

DAFTAR RUJUKAN

- Alwi, Z. Iskandar. 2008. *Pasar Modal Teori dan Aplikasi*. Jakarta: Yayasan Pancur Siwah
- Best, P. 2008. "Implementing Value at Risk". England: John Wiley & Sons, Inc. di dalam Santoso T. 2011. "Aplikasi Model GARCH pada Data Inflasi Bahan Makanan Indonesia 2005.1-2010".6. *Jurnal Organisasi dan Manajemen*, Vol 7 No.1, hal. 38-52
- Boediono. 2000. *Ekonomi Internasional*. BFFE. Yogyakarta.
- Bollerslev, T. 1986. Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (GARCH). *Journal of Econometrics*, 31, 307-327.
- Crouhy, M., D. Galai dan R. Mark. 2002. "Risk Manajement". New York: McGraw Hill
- Darmadji, T dan H. M. Fakhruddin. 2012. *Pasar Modal di Indonesia*. Edisi 3. Jakarta: Salemba Empat
- Dewi, Ni Made & Suaryana. 2016. "Pengaruh Volume Perdagangan Saham, Leverage, Dan Tingkat Suku Bunga Terhadap Volatilitas Harga Saham". *Jurnal Akuntansi Universitas Udayana.. Vol. 17, No. 2*.
- Engle, R. 1982. Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of United Kingdom Inflation. *Econometrica*, Vol. 50(4), pp. 987-1008.
- Fahrika, I & Roy, J. 2020. Dampak Pandemi Covid 19 Terhadap Perkembangan Makro Ekonomi di Indonesia dan Respon Kebijakan yang Ditempuh. *INOVASI- 16 (2)*, 2020; 206-213.
- Febriana, Dian., Tarno, dan Sugito. 2014. *Perhitungan Value at Risk Menggunakan Model Integrated Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (IGARCH)*. *Jurnal Gaussian*, Vol. 3, No. 4, Hal. 635-643.
- Firmansyah. 2006. *Analisis Volatilitas Harga Kopi Internasional*. Jakarta: Usahawan.

- Gerrish K, Lacey A. 2010. Glossary in: Gerrish K, Lacey A (eds). The research process in nursing. Oxford: Wiley-Blackwell, p. 533.
- Gujarati, Damodar, N. 2003. *Basic Econometric*. 4th Edition. New York: McGraw-Hill.
- Gujarati, Damodar. 2003. *Ekonometri Dasar*. Terjemahan: Sumarno Zain, Jakarta: Erlangga
- Halim, Abdul. 2015. *Analisis Investasi di Aset Keuangan*. Jakarta: Mitra Wacana Media.
- Hasanah, Hisyam. 2016. “Teknik-Teknik Observasi”. *Jurnal at-Taqaddum*, Vol. 8, No. 1.
- Hendikawati, P. 2015. *Peramalan Data Runtun Waktu: Metode dan Aplikasinya dengan Minitab & Eviews*. Semarang: FMIPA Universitas Negeri Semarang
- Hugida, Lydianita. 2011. “Analisis Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Volatilitas Harga Saham Study pada Perusahaan yang Terdaftar dalam Indeks LQ-4 Periode 2006-2009”. *Skripsi*. UNDIP Semarang.
- Ijtihadi, Ahmad F. 2010. “Analisis Pengukuran Value at Risk pada Portofolio Sukuk dan Obligasi”. Tesis Pascasarjana Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia.
- Iriani, N. P., Akbar, M. S., & Haryono. 2013. *Estimasi Value at Risk (VAR) pada Portofolio Saham dengan Copula*. *Jurnal Sains dan Seni POMITS*, Vol.2, No. 2.
- Jayanegara, I., Barry, H., & Hadikusuma, R. 2021. Analisis Volatilitas pada Return Saham Properti dan Real Estate dengan Menggunakan Model ARCH-GARCH di Masa Pandemi COVID-19. *Ekonomi dan Bisnis Politeknik Negeri Jakarta, 2021*.
- Jogiyanto, H. M. 2010. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Ketujuh. BPFE. Yogyakarta.
- Jorion, Philippe. 1997. *Financial Risk Manager Handbook*. GARP.
- Kartika, A. 2010. Volatilitas harga saham di Indonesia dan Malaysia. *Jurnal Ilmu Ekonomi ASET*, 12(1), 17–26.
- Kotze, A.A. 2005. Stock price volatility: a primer. *Financial Chaos Theory*.

- Lubrano & Bauwens. 1998. Bayesian Inference on GARCH models using the Gibbs Sampler. *Journal of Econometrics*, Vol. 1, hal. 23 – 46.
- Makridakis, S., Wheelwright, S. C. & McGee, V. E. 1992. *Metode dan Aplikasi Peramalan*. Jakarta: Erlangga.
- Nastiti, Khoiru L. A. & Suharsono, Agus. 2012. Analisis Volatilitas Saham Perusahaan Go Public dengan Metode ARCH-GARCH. *Jurnal Sains dan Seni ITS*, Vol. 1, No. 1. ISSN: 2301-9928X.
- Onoh, J. O., & Obioma, J. 2016. Monthly Stock Returns and Volatility: The Nigerian Capital Market. *World Journal of Finance and Investment Research* Vol. 1, No. 1.
- R. S. Tsay, Analysis of Financial Time Series, Canada: John Wiley & Sons, 2002.
- Saraswati, H. 2020. Dampak Pandemi Covid-19 Terhadap Pasar Saham di Indonesia. *JAD: Jurnal Riset Akuntansi dan Keuangan Dewantara* Vol. 3 No. 2, Hal. 153-163.
- Soedewi, Srie dan Purqon, A. 2015. Analisis Volatilitas Lima Saham Berbeda Sektor pada Indeks Kompas100 dengan Metode ARCH-GARCH. *Institut Tkenologi Bandung*
- Sudana, I Made. 2015. Teori dan Prsktik: Manajemen Keuangan Perusahaan. Jakarta: Penerbit Erlangga.
- Sugiyono. 2009. “Statistika untuk Penelitian”. Bandung: Alfabeta.
- Suliyanto. 2011. “Ekonometrika Terapan: Teori Dan Aplikasi Dengan SPSS”. Edisi 1. Yogyakarta: ANDI Yogyakarta
- Tandelilin, E. 2017. *Pasar Modal Manajemen Portofolio dan Investasi*. Yogyakarta: PT. Kanisius. Hal. 113.
- Tanjung, H & Siregar, T. 2018. Analisis Votalitas Saham di Jakarta Islamic Index (JII) periode Januari 2015-Januari 2018. *Journal of Islamic Economics, Finance and Banking*. Vol.1, No 1&2, pp. 147-157, ISSN p:2622-4755, e:2622-4798.
- Tanzeh, Ahmad. *Pengantar Metodologi Penelitian*. Yogyakarta: Teras. 2011. Hal. 99

- Tsay, R.S. 2005. *Analysis of Financial Time Series (Second ed)*. Now Jersey: John Wiley & Sons, Inc
- Utami dalam Saraswati, H. 2020. Dampak Pandemi Covid-19 Terhadap Pasar Saham di Indonesia. *JAD: Jurnal Riset Akuntansi dan Keuangan Dewantara Vol. 3 No. 2, Hal. 153-163*.
- Waharika, I. Away., Dharmawan, Komang, & Asih, Ni Made. 2013. Menaksir Value at Risk (VAR) Portofolio Pada Indeks Saham Dengan Metode Penduga Volatilitas GARCH. *e-Jurnal Matematika, Vol. 2, No.1*.
- Wahyuni, Desi. 2019. Dampak Pilpres Terhadap Gejolak Ekonomi: Efek Perbedaan 3 Pemilu Masa Capres Terhadap Volatilitas IHSG. *Jurnal Hukum dan Ekonomi Syariah, Vol. 07, No.2*.
- Widodo, Purwanto & Suryanto, Dede. 2021. Pengujian Terhadap Volatilitas Return Indeks Saham Konvensional Dengan Indeks Saham Syariah Sebelum dan Semasa COVID 19. *Jurnal Sosial Humaniora Terapan, Vol.4, No. 1. E-ISSN 2622-1152*
- Winarno, Slamet Heri. 2017. Penilaian Kinerja Keuangan Perusahaan Melalui Analisis Rasio Profitabilitas. *Jurnal Moneter 6(2):106–12*.
- Yohanes, S dan Hokky S. 2003. Sifat Statistika Data Ekonomi Keuangan Studi Empirik Beberapa Indeks Saham Indonesia. Bandung FE Institute
- Zainudin, R., Mahdzan, N. S., & Yet, C. H. (2018). Dividend policy and stock price volatility of industrial products firms in Malaysia. *International Journal of Emerging Markets, 13(1), 203– 217*. <https://doi.org/10.1108/IJoEM-09-2016-0250>.