

DAFTAR PUSTAKA

- Abdalla, S. Z. S. (2012). Modelling stock returns volatility: Empirical evidence from Saudi Stock Exchange. *International Research Journal of Finance and Economics*, 85, 166–179.
- Abiyani, P. & Permadi H. 2013. Peramalan Data Saham S&P 500 Index Menggunakan Model TARARCH. Malang: Universitas Negeri Malang.
- Al Freedi, A., Shamiri, A., & Isa, Z. (2011). A study on the behavior of volatility in Saudi Arabia stock market using symmetric and asymmetric GARCH models. *Journal of Mathematics and Statistics*, 8(1), 98–106. DOI: 10.3844/jmssp.2012.98.108.
- Ariefianto, M.D. 2012. *Ekonometrika Esensi dan Aplikasi dengan Menggunakan Eviews*. Jakarta: Erlangga.
- Bittman, James B. 2009. *Trading Options as a Professional* dialih bahasakan Dwin Gideon Sitohang. Jakarta: Elex Media Komputindo.
- Boediono. (2000). *Ekonomi Internasional*, BFFE, Yogyakarta.
- Brooks, C. 2008. *“Introductory Econometrics for Finance”* (Second ed). USA: Cambridge University Press.
- Firmansyah. 2006. *Analisis Volatilitas Harga Kopi Internasional*. Jakarta : Usahawan.
- Gujarati, Damodar, 2003, *Ekonometri Dasar*. Terjemahan: Sumarno Zain, Jakarta: Erlangga.
- H. G. Dikko, dkk. (2015). Modelling Abrupt Shift in Time Series Using Indicator Variable: Evidence of Nigerian Insurance Stock. *International Journal of Finance and Accounting*, 4(2): 119-130.
- Hamadu, Dallah. (2010). Modelling and Forecasting the Volatility of the Daily Returns of Nigerian Insurance Stocks. *International Business Research*. DOI: 10.5539/ibr.v3n2p106.
- Hartono, Jogiyanto. 2008. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi Edisi Ke-Tujuh*. Yogyakarta : BPF.

- Hermuningsih, Sri., Rahmawati, A. D., Mujino,. (2018). Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Return Saham. Universitas Sarjanawiyata Tamansiswa Yogyakarta.
- Hwang, S. and Satchell, S .2000. “Market Risk and The Concept of Fundamental Volatility: Measuring Volatility Across Asset and Derivative Markets and Testing for The Impacts of Derivatives Markets on Financial Markets”. Journal of Banking and Finance. Volume 24 Page 759-785.
- Jogiyanto, H.M. (2000). Teori Portofolio dan Analisis Investasi. Edisi Kedua. BPFE. Yogyakarta.
- _____. 2000. Teori Portofolio dan Analisis Investasi. Edisi 3. BPFE, Yogyakarta.
- _____. (2003). Teori Portofolio dan Analisis Investasi. Edisi Ketiga. BPFE. Yogyakarta.
- _____. (2011). Metodologi Penelitian Bisnis.Edisi Keempat. BPFE. Yogyakarta.
- _____. 2013. Teori Portofolio dan Analisis Investasi, Edisi Kedua, Cetakan Pertama, Yogyakarta : BPFE.
- Juanda, B. dan Junaidi. 2012. Ekonometrioka Deret Waktu Teori dan Aplikasi. IPB PRESS, Bogor.
- Khoirunnisa, E. (2014). Penerapan Metode ARCH/GARCH pada Pemodelan Harga Penutupan Saham di Bursa Efek Indonesia Periode 2005-2013.
- Lestano, L., & Sucito, J. (2010). Spillover volatilitas pasar saham Indonesia dan Singapura periode 2001- 2005. Jurnal Akuntansi dan Keuangan, 12(1), 17-25. DOI: <https://doi.org/10.9744/jak.12.1.pp.%2017-25>.
- Lubrano dan Bauwens, 1998. “Bayesian Inference on GARCH models using the Gibbs Sampler”, Journal of Econometrics, Vol. 1, hal. C23 – C46.
- Makridakis, dkk. (1995). Metode dan Aplikasi Peramalan Edisi. Jakarta : Erlangga.
- Maqsood, A., Safdar, S., Shafi, R., & Lelit, N. J. (2017). Modeling stock market volatility using GARCH models: A case study of Nairobi Securities

- Exchange (NSE). *Open Journal of Statistics*, 7, 369–381. DOI: 10.4236/ojs.2017.72026.
- Miron, D., & Tudor, C. (2010). Asymmetric conditional volatility models: Empirical estimation and comparison of forecasting accuracy. *Romanian Journal of Economic Forecasting*, 13(3), 74–92.
- Muis, S. 2008. Meramalkan Pergerakan Saham Menggunakan Pendekatan Model Arima, Indeks Tunggal dan Markowitz. Graha Ilmu, Yogyakarta.
- Nelson, D. (1991). Conditional Heteroskedasticity in Asset Returns: A New Approach, *Journal of Econometrics*. Vol. 9, No. 5.
- Rudolf, Poltak Nainggolan. 2010. ARCH/GARCH Volatility untuk Perhitungan Value at Risk Tiga Saham Emiten Penghasil CPO.
- Satriawan, I Wayan Bagus. (2017). Prediksi Volatilitas Saham Perusahaan Pertambangan Batu Bara dengan Metode *Artificial Neural Networks – Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity*. e-Proceeding of Engineering. Vol.4, Page 5184.
- Schwert, G.W. dan Clifford W. Smith, Jr. (1992). *Empirical Research in Capital Market*, McGraw-Hill, Inc, USA.
- Shakila, dkk. (2017). Assessing Stock Market Volatility for Different Sectors in Malaysia. *Science & Technology*. 25 (2): 631-648.
- Soedewi, Srie dan Purqon, A. 2015. “Analisis Volatilitas Lima Saham Berbeda Sektor pada Indeks Kompas100 dengan Metode ARCH-GARCH”. ITB.
- Sugiyono. 2017. *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif, dan R&D*. Bandung : Alfabeta, CV.
- _____. 2018. *Metode Penelitian Pendidikan: Pendekatan Kuantitatif, Kualitatif, dan R&D*. Bandung: Alfabeta.
- Suliyanto. 2011. *Ekonometrika Terapan : Teori dan Aplikasi dengan SPSS*. Yogyakarta: Andi Offset.
- Supranto, J, 2004, *Analisis Multivariat: Arti dan interpretasi*. Jakarta. PT. Rineka Cipta.

- Susanti dkk. 2016. Analisis Model Threshold GARCH dan Model Exponential GARCH Pada Peramalan IHSG. UNNES Journal of Mathematics.
- Tandelilin, Eduardus. 2010. Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi. Edisi pertama. Yogyakarta : Kanisius.
- Tjiptono Darmardi dan Hendy M. Fakhruhin. 2001. Pasar Modal di Indonesia Pendekatan Tanya Jawab. Edisi Pertama. Jakarta: Salemba Empat.
- Tsay, R. S. (2005). Analysis of Financial Time Series: Second Edition. Canada: A John Willey & Sons Inc.
- Ullah, Hidayat., Shahab e Saqib., Hazrat Usman. 2015. The Impact of Dividend Policy on Stock Price Volatility: A Case Study of Selected Firms from Textile Industry in Pakistan. International Journal of Academic Research in Economics and Management Sciences, 4(3): 40-51.
- Uma Sekaran, 2006. Metode Penelitian Bisnis. Jakarta: Salemba Empat.
- Undang-undang RI Nomor 8 Tahun 1995 tentang Pasar Modal.
- Widayati, Catharina Sri. (2009). Komparasi Beberapa Metode Estimasi Kesalahan Pengukuran. Jurnal Penelitian dan Evaluasi Pendidikan.
- Winarno, Wing Wahyu. 2009. "Analisis Ekonometrika dan Statistik dengan Eviews". Edisi 2. Yogyakarta: UPP STIM YKPN.
- _____. (2011). Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan Eviews, Edisi Ketiga. Yogyakarta : Unit Penerbit dan Percetakan (UPP STIM YKPN).
- Wu, G. (2001). The determinants of asymmetric volatility. The Review of Financial Studies, 14(3), 837–859. DOI:<https://doi.org/10.1093/rfs/14.3.837>.
www.idx.co.id. diakses pada tanggal 20 November 2019.
- www.yahoo-finance.com. diakses pada tanggal 2 Februari 2020.
- Yohanes, S dan Hokky S. 2003. "Sifat Statistika Data Ekonomi Keuangan Studi Empirik Beberapa Indeks Saham Indonesia". WPF 2003. Bandung FE Institute.
- Zakoian, M. 2010. GARCH Models : Structure, Statistical Inference and Financial Applications. English : Wiley.