

DAFTAR PUSTAKA

- Alexander, Carol. (2008). *Practical Financial Econometrics*. West Sussex: John Wiley & Sons, Ltd.
- Aqrobah, Lutfi. (2007). *Model Runtun Waktu EGARCH*. Skripsi Sarjana pada FMIPA UGM Yogyakarta: tidak diterbitkan.
- Engle, R. *Threshold ARCH Models and Asymmetries in Volatility*. Journal of Applied Econometrics. January/March, 8:1, pp. 31-49. Tersedia: [www-stat.wharton.upenn.edu/~steele/Courses/434/434Context/GARCH/garch101\(ENGLE\).pdf](http://www-stat.wharton.upenn.edu/~steele/Courses/434/434Context/GARCH/garch101(ENGLE).pdf) [20 Januari 2009]
- Extension of The GARCH Models*. Tersedia: www.hu.berlin.de/tutorials/sfehtmlnode67.pdf [20 Januari 2009]
- Fransisca, Meidi. (2003). *Penerapan ARCH pada Return untuk Forecast Harga Saham*. Skripsi Sarjana pada FMIPA ITB Bandung: tidak diterbitkan.
- Greene, William H. (2003). *Econometrica Analysis*. New Jersey: Pearson Education International.
- Irvine, CA. (2000). *EViews 4.0 Users Guide*. USA: Quantitative Micro Software.
- Kierkegaard, John. (2000). *Estimation of Non Linear Stochastic Process*. Denmark: IMM.
- Onody, Roberto, Favaro, G.M., dan Cazaroto, Erike. *Gaussian and Exponential GARCH*. Tersedia: www.if.sc.usp.br/onody/econofisika.pdf. [20 Januari 2009]
- Pratiwi, Resi. (2000). *Model Volatilitas ARCH dan GARCH*. Skripsi Sarjana pada FMIPA ITB Bandung: tidak diterbitkan.
- Ruppert, David. (2004). *Statistic and Finance: An Introduction*. New York: Springer-Verlag.

Soejoeti, Zanzawi. *Analisis Runtun Waktu*. 1987. Jakarta : Karunia Jakarta Universitas Terbuka.

Tsay, R. (2005). *Analysis of Finansial Time Series*. New Jersey: John Wiley & Sons, Inc.

Wei, William. (2006). *Time Series Analysis*. Philadelphia: Temple Pearson International.

Widarjono, Agus. (2005). *Ekonometrika: Teori dan Aplikasi*. Edisi Pertama. Yogyakarta: EKONISIA.

<http://finance.yahoo.com/q/cp?s=^JKSE7alpha=HMSP.JK> [19 Juni 2009]

