

DAFTAR PUSTAKA

- Budiarti, Retno, 2012. *Peramalan Harga Saham SHARP Dengan Menggunakan Model ARIMA-GARCH dan Model Generalisasi Proses WIENER*, PROSIDING, Seminar Nasional Metematika, Hal: 367-375
- Christanty, Hyldha, 2013. *Pengaruh Volatilitas Harga Terhadap Inflasi di Kota Malang: Pendekatan Model ARCH/GARCH*, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Brawijaya Malang.
- Dewi, Andam, Hermanto Siregar dan Sri Hartoyo, 2011. *Perilaku Kontrak Gulir Indeks Emas Di Bursa Berjangka Jakarta*, *Finance and Banking Journal*, Vol.13 No.01 Juni 2011, hal: 16-33.
- Grestandhi, Jordan dan Bambang Susanto dan Tundjung Mahatma, 2011. *Analisis Perbandingan Metode Peramalan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Dengan Metode ols-Arch/Garch Dan Arima*, PROSIDING, ISBN:978-979-16353-6-3
- Hendrawan, Bambang, _____, *Penerapan Model ARIMA Dalam Memprediksi IHSG*, Politeknik Batam.
- Hendrawan, Riko, 2010. *Perbandingan Model Opsi Black Scholes dan Model Opsi GARCH di Bursa Efek Indonesia*, *Jurnal Keuangan dan Perbankan*, Vol.14, No.1 Januari 2010, hal: 13-23.
- Houston, Brigham (2007), *Dasar-dasar Manajemen Keuangan*, Edisi 11. Jakarta: Salemba Empat.
- Indonesia Stock Exchange (2010), *Indeks Harga Saham Bursa Efek Indonesia*, Jakarta, IDX
- Mankiw, Gregory (2001) *Pengantar Ekonomi*, Jilid 2. Jakarta: Erlangga
- Muharam, Harjum dan Muhammad Panji, 2008. *Multifraktalitas Dan Studi Komparatif Prediksi Indeks Dengan Metode ARIMA dan Artificial Neural Network (ANN)*, *Journal The Winners* Vol 9 No 02, Septmber 2008, hal: 112-123.
- Mutakif, Fikri dan Andini Nurwulandari, 2012. *Pengaruh Volume Perdagangan Saham, Nilai Tukar dan Indeks Hangseng Terhadap Pergerakan Indeks harga Saham Gabungan*, *Jurnal Akuntansi & Bisnis*, Vol. 7, No.2, Juli 2012, hal: 178- 192.

- Nachrowi, N.D & Usman Hardius (2007). Prediksi IHSB dengan Model GARCH dan Model ARIMA. *Jurnal Ekonomi dan Pembangunan Indonesia (JEPI)*, Vol.7, No.2.
- Nastiti, Khoiru Liummah Ayu dan Agus Suharsono, 2012. *Analisis Volatilitas Saham Perusahaan Go Public Dengan Metode ARCH-GARCH*, *Jurnal Sains dan Seni ITS*, Vol 1, No. 1, Hal: 259-264.
- Nurkhoiriyah, _____. *Penggunaan Metode Var (Value at Risk) Dalam Analisis Resiko Investasi Saham PT. TELKOM Dengan Pendekatan Mode GARCH-M*, Jurusan Matematika FMIPA-ITS.
- Ramadhan, Bayu Ariestya, 2013. *Analisis Perbandingan Metode ARIMA Dan Metode GARCH Untuk Memprediksi Harga Saham*, Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Universitas Telkom.
- Santoso, Teguh, 2011. *Aplikasi Model GARCH Pada Data Inflasi Bahan Makanan Indonesia*, Vol.13 No.01, Aset, Maret 2011, hal: 65-76.
- Sekaran, Uma (2006), *Research Methods For Business*, Edisi 4. Jakarta: Salemba Empat.
- Sukirno, Sadono (2011), *Teori Pengantar Makroekonomi*, Edisi Ketiga. Jakarta: PT.Raja Grafindo Persada.
- Tandelilin, Eduardus (2001), *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*, Edisi Pertama. Yogyakarta:BPFE
- Tim BOLLERSLEV, 1986. *Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedacity*, *Journal of Econometrics* 31 (1986), North-Holland, pp: 307-327.
- Widasari, Lulik Presdita dan Nuri Wahyuningsih, 2012. *Aplikasi Model ARCH-GARCH Dalam Peramalan Tingkat Inflasi*, *Jurnal Sains dan Seni POMTIS* Vol. 1, No. 1, 2012, hal 1-5.
- Wijaya, Ryan Filbert (2014), *Investasi Saham Ala Swing Trader Dunia*. Jakarta: Gramedia
- Yunarti, Yuyun, _____. *Penerapan Model GARCH dan Model EWMA Dalam Mengukur Risiko Berinvestasi (Studi Kasus Saham Syariah di Jakarta Islamic Indeks)*. _____
- Zumrohtuliyosi, Dede, Absul Hoyyi dan Agus Rusgiyono, 2015. *Penentuan Value At Risk Saham Kimia Farma Pusat Melalui Pendekatan Distribusi Pareto Terampat*, *Jurnal Gaussian*, Vol. 4, No. 3 Tahun 2015, hal: 444-462.

IDX Neswletter, Februari 2014

IDX Neswletter, Februari 2015

www.bi.go.id , diunduh 16 November 2015

www.bisnis.liputan6.com, diunduh 26 Januari 2016

www.djaverages.com, diunduh 23 Februari 2016

www.idx.co.id, diunduh 16 November 2015

www.koran-sindo.com, diunduh 17 Maret 2016

www.monexnews.com, diunduh 26 Januari 2016

www.nasdaq.com, diunduh 23 Februari 2016

www.ojk.go.id, diunduh 16 November 2015

www.tradingindexonline.com, diunduh 23 Februari 2016

www.ufx.com, diunduh 23 Februari 2016

www.yahoo.finance.com, diunduh 16 November 2015

