

DAFTAR PUSTAKA

- Angabini, A., & Wasiuzzaman, S. (2011). GARCH Models and the Financial Crisis-A Study of the Malaysian. *The International Journal of Applied Economics and Finance*, 5(3), 226-236.
- Ang, Robert. (1997). Buku Pintar Pasar Modal Indonesia (The Intelligent Guide to Indonesian Capital Market). *Jakarta: Mediasoft Indonesia*.
- Bolerslev, T. (1986). Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity. *Journal of Econometrics*. 307-327
- Box, G. E., & Jenkins, G. M. (1970). Time series analysis: Forecasting and control Holden-Day. *San Francisco*, 498.
- Brigham, E. F., & Houston, J. F. (2006). Dasar-dasar manajemen keuangan, edisi 11. *Jakarta: Salemba Empat*.
- Darmadji, M. Dan M. Fakhrudin. (2001). Pasar Modal Di Indonesia. *Jakarta :Salemba Empat*.
- Desvina, A. P., & Rahmah, N. (2017). Penerapan Metode ARCH/GARCH Dalam Peramalan Indeks Harga Saham Sektorial. *Jurnal Sains Matematika dan Statistika: Jurnal Hasil Penelitian Matematika, Statistika, dan Aplikasinya*, 2(1), 1-10.
- Dian Febriana, Tarno, & Sugito (2014) Perhitungan Value At Risk Menggunakan Model Integrated Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (Igarch). *Jurnal Gaussian* 3(4), 635 – 643
- Dwipa, N. M. S. (2016) Peramalan Value At Risk Menggunakan Metode Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedastic. *Buletin Ilmiah Mat. Stat. Dan Terapannya (Bimaster)* Volume 05, 267 – 276
- Ekananda, Mahyus (2018). *Analisis Data Time Series edisi 2*. *Jakarta: Mitra Wacana*
- Fama, E. F., & French, K. R. (1988). Dividend yields and expected stock returns. *Journal of financial economics*, 22(1), 3-25.
- Gaol, B. A. L., Parulian, Tumpal Nababan & Haposan Sirait (2015) Perhitungan Value At Risk Harga Saham Dengan Menggunakan Volatilitas Arch-Garch Dalam Kelompok Saham Lq 45. *Jom Fmipa* Volume 2 No.2
- Hermansah (2015). Penggunaan Metode Peramalan Dalam Analisis Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dolar Dengan Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity. *Pythagoras*. 4(2) 77-88
- Jogiyanto, H. (2010). Teori portofolio dan analisis investasi (edisi ketujuh). *Yogyakarta: BPFE*.

- Kartika, A. (2010). Volatilitas harga saham di Indonesia dan Malaysia. *Jurnal Ilmiah Aset*, 12(1), 17-26.
- Mahendra, I. K. T. B., Dharmawan, K., & Tastrawati, N. K. T. (2015). Model Non Linier GARCH (NGARCH) Untuk Mengestimasi Nilai Value at Risk (VaR) pada IHSG. *E-Jurnal Matematika*, 4(2), 59-66.
- Makiel, K. (2012). Arima-Garch models in estimating market risk using value at risk for the WIG20 Index. *e-Finance: Financial Internet Quarterly*, 8(2), 25-33.
- Nastiti, K. L. A., & Suharsono, A. (2012). Analisis Volatilitas Saham Perusahaan go public dengan metode ARCH-GARCH. *Jurnal Sains dan Seni ITS*, 1(1), D259-D264.
- Rajput, Namita, Parul Chopra, dan Ajay Rajput. 2012. FII and Its Impact on Stock Market: A Study on Lead-Lag and Volatility Spillover. *Asian Journal of Finance and Accounting*. 4(2), pp: 18-38.
- Saadah, Nurul & Maiyastri, Hazmira Yoza (2016) Perbandingan Resiko Investasi Bank Central Asia Dan Bank Mandiri Menggunakan Model Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity Garch. *Jurnal Matematika Unand* 5(4), 80 – 88
- Sari, L. K., Achسانی, N. A., & Sartono, B. (2017). Pemodelan Volatilitas Return Saham: Studi Kasus Pasar Saham Asia. *Jurnal Ekonomi dan Pembangunan Indonesia*, 18(1), 35-52.
- Situmeang, Santa & Harjum Muharam (2015). Analisis Pengaruh Volatilitas Harga, Likuiditas Saham, Eps, Size Firm, Momentum Overnight Terhadap Return Saham (Studi Kasus Perusahaan Yang Terdaftar Dalam Indeks Lq45 Periode 2009-2013). *Diponegoro Journal Of Management* Volume 4, Nomor 3, 1-12
- Stefanie Octavia H. (2014). Bidirectional Causality Antara IHSG dan Anggota ASEAN-5 Periode Sebelum dan Sesudah Subprime Mortgage. *Jurnal FINESTA*, 2 (1), pp: 61-66.
- Suliyanto (2011). *Ekonometrika Terapan: Teori Dan Aplikasi Dengan Spss*. Yogyakarta: Andi Offset
- Suliyanto. 2018. *Metode Penelitian Bisnis untuk Skripsi, Tesis, & Disertasi*. Yogyakarta: Andi Offset
- Schwert, G. W., & Smith, C. W. (1992). *Empirical research in capital markets*. McGraw: Hill College.
- Tandelilin Eduardus (2001). *Analisis Investasi Dan Manajemen Portofolio Edisi Pertama*. Yogyakarta: Bpfe

Verawati, Rika (2014) Faktor-Faktor Penentu Yang Mempengaruhi Return Saham Perusahaan Manufaktur Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (Bei) Periode 2008-2013. Universitas Negeri Yogyakarta

Wei, W. W. (1990). Time series analysis: Univariate and multivariate methods. 478 pp. *New York: Adisson–Wesley.*

(<http://www.finance.yahoo.com>)

(<http://www.idx.co.id>)

