

DAFTAR PUSTAKA

- Ariefianto, Moch. Doddy. (2012). *Ekonometrika Esensi dan Aplikasi dengan Menggunakan Eviews*. Jakarta: Erlangga.
- Agrawal *et.al.* (2010). *A Study of Exchange Rates Movement and Stock Market Volatility*. International Journal of Business and Management Vol. 5, No. 12.
- Bank Indonesia. www.bi.go.id diunduh pada 12 Oktober 2017.
- BEI. www.idx.co.id diunduh pada 12 Oktober 2017.
- BEI. (2010). *Buku Panduan Indeks Harga Saham Bursa Efek Indonesia*. Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Bodie, Zvi dan Kane, Alex dan Marcus, Alan J. (2014). *Manajemen Portofolio dan Investasi*. (Edisi 9). Jakarta: Salemba Empat.
- Darmadji, Tjiptono dan Fakhruddin, Hendy M. (2011). *Pasar Modal di Indonesia* (Edisi 3). Jakarta: Salemba Empat.
- Darmawan, Deni. (2013). *Metode Penelitian Kuantitatif* (Cetakan 1). Bandung: PT Remaja Rosdakarya Offset Bandung.
- Dzakiri, Rifqi. (2014). *The Impact of Inflation Rates and US Dollar Exchange Rates on Indonesian Stock Market Index Return Volatility periods 2002-2012 using GARCH Methodology*. Skripsi Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Telkom.
- Fahmi, Ihram. (2014). *Manajemen Keuangan Perusahaan dan Pasar Modal* (Edisi 1). Jakarta: Mitra Wacana Media.
- Fahmi, Irham. (2015). *Pengantar Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Bandung: Alfabeta.
- Firdaus, Ginanjar. (2015). *Analisis Pengaruh Nilai Tukar Dollar/Rupiah, Harga Emas Dunia, Harga Minyak Dunia, Indeks DJIA, Indeks Nikkei, Pembelian Bersih Asing terhadap Indeks Harga Saham Gabungan di Bursa Efek Indonesia Periode Tahun 2003-2013*. Tesis pada Universitas Dipenegoro.
- Fitriyah. (2012). *Pemodelan Harga Saham Menggunakan Model ARIMA-GARCH*. Skripsi Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam pada Institut Pertanian Bogor.
- Frensidy, Budi. (2008). *Analisis Pengaruh Aksi Beli-Jual Asing, Kurs, dan Indeks Hang Seng terhadap Indeks Harga Saham Gabungan di Bursa Efek Indonesia dengan Model GARCH*. Media Riset Bisnis & Manajemen Vol.8, No.1, April 2008, 25-42.
- Gujarati, Damodar N. dan Porter, Dawn C. (2012). *Dasar- Dasar Ekonometrika Buku 2* (Edisi 5). Jakarta: Salemba Empat.

- Habiba, Ika Febriana. (2014). *Pengaruh Volatilitas Nilai Tukar Rupiah/USD terhadap Volatilitas Indeks Saham (Studi pada Sub-Sektor Perbankan Indeks LQ45 Tahun 2012)*. Skripsi Fakultas Ekonomi dan Bisnis pada Universitas Telkom.
- Hartono, Jogyanto. (2013). *Teori Portofolio Dan Analisis Investasi* (Cetakan 1 Edisi 8). Yogyakarta: BPFE.
- id.investing.com diunduh pada 12 Oktober 2017.
- Islam, Mohd Aminul. (2014). Research Academy of Social Sciences. *A Study on the Performance of Symmetric and Asymmetric GARCH Models in Estimating Stock Returns Volatility*. International Journal of Empirical Finance Vol. 2, No. 4, 2014, 182-192.
- Juanda, Bambang dan Junaidi. (2012). *Ekonometrika Deret Waktu Teori dan Aplikasi* (Cetakan 1). Bogor: PT Penerbit IPB Press.
- Karim, Adiwarman A. (2007). *Ekonomi Makro Islam*. Jakarta: PT RajaGrafindo Persada.
- Kartika, Andi. (2010). *Volatilitas Harga Saham di Indonesia dan Malaysia*. Aset, Vol. 12 No.1, Maret 2010, 17-26, ISSN 1693-928X. Fakultas Ekonomi Universitas STIKUBANK.
- Karya, Detri dan Syamsuddin, Syamri. (2017). *Makroekonomi Pengantar untuk Manajemen* (Edisi 1). Jakarta: PT RajaGrafindo Persada.
- Khoirunnisa, Elok. (2014). *Penerapan Metode ARCH/GARCH pada Pemodelan Harga Penutupan Saham di Bursa Efek Indonesia Periode 2005-2013*. Skripsi Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam pada Institut Pertanian Bogor.
- Koostanto, Harya Buntala. (2013). *Pengaruh Inflasi, Suku Bunga, Nilai Tukar dan PDB terhadap Perubahan Tingkat Pengembalian Saham Perusahaan yang Terdaftar pada Bursa Efek Indonesia*. Skripsi Fakultas Ekonomi dan Manajemen pada Institut Pertanian Bogor.
- Laporan Tahunan Bursa Efek Indonesia. (2013).
- Laporan Tahunan Bursa Efek Indonesia. (2015).
- Mardiyati, Umi dan Rosalina, Ayi. (2013). *Analisis Pengaruh Nilai Tukar, Tingkat Suku Bunga dan Inflasi Terhadap Indeks Harga Saham Studi Kasus pada Perusahaan Properti yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia*. Jurnal Riset Manajemen Sains Indonesia (JRMSI) Vol. 4, No. 1.
- Martono, Nanang. (2010). *Metode Penelitian Kuantitatif: Analisis Isi dan Analisis Data Sekunder* (Edisi 1). Jakarta: PT RajaGrafindo Persada.
- Marta, Hadyatma Dahna. (2016). *Sifat Asimetris Model Prediksi Generalized Autoregressive Conditional Heterocedasticity (GARCH) dan Stochastic Volatility Autoregressive (SVAR)*. Bandung: Program Studi Ilmu Komputasi Telkom University.

- Murni, Asfia. (2013). *Ekonomika Makro* (Edisi Revisi, Cetakan 3). Bandung: PT Refika Aditama.
- Mustofa *et al.* (2017). *Analisis Pembentukan Portofolio Optimal dalam Rangka Meminimalkan Risiko dan Memaksimalkan Return*. Jurnal Administrasi Bisnis (JAB) Vol.53 No.2 Desember 2017.
- Noor, Henry Faizal. (2009). *Investasi, Pengelolaan Keuangan Bisnis dan Pengembangan Ekonomi Masyarakat* (Cetakan 1). Jakarta: PT Indeks.
- Permatasari, Tiko. (2014). *Pemodelan Volatilitas Asimetris Nilai Tukar dengan Metode Threshold GARCH: Studi Kasus ASEAN 2000-2013*. Skripsi Fakultas Ekonomi dan Manajemen pada Institut Pertanian Bogor.
- Pratama, Muhammad Anditia Putra. (2011). *Analisis Pengaruh Suku Bunga dan Nilai Tukar terhadap Volatilitas dan Return pada Indeks Saham Sektoral di Bursa Efek Indonesia*. Skripsi Fakultas Ekonomi dan Manajemen pada Institut Pertanian Bogor.
- Purwanto, Didik (2013, 7, Januari). Sepanjang 2012, Depresiasi Rupiah 6,9 persen[online]. Tersedia: <https://ekonomi.kompas.com/read/2013/01/07/16115921/Sepanjang.2012.Depresiasi.Rupiah.6.9.persen> [22 Maret 2018]
- Rosadi, Dedi. (2012). *Ekonometrika dan Analisis Runtun Waktu Terapan Dengan Eviews* (Edisi 1). Yogyakarta: Andi Offset.
- Rudhi dan Wahyudi, Sugeng. (2016). *Analisis Pengaruh Variabel Makroekonomi terhadap Indeks Harga Saham Agregat di Kawasan Asia Tenggara*. Tesis Magister Manajemen pada Universitas Diponegoro.
- Saadah, Siti. (2016). *Nilai Tukar Rupiah dan Kinerja Pasar Saham: Studi Empirik pada Bursa Saham Indonesia*. Jurnal Keuangan dan Perbankan, Vol.20, No.2, Mei 2016, 204-213, SK. No. 040/P/2014.
- Sari, Linda Karlina. (2017). *Pemodelan dan Transmisi Volatilitas Return Saham Utama Dunia terhadap Indonesia*. Tesis pada Institut Pertanian Bogor.
- Setiawan dan Kusrini, Dwi Endah. (2010). *Ekonometrika*. Yogyakarta: Andi Offset.
- Situmorang, M. Paulus. (2008). *Pengantar Pasar Modal*. Jakarta: Mitra Wacana Media.
- Sugiyono. (2017). *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif, dan R&D* (Cetakan 26). Bandung: Alfabeta.
- Sukirno, Sadono. (2008). *Makroekonomi Teori Pengantar* (Edisi 1). Jakarta: PT RajaGrafindo Persada.
- Susanti *et al.* (2015). *Analisis Model Threshold GARCH dan Model Exponential GARCH pada Peramalan IHSG*. UNNES Journal of Mathematics 5(1) (2016). [<http://journal.unnes.ac.id/sju/index.php/ujm>].

- Taftazani, Afif M. (2014). *Dampak Krisis Keuangan Global 2008 terhadap Volatilitas Return Saham Perbankan di Bursa Efek Indonesia (BEI)*. Tesis pada Institut Pertanian Bogor.
- Tandelilin, Eduardus. (2014). *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi* (Cetakan 5). Yogyakarta: Kanisius.
- Widarjono, Agus. (2017). *Ekonometrika Pengantar dan Aplikasinya Disertai Panduan Eviews* (Cetakan 3 Edisi 4). Yogyakarta: UPP STIM YKPN.
- Widoatmodjo, Sawidji. (2015). *Pengetahuan Pasar Modal untuk Konteks Indonesia*. Jakarta: PT Elex Media Komputindo Kompas Gramedia.
- Winarno, Wing Wahyu. (2011). *Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan EViews* (Edisi 3 Cetakan 1). Yogyakarta: UPP STIM YKPN.
- www.infovesta.com diunduh pada 22 April 2018.
- www.sahamok.com diunduh pada 18 Februari 2018.
- Zubir, Zakmi. (2011). *Manajemenen Portofolio: Penerapannya dalam Investasi Saham*. Jakarta: Salemba Empat.