

## DAFTAR PUSTAKA

- Aprilia, Ade Irma. (2014). Analisis Model Neuro-Garch Dan Model Backpropagation Untuk Peramalan Indeks Harga Saham Gabungan”, Skripsi (Medan: Universitas Sumatera Utara, 2014), h.20-21.
- Alexander, Carol. (2009). Market Risk Analysis, Value Risk Models. John Wiley dan Sons.
- Bollerslev, T. (1986). Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity. *Journal of Econometrics*, 31(3), 307–327. [https://doi.org/10.1016/0304-4076\(86\)90063-1](https://doi.org/10.1016/0304-4076(86)90063-1)
- Cryer, D. J., & Miller, R. B. (1994). *Statistics for Business*. California: Wadsworth Publishing Company, Inc.
- Darmaji, T. (2006). *Pasar Modal di Indonesia*. Jakarta: Salemba Empat.
- Desvina, A. P., & Rahmah, N. (2016). Penerapan Metode ARCH/GARCH Dalam Peramalan Indeks Harga Saham Sektoral. *Jurnal Sains Matematika Dan Statistika*, 2(1).
- Eliyawati, W. Y., R. R. Hidayat, dan D. F. Azizah. 2014. Penerapan Model GARCH (Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity) Untuk Menguji Pasar Modal Efisien Di Indonesia. *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB)*, Vol. 7 No.
- Enders, W. (1995). *Applied Econometric Time Series*. New York: John Wiley & Sons, Inc.
- Farizah, I. (2017). *Penerapan Model GARCH Dalam Mengukur Risiko Berinvestasi*. Universitas Islam Negeri Aluddin Makasar.
- Makridakis, Spyros. (1999). Metode dan Apliaski Peramalan. Jakarta: Erlangga
- Kabasarang, D. C., Setiawan, A., & Susanto, B. (2012). Uji Normalitas Dengan Menggunakan Statistik Jarque-Bera. Salatiga: SEMDIKMAD.
- Khoirunnisa, E. (2014). *Penerapan Metode ARCH/GARCH pada Pemodelan Harga Penutupan Saham di Bursa Efek Indonesia Periode 2005-2013*. Institut Pertanian Bogor.
- Ramadhan, B. A. (2013). Analisis Perbandingan Metode ARIMA dan Metode GARCH untuk Memprediksi Harga Saham (Studi Kasus Pada Perusahaan Telekomunikasi yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode Mei 2012-April 2013). *E-Processing of Management*, 2(April), 61–68.
- Rizanti, E. D. (2016). Pengaruh Tingkat Suku Bunga, Curret Ratio, Debt to Equitu Ration, dan Return on Equity Terhadap Harga Saham ( Studi pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia ( BEI ) Periode Februari 2013-Januari 2016 ), *51*(1), 184–190.

Rosadi, Dedi. (2011). Analisis Ekonometrika & Runtun Waktu Terapan dengan R. Yogyakarta: Andi

Sunarti, Mariani, S., & Sugiman. (2016). Perbandingan Akurasi Model ARCH dan Garch pada Peramalan Harga Saham Berbantuan Matlab. *UNNES Journal of Mathematics*, 5(1).

Syarif, A. (2014). Pemodelan dan Peramalan Penutupan Harga Saham Harian Jakarta Islamic Index Model Garch. *Jurnal Ekonomi Dan Bisnis Islam* /, IX(1), 57–66.

<http://finance.yahoo.com/quote/AAPL/history?period1=1262278800&period2=151453200&interval=1d&filter=history&frequency>



