

DAFTAR PUSTAKA

- Bollerslev, Tim. (2007). *Glossary to ARCH*. [Online]. Tersedia: (GARCH)*[Shttp://www.google.co.id/#q=ARCH+%28Autoregressive,+Conditional+Heteroscedasticity+Runkle+GARCH%29&hl=id&start=10&sa=N&fp=cdb10cf31c974f8f](http://www.google.co.id/#q=ARCH+%28Autoregressive,+Conditional+Heteroscedasticity+Runkle+GARCH%29&hl=id&start=10&sa=N&fp=cdb10cf31c974f8f) [4 April 2010].
- Enders, W. (2004). *Applied Econometric Time Series*. New Jersey: John Wiley & Sons, Inc.
- Granger, Clive, W. J. (1999). *Cointegration Causality and Forecasting*. New York: Oxford University Press Inc.
- Habsah, Siti. (2009). *Model Volatilitas Exponential Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (EGARCH)*. Tugas Akhir Sarjana Universitas Pendidikan Indonesia Bandung : tidak diterbitkan.
- Ispriyanti, Dwi . (2004). *Pemodelan Statistika dengan Transformasi Box Cox*. [Online]. Tersedia : http://eprints.undip.ac.id/2239/1/2_box_cox_-_Dwi_Isprianti.pdf [1 Juni 2010].
- Laurent , Sebastian. (2003). *Analytical derivates of the APARCH Model*. [Online]. Tersedia : <http://www.core.ucl.ac.be/~laurent/pdf/CE.pdf> [11 Mei 2010].
- Penzer, Jeremy , Wang, Mingjin, dan Yaou, Qiwei. *Approximating Volatilities by Asymmetric Power GARCH Functions*. [Online]. Tersedia : <http://stats.lse.ac.uk/penzer/papers/apgarch.pdf> [11 Mei 2010].
- Sanjoyo. (2006). *Non-Linear Estimation*. [Online]. Tersedia : <http://mhs.blog.ui.ac.id/sanj55/files/2008/11/non-linier.pdf> [11 Mei 2010].

Soejoeti, Zanzawi, Ph.D. (1987). *Analisis Runtun Waktu*. Jakarta: Karunia Jakarta Universitas Terbuka.

Tsay, Ruey.S. (2002). *Analysis of Finansial Time Series*. New Jersey: John Wiley & Sons, Inc. [Online]. Tersedia : <http://dedirosadi.staff.ugm.ac.id/ARW/tsaychapter3.pdf> [11 Mei 2010].

Universitas Pendidikan Indonesia. *Pedoman Penulisan Karya Ilmiah*. Bandung : UPI Press.

Untari, Nirawati. (2009). *Analisis Data Deret Waktu dengan Ragam Galat Heterogen dan Asimetrik*. Skripsi Sarjana Institut Pertanian Bogor : tidak diterbitkan.

Wahyudi, Deni Maulana. (2009). *Ramalan Suhu Udara Musim Panas di kota Munich*. Makalah Mata Kuliah Metode Runtun Waktu Universitas Pendidikan Indonesia Bandung : Tidak diterbitkan.

Wibowo, Tri dan Amir, Hidayat. (2005). *Faktor-faktor yang Mempengaruhi Nilai Tukar Rupiah*. [Online]. Tersedia : <http://mashidayat.files.wordpress.com/2007/12/02-faktor-yang-mempengaruhi-nilai-tukar-kek-des-2005.pdf> [6 Juni 2010].

_____, *Kurs Uang Kertas Asing Mata Uang JPY*. [Online]. Tersedia : <http://www.bi.go>. [5 Juli 2010].