

## DAFTAR PUSTAKA

- Al Shiab, Mohammad. (2006). *The Predictability of the Amman Stock Exchange Using the Univariate Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) Model*. Jordan: Journal of Economics & Administrative Sciences.
- Baroroh, Ali. (2008). *Trik-trik Analisis Statistik dengan SPSS15*. Jakarta: PT Elex Media Komputindo.
- Burnham, Kenneth P., Anderson, David R. (1998). *Model Selection and Multimodel Inference, a Practical Information – Theoretic Approach, Second Edition*. New York: Springer.
- Dariyus. (2010). *Analisis Random Walks Pada Harga Saham LQ 45 di Bursa Efek Indonesia Periode 2006-2008*. Lampung: Jurnal Bisnis dan Manajemen.
- Djalal, Nachrowi., & Usman, Hardius. (2004). *Teknik Pengambilan Keputusan*. Jakarta: Grasindo.
- Djalal, Nachrowi., & Usman, Hardius. (2007). *Prediksi IHSG dengan Model Garch dan Model ARIMA*. Jakarta: Jurnal Ekonomi dan Pembangunan Indonesia.
- Emenike., Kalu O. (2010). *Forecasting Nigerian Stock Exchange Returns: Evidence from Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) Model*. Nigeria: University of Nigeria.
- Ferlianto, Lie Ricky., Gondomulio, Evy I., & Laloan, Tina Rosjana. (2006). *Komoditi Investasi Paling Prospektif*. Jakarta: PT Elex Media Komputindo.
- Frick, Heinz. (2008). *Pedoman Karya Ilmiah*. Yogyakarta: Kanisius.
- Greene, William H. (2000). *Economic Analysis Fourth Edition*. New Jersey: Prentice Hall.
- Grestandhi, Jordan., Susanto, Bambang., & Mahatma, Tundjung. (2011). *Analisis Perbandingan Metode Peramalan Indeks Harga Saham*

*Gabungan (IHS) dengan Metode Ols-Arch/Garch dan ARIMA.*  
Salatiga: FSM UKSW.

- Gusnedi. (2002). *Analisis Pergerakan Indeks Harga Saham Sektor Pertambangan di Bursa Efek Jakarta*. Bogor: Institut Pertanian Bogor.
- Harinaldi. (2005). *Prinsip-prinsip Statistik untuk Teknik dan Sains*. Jakarta: Erlangga.
- Hariyani, Iswi., & Serfianto R. (2010). *Buku Pintar Hukum Bisnis Pasar Modal*. Jakarta: Visimedia.
- Hastie, Trevor., Tibshirani, Robert., & Friedman, Jerome. (2009). *The Elements of Statistical Learning Data Mining, Inference, and Prediction, Second Edition*. New York: Springer.
- Hatidja, Djoni. (2011). *Penerapan Model ARIMA untuk Memprediksi Harga Saham PT Telkom Tbk*. Manado: Universitas Sam Ratulangi.
- Herjanto, Eddy. (2007). *Manajemen Operasi (Edisi Ketiga)*. Jakarta: Grasindo.
- Hermawan, Asep. (2005). *Penelitian Bisnis Paradigma Kuantitatif*. Jakarta: Grasindo.
- Hidayat, Taufik. (2010). *Buku Pintar Investasi*. Jakarta: Mediakita.
- Iman, Nofie. (2008). *Panduan Singkat dan Praktis Memulai Investasi Reksadana*. Jakarta: PT Elex Media Komputindo.
- Indonesia Stock Exchange. (2008). *Saham Emiten yang Masuk dalam Penghitungan Indeks LQ45 No. Peng-364/BEI.PSH/U/07-2008*. Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Indonesia Stock Exchange. (2009). *Daftar Saham Perusahaan Tercatat yang Masuk dalam Penghitungan LQ45 No. Peng-12/BEI.PSH/U/01-2009*. Jakarta: Bursa Efek Indonesia.

- Indonesia Stock Exchange.* (2009). *Saham Emiten yang Masuk dalam Penghitungan Indeks LQ45 No. Peng-00283/BEI.PSH/07-2009.* Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Indonesia Stock Exchange.* (2010). *LQ45 Index Methodology.* Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Indonesia Stock Exchange.* (2010). *Saham Emiten yang Masuk dan Keluar dalam Penghitungan Indeks LQ45 No. Peng-00439/BEI.PSH/07-2010.* Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Indonesia Stock Exchange.* (2010). *Saham Emiten yang Masuk dan Keluar dalam Penghitungan Indeks LQ45 No. Peng-002/BEI.PSH/01-2010.* Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Indonesia Stock Exchange.* (2011). *Saham Emiten yang Masuk dan Keluar dalam Penghitungan Indeks LQ45 No. Peng-0023/BEI.PSH/01-2011.* Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Indonesia Stock Exchange.* (2011). *Saham Emiten yang Masuk dan Keluar dalam Penghitungan Indeks LQ45 No. Peng-00434/BEI.PSH/07-2011.* Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Indonesia Stock Exchange.* (2012). *Saham yang Masuk dan Keluar dalam Penghitungan Indeks LQ45 No. Peng-00011/BEI.PSH/01-2012.* Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Indonesia Stock Exchange.* (2012). *Saham yang Masuk dan Keluar dalam Penghitungan Indeks LQ45 No. Peng-00461/BEI.PSH/07-2012.* Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Jakarta Stock Exchange.* (2007). *Saham Emiten yang Masuk dalam Penghitungan Indeks LQ45 No. Peng-307/BEJ-DAG/U/07-2007.* Jakarta: PT Bursa Efek Jakarta.
- Karnadjaja, Agustino., et. al. (2007). *Smart Investment for Mega Profit.* Jakarta: PT Elex Media Komputindo.
- Kazmier, Leonard J. (2005). *Statistik untuk Bisnis.* Jakarta: Erlangga.

- Muninjaya, A. A. Gde. (2002). *Langkah-langkah Praktis Penyusunan Proposal dan Publikasi Ilmiah*. Jakarta: ECG.
- Nuraida, Ida. (2008). *Manajemen Administrasi Perkantoran*. Yogyakarta: Kanisius.
- Peter, M. Maksus. (2011). *Main Saham untuk Karyawan Kecil*. Yogyakarta: FlashBooks.
- Prasetya, Heri., & Lukiasuti, Fitri. (2009). *Manajemen Operasi*. Yogyakarta: Medpress.
- Rahardjo, Sapto. (2006). *Kiat Membangun Aset Kekayaan*. Jakarta: PT Elex Media Komputindo.
- Riduwan. (2010). *Metode dan Teknik Menyusun Tesis*. Bandung: Alfabeta.
- Rozak, Abdul. (2009). *Analisis Risiko dan Peramalan Harga Saham dalam Keputusan Investasi Pada Perusahaan Perkebunan di Bursa Efek Indonesia*. Bogor: Institut Pertanian Bogor.
- Sadeq, Ahmad. (2008). *Analisis Prediksi Indeks Harga Saham Gabungan dengan Metode ARIMA*. Semarang: Universitas Diponegoro.
- Salim, Joko. (2010). *Cara Gampang Bermain Saham*. Jakarta: Visimedia.
- Samsul, Mohamad. (2006). *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Erlangga.
- Sarwono, Jonathan. (2010). *Pintar Menulis Karya Ilmiah – Kunci Sukses dalam Menulis Ilmiah*. Yogyakarta: Andi Offset.
- Sfetsos, A., & Siriopoulos, C. (2002). *Artificial Intelligent Based Time Series Forecasting of Stock Prices Using Digital Filters*. Athen: Fuzzy Economic Review.
- Siagian, Dergibson., & Sugiarto. (2000). *Metode Statistika untuk Bisnis dan Ekonomi*. Jakarta: PT Gramedia Pustaka Utama.
- Sihombing, Gregorius. (2008). *Kaya dan Pinter Jadi Trader & Investor Saham*. Yogyakarta: Penerbit Indonesia Cerdas.

- Spiegel, Murray R., & Stephens, Larry J. (2007). *Schaum's Outlines Statistik (Edisi Ketiga)*. Jakarta: Erlangga.
- Stevenson, Simon. (2007). *A Comparison of the Forecasting Ability of ARIMA Models*. London: Journal of Property Investment & Finance.
- Sulistiyanto, H. Sri. (2008). *Manajemen Laba: Teori dan Model Empiris*. Jakarta: Grasindo.
- Sunariyah. (2003). *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal (Edisi Ketiga)*. Yogyakarta: YKPN.
- Syamsir, Hendra. (2004). *Solusi Investasi di Bursa Saham Indonesia*. Jakarta: PT Elex Media Komputindo.
- Tambunan, Andy Porman. (2007). *Menilai Harga Wajar Saham (Stock Valuation)*. Jakarta: PT Elex Media Komputindo.
- Tandelilin, Eduardus. (2010). *Portofolio dan Investasi*. Yogyakarta: Kanisius.
- Umar, Husein. (2002). *Metode Riset Bisnis*. Jakarta: PT Gramedia Pustaka Utama.
- UU R.I No.8/1995. *Undang-undang Republik Indonesia Nomor 8 Tahun 1995 Tentang Pasar Modal*.
- Widarjono, Agus. (2009). *Ekonometrika*. Yogyakarta: Ekonosia.
- Widoatmodjo, Sawidji. (2008). *Professional Investing*. Jakarta: PT Elex Media Komputindo.
- Yani, Ahmad. (2004). *Analisis Teknikal Harga Saham dengan Metode ARIMA (Studi Pada IHSG di Bursa Efek Jakarta)*. Semarang: Universitas Diponegoro.