

## DAFTAR PUSTAKA

- Anonim. 2012. *Definisi GARCH (Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity)*. Life Journal.
- BPS. 2014. *Inflasi*. Berita Resmi Statistik, Badan Pusat Statistik.
- Cooray, T.M.J.A. 2008. *Applied Time Series Analysis and Forecasting*. India: Narosa Publishing House Pvt. Ltd.
- Enders, Walter. 2004. *Applied Econometric Time Series Second Edition*. John Willey and Sons, Inc. India.
- Farida, Lina Suli. 2010. *Analisis Regresi Linier Berganda dengan Heteroskedastisitas Melalui Pendekatan Weight Least Square*. Skripsi. Fakultas Sains dan Teknologi. Jakarta: Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah.
- Francq, Christian dan Jean Michel Zakoian. 2010. *Garch Models*. John Willey and Sons Ltd. United Kingdom.
- Gilarso. 2004. *Pengantar Ilmu Ekonomi Makro*. Yogyakarta: PENERBIT KANISIUS.
- Gunawan, Anton Hermanto. 1991. *Anggaran Pemerintah dan Inflasi di Indonesia*. Jakarta: PT Gramedia Pustaka Utama.
- Halim, Siana, dkk. 1999. *Model Matematika untuk Menentukan Nilai Tukar Mata Uang Rupiah terhadap Dollar Amerika*. Jurnal Teknik Industri Vol. 1 No. 1. 30-40.
- Engle, R. 2001. *GARCH 101: The Use of ARCH/GARCH Models in Applied Econometric*. Journal of Economic Prespective. 15:157-168.
- Li, W.K., S. Ling dan M. McAleer. 2002. *Recent Theoretical Result for Time Series Models with GARCH Errors*. Journal of Economic Surveys Volume 16. 245-269.
- Lo, M.S. 2003. *Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedastic Time Series Models*. A project submitted in partial fulfillment of requirements for degree of master of science. Simon Fraser University.
- Makridakis, Spyros, Wheelwright S.C., dan McGee V. E. 1999. *Metode dan Aplikasi Peramalan Jilid 1*. Jakarta: Erlangga.

Nachrowi, Djalal dan Hardius Usman. 2005. *Penggunaan Teknik Ekonometri*. Jakarta: PT RajaGrafindo Persada.

Pikasilvianti. 2013. *Analisis ARCH dan GARCH Menggunakan Eviews*. <http://pikasilvianti.staff.ipb.ac.id/files/2013/05/Analisis-ARCH-dan-GARCH-menggunakan-EViews-WM.pdf>

Rosadi, Dedi. 2012. *Ekonometrika & Analisis Runtun Waktu Terapan dengan EViews*. Yogyakarta: Penerbit ANDI.

Rukini dan Suhartono. 2013. *Model ARIMAX dan Deteksi GARCH untuk Peramalan Inflasi Kota Denpasar*. Prosiding. Surabaya: Institut Teknologi Sepuluh November (ITS).

Sudjana. 2005. *Metoda Statistika*. Bandung: Penerbit TARSITO.

Surya, Y. dan H. Situngkir. 2004. *Sifat Statistika Data Ekonomi Keuangan (Studi Empirik Beberapa Indeks Saham Indonesia)*. Bandung FE Institute.

Surya, Y. dan Y. Hariadi. 2003. *Kulminasi Prediksi Data Daret Waktu Keuangan Volatilitas dalam GARCH(1,1)*. Working Paper WPF2003. Bandung FE Institute.

Wei, W. W. S. 2006. *Time Series Analysis Univariate and Multivariate Methodes Second Edition*. California: Addison Wesley Publishing.

Wikipedia. *Stationary Process*. 8 Januari 2014. [http://en.wikipedia.org/wiki/Stationary\\_process](http://en.wikipedia.org/wiki/Stationary_process).

Wikipedia. *Inflasi*. 15 Januari 2014. <http://id.wikipedia.org/wiki/inflasi>.

[www.bi.go.id](http://www.bi.go.id). *Definisi Inflasi*.