. 1, pp. 15-25.
- Saunders, A dan Cornett, M. M. (2006). *Financial Institution Management; A Risk Management Approach, (5th ed)*. Singapore: Mc Graw Hill.

- Sekaran, U. (2003). *Research Methods For Business; A Skill Building Approach*, (4th ed). USA: John Wiley dan Sons, Inc.
- Sollis, R. (2009). Value At Risk: A Critical Overview. *Journal of Financial Regulation and Compliance*. Vol. 17 No. 4, pp. 398-414.
- Sukarno, M. (2007). Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Saham Menggunakan Metode Single Indeks Di Bursa Efek Jakarta[tesis]. Program Studi Magister Manajemen, Program Pascasarjana, Universitas Diponegoro.
- Supriyatno. (2008, Juni). Pengaruh Corporate Governance dan Bentuk Kepemilikan Terhadap Kinerja Keuangan Bank Di Indonesia. *Jurnal Keuangan dan Perbankan*. Vol. 10 No. 1, pp. 46-65.
- Stulz, R. M. (2003). *Risk Management and Derivatives*. USA: Thomson Learning.
- Waskito, A. (2006). Pengukuran Risiko Strategik Dengan Metode Generalized Information-Based Ordinal Time Series Untuk Sub Industri Perbankan Periode 2002-2005 [tesis]. Fakultas Ekonomi, Universitas Indonesia.