

DAFTAR PUSTAKA

- Abraham, Fazal J. S & Sulaiman A. A. 2002.. Testing the Random Walk Behavior and Efficiency of the Gulf Stock Markets. *The Financial Review*, Vol.37, No.3 : 469-480.
- Alwi, I.Z. 2003. *Pasar Modal, Teori dan Aplikasi*. Cetakan Pertama. Yayasan Pancur Siwah : Jakarta.
- Anityaloka & Ambarwati. 2013. Peramalan Saham Jakarta Islamic Index Menggunakan Metode ARIMA Bulan Mei-Juli 2010. *Jurnal Statistika*, Vol.1, No.1 : 3-5.
- Anton. 2006. *Analisis Model Volatilitas Return Saham*. Tesis yang tidak dipublikasikan Universitas Diponegoro, Semarang.
- Darmadji, T & Fakhruddin M.H. 2006. *Pasar Modal di Indonesia Pendekatan Tanya Jawab*. Salemba Empat : Jakarta.
- Eliyawati. 2014. Penerapan Model GARCH (Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity) Untuk Menguji Pasar Modal Efisien Di Indonesia (Studi Pada Harga Penutupan (Closing Price) Indeks Saham LQ45 Periode 2009-2011). *Jurnal Fakultas Ilmu Administrasi Bisnis*, Vol.7, No.2 : 5-10.
- Fahmi, I. 2013. *Pengantar Pasar Modal : Panduan bagi para Akademisi dan Praktisi Bisnis dalam Memahami Pasar Modal Indonesia*, Alfabeta : Bandung.
- Gitman, L & Zutter. 2012. *Principles of Managerial Finance*. 13th Edition. Global Edition : Pearson Education Limited.
- Gujarati, D.N & Porter D.C. 2015. *Dasar-dasar Ekonometrika*. Edisi kelima (Buku 2). Salemba Empat : Jakarta.
- Hartono, J. 2009. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, Edisi Kedelapan. BPFE-UGM : Yogyakarta.
- Hendrawan. 2012. Penerapan Model ARIMA Dalam Memprediksi IHSG. *Jurnal Integrasi Politeknik Batam Parkway Street*, Vol.4, No.2 : 205-211.
- Indrawan, R. 2014. *Metodologi Penelitian : Kuantitatif, Kualitatif, dan Campuran untuk Manajemen, Pembangunan, dan Pendidikan*. Cetakan Pertama. PT. Refika Aditama : Bandung.

- Johan, H. 2007. *Analisis Pengaruh Bursa Efek Luar Negeri Terhadap Bursa Efek Jakarta*. Tesis yang tidak dipublikasikan Universitas Diponegoro, Semarang.
- Junaidi. 2012. *Ekonometrika Deret Waktu : Teori dan Aplikasi*. Cetakan Pertama. IPB Press : Jakarta.
- Khajar, I. 2008. Pengujian Efisiensi Dan Peningkatan Efisiensi Bentuk Lemah Bursa Efek Indonesia Pada Saat Dan Sesudah Krisis Moneter Pada Saham-Saham LQ45. *Jurnal Manajemen Teori dan Terapan*, Vol.1, No.3 : 7-12.
- Lim, Kian-P, Sen L, Venus K & Wong. 2003 . *Weak Form Efficient Market Hypothesis, Behavioural Finance and Episodic Transient Dependencies: The Case of The Kuala Lumpur Stock Exchange*. Article Faculty of Economics and Management University Putra Malaysia.
- Meilani. 2010. Pengujian Efisiensi Pasar Modal Bentuk Lemah Di Bursa Efek Indonesia Pasca Penggabungan BEJ-BES. *Jurnal Ekonomi, Keuangan, Perbankan dan Akuntansi*, Vol.2, No.1 : 57-58.
- Manurung, A.H. 2005. Siklus Bursa Saham: Sebuah Penelitian Empiris di BEJ Januari 1988 – 2004. *Jurnal Bisnis & Birokrasi*, Vol. 13, No. 01 : 81 – 100.
- Mubarak, S. 2014. Penerapan Model GJSTEN Jagannathan Runkle Threshold Autoregressive Conditional Heteroskedasticity (GJR-TARCH) untuk Menduga Volatilitas Return Saham. *Jurnal Statistik*, Vol. 2, No. 4 : 186-190.
- Mukmin & Firmansyah. 2015. Analisis Perbandingan Volatilitas Indeks Harga Saham IHSG dan JII. *Jurnal Ekonomi dan Perbankan Syariah*, Vol.3, No.1 : 69-84.
- Nastiti, A. 2012. Analisis Volatilitas Saham Perusahaan Go Public dengan Metode ARCH-GARCH. *Jurnal Sains Dan Seni ITS*, Vol. 1, No. 1 : 261-264.
- Omran, M & Farrar, S. 2006. Test of Weak Form Efficiency in the Middle East Emerging Market. *Studies in Economics and Finance*, Vol.23, No.1 : 13-26.
- Paramitha. 2013. Perbandingan Model Volatilitas Data Return Dengan Menggunakan Model Exponentially Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (EGARCH) (1,1) Dan Threshold Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (TGARCH) (1,1). *Jurnal Mahasiswa Statistik*, Vol.1, No.4 : 64-71.

- Priyono. 2012. Efek Asimetris Dalam Volatilitas Return Indeks LQ45 : Pendekatan GJR-GARCH. *Jurnal Manajemen Indonesia*, Vol. 12, No.2 : 134-140.
- Rahayu, D. 2005. Pengaruh Kepemilikan Saham Manajerial dan Instiusional pada Struktur Modal Perusahaan. *Jurnal Akuntansi dan Auditing Vol.1, No.2 : 181-197*.
- Ramadhan. 2014. 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). *Jurnal Fakultas Ekonomi dan Bisnis*, Vol.1, No.3 : 4-8.
- Sadeq. 2008. *Analisis Prediksi Indeks Harga Saham Gabungan Dengan Metode ARIMA (Studi Pada IHSG di Bursa Efek Jakarta)*. Tesis yang tidak dipublikasikan Universitas Diponegoro, Semarang.
- Seyfried & Ewing. 2004. A time-varying volatility approach to modeling the phillips curve: A cross-country analysis. *Journal of Economic and Finance*, Vol. 28, No.2 : 186-197.
- Sevilla, C.G. 2007. *Research Methods*. Rex Printing Company. Quezon City.
- Suwardjono. 2010. *Teori Akuntansi: Pengungkapan dan Sarana Interpretatif*. Edisi Ketiga. BPFU-UGM : Yogyakarta.
- Syafaat. 2008. *Analisis Efisiensi Pasar Modal Dengan Menggunakan Metode Box Jenkins ARIMA*. Tesis yang tidak dipublikasikan Universitas Indonesia.
- Taftazani. 2014. *Dampak Krisis Keuangan Global 2008 Terhadap Volatilitas Return Saham Perbankan di BEI*. Tesis yang tidak dipublikasikan Sekolah Pascasarjana Program Ilmu Manajemen IPB.
- Widarjono, A. 2013. *Ekonometrika : Pengantar dan Aplikasinya*. Edisi Keempat. UPP STIM YKPN : Yogyakarta.
- Winarno. 2007. *Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan Eviews*. Cetakan Pertama. Yogyakarta : Unit Penerbit dan Percetakan Sekolah Tinggi Ilmu Manajemen YKPN : Yogyakarta.
- Yani. 2004. *Analisis Teknikal Harga Saham Dengan Metode ARIMA (Studi Pada IHSG di Bursa Efek Jakarta)*. Tesis yang tidak dipublikasikan Universitas Diponegoro, Semarang.