

## DAFTAR PUSTAKA

- Agus, Sartono (2017). *Manajemen Keuangan Teori Dan Aplikasi: Edisi 4*. Yogyakarta: BPFE.
- Ananda, Vicky.I (2017). *Perbandingan Metode Antara GJR-GARCH dan EGARCH Pada Analisis Volatilitas Indeks Saham Syariah Indonesia*. Institut Teknologi Sepuluh Nopember.
- Aninda, F.S dan Jamaliatul, B (2017). *Metode Integrated Generalized Autoregressive Heteroscedasticity untuk Memodelkan Harga Gabah Dunia*. Univesitas Negeri Malang.
- Ariefianto, M.D. 2012. *Ekonometrika Esensi dan Aplikasi dengan Menggunakan EViews*. Erlangga, Jakarta.
- Assauri, S. 1993. *Manajemen Produksi dan Operasi*. Lembaga FEUI, Jakarta.
- Aziz, A. (2010). *Ekonometrika teori dan Praktik Eksperimen dengan MATLAB*. Malang: UIN Maliki Press.
- Batuparan, D.S. 2000. *Mengapa Risk Management? Edisi ke 4*. Jakarta: BEI News.
- Boediono dan Wayan, K. 2004. *Teiori dan Aplikasi Statistika dan Probabilitas*. Bandung : P.T Remaja Rosdakarya Offset.
- Bollersev, T. 1986. *Generalized Autoregressive Conditional Heterocedasticity*. *J.Econometrics*. pp. 307-327.
- Box, G.E.P, Jenkins, G.M, dan Reinsel, G.C. 1994. *Time Series Analysis Forecasting and Control. Edisi Revisi*. New York: John Willey & Sons Ltd..
- Chatfield, Dean C dkk. 2004. *The Bullwhip Effect-Impact of Stochastic Lead Time, Information Quality, and Information Sharing: A Simulation Study*. *Production and Operations Management*, Vol. 13 No. 4, pp. 340-353
- Cheng, W.L, Dolgion, G. 2020. *Estimating GARCH Models in Mongolion Stock Exchange With Value at Risk*. *Faculty of International Relations, University of Economics in Bratislava, Volume XVIII., Issue 3, Pages 263 – 275*.

- Cryer, J. D. 1986. *Times Series Analysis*. Boston: PWS-Kent Publishing Company.
- Davidson, R dan Mackinnon, J.G. 2004. *Econometric Theory and Methods*. New York: Oxford University Press.
- Engle, R. 2001. GARCH (1,1) The Use of ARCH/GARCH Models in Applied Econometric. *Journal of Economic Preprctive*, 15:157-168.
- Ekananda Mahyus. 2014. *Ekonomi Internasional*. Jakarta: Erlangga.
- Evi, S. 2011. *Model GARCH-M Untuk Estimasi Value At Risk (VaR) Data Harga Saham*. Skripsi. Universitas Islam Negeri Maulana Malik Ibrahim Malang.
- Febriana, Dian, Tarno, dan Sugito. 2014. *Perhitungan Value at Risk Menggunakan Model Integrated Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (IGARCH)*. *Jurnal Gaussian*. 3(4): 635-643
- Francq, C. and Zakoian, J.M. (2010) *GARCH Models: Structure, Statistical Inference and Financial Applications*. John Wiley & Sons Ltd., Chichester.
- Ghozali, I. 2009. *Ekonometri Teori, Konsep dan Aplikasi dengan SPSS 17*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Greene, W.H. 2003. *Econometric Analysis 5<sup>th</sup> ed*. New York: Prentice Hall Pearson Educatio. Inc..
- Gujarati, D. 2007. *Dasar–Dasar Ekonometrika Edisi Ketiga*. Jakarta: Erlangga.
- Hamdy, H. 2010. *Manajemen Keuangan Internasional (Edisi 2)*. Bogor. Mitra Wacana Media
- Hamdy, H. 1997. *Valas untuk manajer*. Jakarta: Ghalia Indonesia.
- Hartono, J. 2010. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi Edisi 7*. Yogyakarta: BPFE Press.
- Home, V dan Wachowicz, Jr. 1992. *Fundamental of Financial Management (9<sup>th</sup> ed.)* New York: Prentice Hall Pearson Education. Inc..
- Juanda, B. dan Junaidi. 2012. *Ekonometrika Deret Waktu Teori dan Aplikasi*. IPB PRESS, Bogor

- Jorion, P. 2007. *Value at Risk : The New Benchmark for managing Financial Risk*. New York : The McGraw Hill.
- Lo, M.S, 2003. *Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedastic Time Series Model*. Disertasi tidak diterbitkan. Canada: Simon Fraser University.
- Maidiah, Dwi. N.S, Sudarno dan Abdul Hoyyi. 2016. *Pemodelan Return Indeks Harga Saham Gabungan Menggunakan Threshold Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (TGARCH)*. Jurnal Gaussian. 5(3): 456-474
- Makridakis, S. Steven, C Wheelwright. Victor, E Mcgee. 1992. *Metode 123456789 dan Aplikasi Peramalan Jilid 2*. Jakarta: Erlangga.
- Maruddani, D. 2009. *Pengukuran Value At Risk pada Aset Tunggal dan Portofolio dengan Simulasi Monte Carlo*. Media Statistika. Vol.2. No.2
- Mishkin, F.S. 2010. *Ekonomi Uang, Perbankan dan Pasar Keuangan*. (diterjemahkan oleh Soelistyaningsih). Jakarta : Salemba Empat.
- Muhimmatul, A. 2020. *Implementasi Model Exponential GARCH-M Menggunakan Metode Maximum Likelihood*. Skripsi. Universitas Islam Negeri Maulana Malik Ibrahim Malang.
- Muis, S. 2008. *Meramalkan Pegerakan Saham Menggunakan Pendekatan Model Arima, Indeks Tunggal dan Markowitz*. Graha Ilmu, Yogyakarta
- Mursetya, Nendra.S.D 2016. *Identifikasi Model IGARCH (Integrated Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity) untuk peramalan Value at Risk*. Universitas PGRI Yogyakarta.
- Moran, J.L. and Solomon, P.J. (2017) *Volatility in High- Frequency Intensive Care Mortality Time Series: Application of Univariate and Multivariate GARCH Models*. Open Journal of Applied Sciences , 7, 385-411
- Morana, C. (2002) *IGARCH effects: an interpretation*, *Applied Economics Letters*, 9, 745–48.
- Nababan, M.R. (2008) *Kompetensi Penerjemahan dan Danpaknya pada Kualitas Terjemahan*. Pidato Pengukuhan Guru Besar Bidang Penerjemahan Universitas Sebelas Maret. Surakarta: Universitas Sebelas Maret.

- Okky,S dan Surya,Y. 2006. *Value At Risk yang Memperhatikan Sifat Statistika Distribusi Return*. Working Paper WPD 2006 : Bandung FE Institute.
- Pradewita, Wella Cintya. 2017. *Peramalan Volatilitas Risiko Berinvestasi Saham Menggunakan Metode GARCH – M dan ARIMAX – GARCH*. Skripsi. Jurusan Matematika Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam Universitas Negeri Semarang
- Ratnasari, Dwi Hasti. Vol 3, No 4 (2014): *Jurnal Gaussian - Articles Peramalan Volatilitas Menggunakan Model Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity in Mean (GARCH-M) (Studi kasus pada Return Harga Saham PT. Wijaya Karya)*.
- Robin, L. Lumsdaine. 1996, *Econometrica*, vol. 64, issue 3, 575-96.
- Rosadi, D. 2012. *Ekonometrika & Analisis Runtun Waktu Terapan dengan EViews*. Andi Offset, Yogyakarta.
- Ruppert, D. 2004. *Statistic and Finance an Introduction*. New York: Springer Inc..
- Shewhart, W.A. and Wilks, S.S. 2008. *Wiley Series in Probability and Statistics*. Jogn Willey & sons, Inc., New York.
- Supranto. 1984. *Ekonomi*. Buku Dua Ghalia, Indonesia.
- Tsay, Ruey S. *Analysis of Financial Time Series*. Chicago: A John Wiley and Sons, Ltd
- Tsay, R.S. 2002. *Analysis of Financial Time Series*. Canada: John Wiley and Sons, Inc
- Wei, W.W.S. 1990. *Times Series Analysis Univariate and Multivariate Methods*. California: Addison Wesley Publishing.
- Wei, W.W.S. 2006 *Time Series Analysis*. New York: Addison Wesley.
- Zubair. 2010. *Etika Bisnis dalam Perspektif Islam*. Jakarta: Salemba Empat