

DAFTAR PUSTAKA

- Anoraga, P., dan Pakarti, P. 2008. *Pengantar Pasar Modal (Edisi Revisi)*. Jakarta: Rineka Cipta.
- Ariefianto, D. 2012. *Ekonometrika Esensi dan Aplikasi dengan Menggunakan Eviews*. Jakarta: Erlangga.
- Asimow, L. A., and Maxwell, M. M. 2010. *Probability and statistics with applications: A problem solving text*. Connecticut: ACTEX Publication, Inc., 2010.
- Aswi dan Sukarna. 2006. *Analisis Deret Waktu [Teori dan Aplikasi]*. Makasar: Andira Publisher.
- Awartani, B. M. A., dan Corradi, V. 2005. *Predicting the Volatility of the S & P-500 Stock Index Via GARCH models: the role of Asymmetries*. 21. 167-183.
- Badan Pengawas Pasar Modal. 2003. *Panduan Investasi di Pasar Modal Indonesia*. Jakarta: Badan Pengawas Pasar Modal.
- Bollerslev, T. 1986. *Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity*. *Journal of Econometrics*. **3** (1):307-327.
- Cryer, J. D., dan Chan, K. S. 2008. *Time Series Analysis With Applications in R*. New York: Springer Science-Business Media, LLC.
- Eliyawati, W. Y., Hidayat, R. R., dan Azizah, D. F. 2014. Penerapan Model Garch (*Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity*) Untuk Menguji Pasar Modal Efisien Di Indonesia. *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB)*. **7** (2).
- Emenogu, N. G., Adenomon, M. O., and Nweze, N. O. 2020. *On the volatility of daily stock returns of Total Nigeria Plc: evidence from GARCH models, value-at-risk and backtesting*. *Financ. Innov.* **6** (18).
- Engle, R.F. 1982. *Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of United Kingdom Inflation*. *Econometrica*. **50** (4): 987-1007.
- Fahmi, I., dan Yovi L. H. 2009. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Bandung: Alfabeta.
- Halim, Abdul. 2015. *Analisis Investasi dan Aplikasinya*. Jakarta: Salemba Empat.
- Juanda, B., dan Junaidi. 2012. *Ekonometrika Deret Waktu*. Bogor: IPB Press.

- Murwaningsari, E. 2008. Pengaruh Volume Perdagangan Saham, Deposito dan Kurs terhadap IHSG beserta prediksi IHSG (Model GARCH dan ARIMA). *Jurnal Ekonomi Dan Bisnis Indonesia*. **23** (2): 178–195.
- Nugroho, D. B., Anggraeni, K., dan Parhusip, H. A. 2020. Model Regresi untuk Return Aset dengan Volatilitas Mengikuti Model GARCH(1,1) Berdistribusi Epsilon-Skew Normal dan Student-t. *Jurnal of Mathematics and Its Applications*. **17** (2).
- Nugroho, D. B., dkk. 2019. Modeling of Returns Volatility using GARCH(1,1) Model Under Tukey Transformations. *Jurnal Akuntansi dan Keuangan*. **21** (1): 12–20.
- Pasaribu, R., dan Firdaus, M. 2013. Pengaruh Variabel Makro Terhadap Indeks Saham Syariah Di Indonesia Periode Pengamatan Mei 2012-April 201. ISSN: 1978-3116. **7** (2).
- Poon, S. H., dan Granger, C. 2003. Forecasting Financial Market Volatility: A Review. *Journal of Economic Literature*. **41** (2): 478–539.
- Salim, F. C., Nugroho, D. B., dan Susanto, B. 2016. Model Volatiltas GARCH(1,1) Dengan Error Student-t Untuk Kurs Beli EUR Dan JPY Terhadap IDR. *Jurnal MIPA*. **39** (1).
- Samsul, M. 2006. *Pasar Modal dan Manajemen Portfolio*. Jakarta: Erlangga.
- Untari, N., Mattjik, A., dan Saefuddin, A. 2009. Analisis Deret Waktu dengan Varian Galat Heterogen dan Asimetris: Studi Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Waktu 1999-2008, In *Forum Statistika dan Komputasi* ,50:(22-33).
- Wahyuni, S. T., Irawan, N., dan W, Dwiatmono A. 2005. Peramalan Volatilitas Indeks Harga Saham Menggunakan Model Asimetrik GARCH Dengan Distribusi Skewed Student-t. *Jurnal Matematika* . **8** (1).
- Wei, W. S. 2006. *Time Series Analysis, Univariate and Multivariate Method Second Edition*. New York: Pearson Education.
- Yahoo Finance. Historical Price Jakarta Composite Index (JKSE).2020. <https://finance.yahoo.com/> [1 Maret 2021]