

## DAFTAR PUSTAKA

- Angraeny, Nella (2019), "Penerapan Metode ARCH GARCH untuk Analisis Peramalan Nilai Ekspor Indonesia". Skripsi. FMIPA, Matematika, Universitas Negeri Semarang, Semarang.
- Ati, Enggar Niken Laras (2015), "Analisis Volatilitas Forecasting Sembilan Bahan Pokok menggunakan Metode GARCH dengan Program R". Skripsi. FMIPA, Matematika, Universitas Negeri Semarang, Semarang.
- Darmayati, Novi dkk. (2020), "Dampak Vovid-19 Terhadap Perubahan Harga dan Return Saham", *Jurnal Ekonomi dan Keuangan*, Vol. 4 No. 4, Hal. 462-480
- Eliyawati, Wenty Yolanda dkk (2014), "Penerapan Model GARCH untuk Menguji Pasar Modal Efisien di Indonesia", *Jurnal Administrasi Bisnis*, Vol. 7 No. 2, Hal. 1-10
- Faustina, Riza Silvia dkk. (2017), "Model Hybrid ARIMA-GARCH untuk Estimasi Volatilitas Harga Emas Menggunakan Software R", *UNNES Journal of Mathematics*, Vol. 6 No. 1, Hal. 11-24
- Farizah, Icak (2017), "Penerapan Model GARCH dalam Mengukur Risiko Berinvestasi". Skripsi. Fakultas Sains dan Teknologi, Matematika, Universitas Islam Negeri Alaudin, Makassar.
- Hermansah (2015). "Penggunaan Metode Peramalan dalam Analisis Nilai Tukar Rupiah terhadap Dolar dengan GARCH". *Phytagoras*, Vol. 4 No. 2, Hal. 77-88
- Hikmah, Nur Falilah Nurul (2018), "Perbandingan Metode Arima-Garch Dan Fuzzy Time Series Markov Chain Dalam Peramalan Data Harga Minyak Mentah Dunia (Studi Kasus: Data Harga Minyak Mentah Dunia Tahun 2001-2017)". Skripsi. FMIPA, Statistika, Universitas Islam Indonesia, Yogyakarta.
- Inlistya, Vicky Ananda (2017), "Perbandingan Metode Antara Gjr-Garch Dan Egarch Pada Analisis Volatilitas Indeks Saham Syariah Indonesia". Skripsi. FMIPA, Matematika, Intitut Teknologi Sepuluh Nopember, Surabaya.

- Maulana, Yasir (2020), “Analisis Volatilitas Return Saham PT. Antam (Persero) Tbk dan PT. Adaro Energy Tbk dengan GARCH, EGARCH, dan GJR”, *Jurnal Akuntansi dan Pajak*, Vol. 20 No. 2, Hal. 197-200
- Nastiti, Khoiru Liummah Ayu dan Agus Suarsono (2012), “Analisis Volatilitas Saham Perusahaan Go Public dengan Metode ARCH-GARCH”, *Jurnal sains dan Seni*, Vol. 1 No. 1, Hal, 259-164
- Nurmasari, Ifa (2020), “Dampak Covid-19 Terhadap Perubahan Harga Saham dan Volume Transaksi (Studi Kasus pada PT. Ramayana Lestari Sentosa, Tbk.)”, *Jurnal Saham, Ekonomi, Keuangan, dan Investasi*, Vol. 3 No.3, Hal. 230-236
- Raneo, Agung Putra dan Fida Muthia (2018), “Penerapan Model GARCH dalam Peramalan Volatilitas di Bursa Efek Indonesia”, *Jurnal Manajemen dan Bisnis Sriwijaya*, Vol. 15 No. 3, Hal 194-202
- Wicaksono, Agung dan Rahandika Ivan Adyaksana (2020), “Analisis Reaksi Investor Sebagai Dampak Covid-19 pada Sektor Perbankan di Indonesia”, *Jurnal Ilmiah Akuntansi Fakultas Ekonomi*, Vol. 6 No. 2, Hal. 129-138
- Widyastuti, Nur Laila dan Hanan Nugroho (2020), “Dampak Covid-19 terhadap Industri Minyak dan Gas Bumi: Rekomendasi Kebijakan untuk Indonesia”, *The Indonesian Journal of Development Planning*, Vol. 4 No. 2, Hal. 166-176
- Yolanda, Natasya Bella dkk. (2017), “Penerapan Model ARIMA-GARCH untuk Memprediksi Harga Saham Bank BRI”, *Jurnal MIPA UNSRAT*, Vol. 6 No. 2, Hal. 92-96

