

DAFTAR PUSTAKA

- Adnyana, Made. 2020. *Manajemen Investasi Dan Portofolio*. Jakarta: Lembaga Penerbitan Universitas Nasional (LPU-UNAS).
- Badan Pusat Statistik (BPS). <https://bps.go.id> BPS Pertumbuhan Ekonomi 2021.
- Badu, Rhazilun M. 2021. *Pemodelan Harga Saham Dengan Pendekatan Model ARCH-GARCH*. Universitas Islam Negeri Maulana Malik Ibrahim.
- Box, George E.P., Jenkins, Gwilym M., Reinsel, Gregory C., dan Ljung, Greta M. 2016. *Time series Analysis Forecasting and Control Fifth Edition*. Canada: John Wiley & Sons, Inc.
- Carolina, R.A., Mulatsih, S., Anggraeni, L. 2016. *Analisis Volatilitas Harga dan Integrasi Pasar Kedelai Indonesia dengan Pasar Kedelai Dunia*. Vol. 34 No. 1. Jurnal Agro Ekonomi.
- Cryer, J.D., Chan, K.S. 2008. *Time Series Analysis with Application in R. Second Edition*. New York: Springer-Verlag.
- Data Harga Saham Penutupan PT. Gudang Garam Tbk Periode 04 Januari 2021 sampai 30 Desember 2021 diakses dari <https://investing.com/>.
- [Dowd, K. 2002. An Introduction to Market Risk Measurement. John Wiley & Sons, Inc. United States American.](#)
- Dwipa, N.M.S. 2016. *Peramalan Value at Risk Menggunakan Metode Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedastic*. Buletin Ilmiah Mat. Stat. dan Terapannya (Bimaster). Volume 05, No. 02, hal 267-276.
- Fadhilla, Dian R. 2014. *Pemodelan ARCH/GARCH Untuk Data Saham Dan Perhitungan VaR*. Universitas Andalas.
- Farizah, Icak. 2017. *Penerapan Model GARCH Dalam Mengukur Risiko Berinvestasi*. Universitas Islam Negeri Alauddin Makassar.
- Faydian. Puspa., Amsal, E.H, M. Irfan., Teguh, Ammar T., 2021. *Penerapan Model ARCH/GARCH Untuk Memprediksi Harga Saham Perusahaan Tokai Carbon*. Jurnal Sains dan Statistika Vol. 7, No. 2.

- Gaol, Boy.A.L., Nababan. T.P., Sirait, Haposan. 2015. *Perhitungan Vaue At Risk Harga Saham Dengan Menggunakan Volatilitas ARCH-GARCH Dalam Kelompok Saham LQ 45*. JOM FMIPA. Volume 2. No.2.
- Handini. Sri, Erwindyah, Aswawinetu. 2020. *Teori Porto Folio Dan Pasar Modal Indonesia*. Surabaya: Scorpio Media Pustaka.
- Hatidja, Djoni., 2011. *Penerapan Model ARIMA untuk Mempredksi Harga Saham PT. Telkom Tbk*. Jurnal Ilmiah Sains Vol. 11 No. 1.
- Hidayat, W.W. 2020. *Konsep Dasar Investasi Dan Pasar Modal*. Jakarta: Uwais Inspirasi Indonesia.
- Irawan, W. 2015. *Peramalan Harga Saham PT. Unilever Tbk. Dengan Menggunakan Model ARIMA*. Jurnal Matematika UNAND Vol. 4 No. 3 Hal. 80-89.
- Ismanto, Hadi. 2016. *Analisis Value at Risk Dalam Pembentukan Portofolio Optimal (Studi Empiris Pada Saham-Saham Yang Tergabung Dalam LQ45)*. The 3rd University Research Colloquium.
- Iswahyuli., H. Yoza., D. Devianto. 2018. *Peramalan Curah Hujan Bulanan Desa Sungai Ipuh Solok Selatan Dengan Model Autoregressive Integrated Moving Average*. Jurnal Matematika UNAND Vol. VII No. 1 Hal. 85-92.
- Jamila, A.U., Siregar, B.M., dan Yunis, R. 2021. *Analisis Runtun Waktu Untuk Memprediksi Jumlah Mahasiswa Baru Dengan Model Arima*. Paradigma Vol. 23 No. 1.
- Jorion, P. 2007. *Value at Risk: The New Benchmark for Managing Financial Risk. Third Edition. United States of America: McGraw-Hill Companies*.
- Juliarini, N.K., Sumarja, W., dan Sari. K. 2021. *Peramalan Volatilitas dan Estimasi Value at Risk (VaR) Saham Blue Chip pada Sektor Perbankan*. E-Jurnal Matematika Vol. 10(4).
- Kohar, A., Ahmar, N., Suratno. 2018. *Sensitivitas Faktor Ekonomi Makro dan Mikro dalam Memprediksi Volatilitas Harga Saham Perusahaan Sektor Industri Food & Beverages*. Jurnal Ilmiah Akuntansi Fakultas Ekonomi, Vol 4 No. 1.

- Lusikooy, Johanes., Nelson, Nainggolan., Jullia Titaley., 2017. *Prediksi Harga Tutup Saham PT. Garuda Indonesia Tbk Menggunakan Metode ARIMA*. Jurnal Mipa UNSRAT Online 6 (1) 74-77.
- Mahlindiani, L., Maiyastri., H. Yozza. *Penentuan Resiko Investasi Dengan Model GARCH Pada Indeks Harga Saham PT. Indofood Sukses Makmur Tbk*. Jurnal Matematika UNAND Vol. VI No. 1 Hal. 25-32.
- Marwa, Siti., Mahmuda, Dewi. 2021. *Analisis Perbandingan Volatilitas Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Sebelum Dan Pada Saat Terkena Dampak Covid*. Jurnal Ilmiah Mahasiswa Fakultas Ekonomi UMButon. Vol. 3 No. 1.
- Megawati., Martha, S., Kusnandar, D. 2020. *Pemodelan dan Peramalan Volatilitas Saham Menggunakan Model Integrated Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity*. Buletin Ilmiah Math. Stat. dan Terapannya (Bimaster) Vol. 09 No. 1 Hal-145-152.
- Mulyono, Sri. 2000. *Peramalan Harga Saham dan Nilai Tukar: Teknik Box-Jenkins*. Ekonomi dan keuangan Indonesia Vol. XLVIII No. 2.
- Nastiti, K. L. A., A. Suharsono. 2012. *Analisis Volatilitas Saham Perusahaan Go Public Dengan Metode ARCH-GARCH*. Jurnal Sains dan Seni ITS Vol.1 No.1 Hal. 259-264.
- Nugrahapsari, R.A., Arsanti, I.W. 2018. *Analisis Volatilitas Harga Cabai Keriting Di Indonesia dengan Pendekatan ARCH GARCH*. Jurnal Agro Ekonomi Vol. 36 No. 1.
- Puspitasari., Kurniasih, D., Kiloes, A.M., 2019. *Aplikasi Model ARCH/GARCH dalam menganalisis Volatilitas Harga Bawang Merah*. Informatika Pertanian Vol. 28 No.1.
- Putri, D. M., Aghsilni, 2019. *Estimasi Model Terbaik Untuk Peramalan Harga Saham PT. Polychem Indonesia Tbk. Dengan Model ARIMA*. MAp Journal, Vol. 1, No. 2.
- Putri, Gusti, M.A., Ni, Putu N.H., M. Nurhidayati, 2017. *Pemodelan Data Deret Waktu Dengan Autoregressive Integrated Moving Average Dan Logistic Smoothing Transition Autoregressive*. Jurnal VARIAN Volume. 1 No.1.
- Shumway, Robert H & David S. Stoffer. 2010. *Time Series Analysis and its Application: With R Examples*, Third Edition. USA: Springer.

- Sufianti, Evi. 2011. *Model GARCH-M Untuk Estimasi Value AT Risk (VaR) Data Harga Saham*. Universitas Islam Negeri Maulana Malik Ibrahim Malang.
- Suyitno. 2011. *Pengestimasian Parameter Model Autoregresif Pada Analisis Deret Waktu Univariat*. Jurnal EKSPONENSIAL Volume 2, Nomor 1.
- Tsay, R.S. 2005. *Analysis of Financial Time Series*. Canada: John Wiley and Sons, inc:2006.
- Wei, W.W.S. 2006. *Time Series Analysis: Univariate and Multivariate Methods. Second Editions*. New York: Pearson Education.
- Yulyanisa, L., D. Devianto., Maiyastri, 2019. *Model Inflasi Di Indonesia Dengan Menggunakan ARIMA*. Jurnal Matematika UNAND Vol. 2 No.1 Hal. 37-41.