

DAFTAR PUSTAKA

- [1] Anonim. 2011. *Metode Peramalan*. Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam Universitas Negeri Semarang, Semarang.
- [2] Bain, L.J., dan M. Engelhardt. 1992. *Introduction to Probability and Mathematical Statistics Second Edition*. Duxbury Press, California.
- [3] Brockwell, P.J. dan R.A. Davis. 2002. *Introduction to Time Series and Forecasting*. Springer, New York.
- [4] Burden, R.L. dan J.D. Faires. 2011. *Numerical Analysis. Ninth Edition*. Brooks, New York.
- [5] Ekananda, M. 2014. *Analisis Data Time Series*. Mitra Wacana Media, Jakarta.
- [6] Enders, W. 1995. *Applied Econometric Time Series*. John Wiley & Sons, New York.
- [7] Gujarati, D.N. 1995. *Basics Econometrics*. McGraw-Hill, New York.
- [8] Halim, A. 2005. *Analisis Investasi*. Salemba Empat, Jakarta.
- [9] Isran, K.H. Model GARCH(1,1) dan EGARCH(1,1): Fakta Empiris Return dan Volatilitas. *Prosiding Konferensi Nasional Pendidikan Matematika ke-6*. Universitas Negeri Gorontalo, Gorontalo.
- [10] Makridakis, S., S.C. Wheelwright dan V.E. McGee. 1992. *Metode dan Aplikasi Peramalan*. Erlangga, Jakarta.
- [11] Mulyana. 2004. *Analisis Data Deret Waktu*. Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam Universitas Padjadjaran, Bandung.
- [12] Pusdiklat BPS. 2010. *Modul Diklat Fungsional Statistisi Tingkat Ahli : Analisis Data Deret Berkala*. Pusdiklat BPS, Jakarta.
- [13] Suwandi, K. 2011. *Panduan Cerdas Investasi*. Pinang Merah, Yogyakarta.
- [14] Tsay, R.S. 2002. *Analysis of Financial Time Series*. John Wiley & Sons, Inc, New Jersey.
- [15] Wahyu, W. 2007. *Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan Eviews*. UPP STIM YKPN, Yogyakarta.

- [16] Wei, W.S. 2006. *Time Series Analysis : Univariate and Multivariate Methods*. Pearson, Boston.
- [17] <http://finance.yahoo.com/quote/BBCA.JK/history?p=BBCA.JK>, (diakses pada tanggal 3 Maret 2016).
- [18] <http://finance.yahoo.com/quote/BMRI.JK/history?p=BMRI.JK>, (diakses pada tanggal 3 Maret 2016).

