

## DAFTAR PUSTAKA

- Alwi, I Z. 2003. *Pasar Modal, Teori dan Aplikasi*. Jakarta: Yayasan Pancur Siwali. <http://jurnal-sdm.blogspot.com/2009/10/faktor-faktor-yang-mempengaruhi/>.
- Anoraga, Pandji dan Piji Pakarti. 2003. *Pengantar Pasar Modal*. Jakarta: Rineka Cipta.
- Aprilia, Ade Irma. 2014. *Analisis Model Neuro-GARCH dan Model Backpropagation Untuk Peramalan Indeks Harga Saham Gabungan*. Skripsi, FMIPA Medan, Indonesia: Universitas Sumatera Utara.
- Elvitra, Cindy Wahyu, dkk. 2013. *Metode Peramalan Menggunakan Model Volatilitas Asymmetric Power Autoregressive Conditional Heteroscedasticity pada Return Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dollar*. ISBN: 978-602-14387-01. Jurnal Statistika : UNDIP.
- Enders, Walter. 2004. *Applied Econometric Time Series Second Edition*. John Willey and Sons, Inc. India.
- Fathurahman, M. 2009. *Pemilihan Model Regresi Terbaik Menggunakan Metode Information Criterion dan Schwarz Information Criterion*. Vol. 4 No. 3, 3 September 2009. Jurnal Matematika : Mulawarman.
- Gujarati, Damodar N. 2006. *Dasar-Dasar Ekonometrika*. Jakarta: Erlangga.
- Hakim, N. L. 2012. *Model Jaringan Syaraf Tiruan dengan Peubah Input Berdasarkan Model ARIMA Terbaik*, Skripsi, Malang: Universitas Brawijaya.
- Hendrawan, Bambang. 2012. *Penerapan Model ARIMA dalam Memprediksi IHSB*. Vol. 4 No. 2, Oktober 2012, ISSN: 2085-3858. Jurnal Integrasi: Politeknik Negeri Batam.
- Kusumadewi, Sri. 2004. *Membangun Jaringan Syaraf Tiruan Menggunakan MATLAB dan Excel Link*. Yogyakarta: Graha Ilmu.
- Makridakis, Spyros, Wheelwright S.C., dan McGee V. E. 1999. *Metode dan Aplikasi Peramalan Jilid 1*. Jakarta: Erlangga.

- Maruddani, Di Asih I, dkk. 2008. *Uji Stasioneritas Data Inflasi Dengan Phillips-Peron Test*. Vol. 1. No. 1, Juni 2008. Jurnal Statistika: UNDIP.
- Minarti, Sri. 2014. *Penerapan Model GARCH pada Inflasi*. Skripsi, FMIPA Medan, Indonesia: Universitas Negeri Medan.
- 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>.
- Ramadhani, Theta Rizky. 2013. *Penerapan Model Neuro-GARCH untuk Peramalan Data Saham*. Vol.1 No.1. Hal 1-4. Jurnal Matematika: Universitas Brawijaya
- Setiawan dan Dwi Endah. 2010. *Ekonometrika*. Yogyakarta: Penerbit ANDI
- Santoso, Teguh. 2011. *Aplikasi Model GARCH pada Data Inflasi Bahan Makanan Indonesia*. Vol. 13. No.1, Maret 2011, ISSN: 1693-928X. Jurnal Magister Sain Ilmu Ekonomi: Univertas Gajah Maja.
- Siang, Jong Jek. 2005. *Jaringan Syaraf Tiruan dan Pemogramannya Menggunakan MATLAB*. Yogyakarta: Penerbit ANDI.
- Suyanto. 2007. *Artificial Intelligence Searching, Reasoning, Planning dan Learning*. Bandung: Informatika.
- Thonthowi, Ahmad D. 2012. *Manfaat Indeks Harga Saham*. <http://www.jurnas.com/halaman/11/2012-05-29/210409>. Di akses tanggal 9 November 2014.
- [http://id.wikipedia.org/wiki/Indeks\\_Harga\\_Saham\\_Gabungan](http://id.wikipedia.org/wiki/Indeks_Harga_Saham_Gabungan), di akses pada tanggal 12 November 2014.
- [http://en.wikipedia.org/wiki/Stationary\\_process](http://en.wikipedia.org/wiki/Stationary_process), di akses pada tanggal 12 November 2014
- <http://bisnisbermoral.blogspot.com/2008/03/manfaat-indeks-saham>, di akses pada tanggal 26 Januari 2015