

## DAFTAR PUSTAKA

- Affianti, I.R., Agustini, F., dan Putri, E.R.M. (2018), “Stock price prediction using geometric brownian motion”, *International Conference on Mathematics: Pure, Applied and Computation : Journal of Physics*. Institut Teknologi Sepuluh Nopember.
- Affianti, I.R. (2015), *Prediksi Harga Saham Menggunakan Geometric Brownian Motion*, Skripsi, Institut Teknologi Sepuluh Nopember, Surabaya.
- Akbriani, Rosiana. (2015), *Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Saham dengan Menggunakan Model Indeks Tunggal*, Skripsi, Universitas Negeri Yogyakarta, Yogyakarta.
- BBCA, BBRI, HMSP. (2019). Saham. [online] tersedia di: <https://finance.yahoo.com/> [diakses pada tanggal 19 April 2019].
- Benth, F.E. (2004), *Option Theory with Stochastic Analysis : An Introduction to Mathematical Finance*, Springer –Verlag Berlin Heidelberg: Oslo.
- BI 7 Days Repo Rate. (2019). Saham. [online] tersedia di: <https://www.bi.go.id/en/moneter/bi-7-day-RR/data/Contents/Default.aspx> [diakses pada tanggal 28 Agustus 2019].
- Bisnis Indonesia. (2019). REKOMENDASI SAHAM : BBCA Menuju Level Rp. 30.500?. [online] tersedia di: <https://market.bisnis.com/read/20190312/189/898489/rekomendasi-saham-bbca-menuju-level-rp30.500> [diakses pada tanggal 3 Januari 2020].
- Bursa Efek Indonesia. (2019). Saham. [online] tersedia di: <https://www.idx.co.id/produk/saham/> [diakses pada tanggal 19 Juli 2019].
- Dmouj, A. (2006), “Stock price modelling: Theory and Practice”. Vrije Universiteit Faculty of sciences Amsterdam, The Netherlands.

- Fitria, Irma. (2016), *Optimasi Portofolio Dalam Manajemen Investasi Saham Berdasarkan Pada Prediksi Harga Saham*, Tesis, Institut Teknologi Sepuluh Nopember, Surabaya.
- Hartono, J. (2017), *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, Edisi Kesebelas, BPFE Universitas Gadjah Mada : Yogyakarta.
- IHSG. (2019). Saham. [online] tersedia di: <https://finance.yahoo.com/> [diakses pada tanggal 28 Agustus 2019].
- Kontan. (2019). Harga Saham HM Sampoerna (HMSP) Cenderung Turun Dalam Tiga Bulan, Ini Sebabnya. [online] tersedia di: <https://investasi.kontan.co.id/news/harga-saham-hm-sampoerna-hmsp-cenderung-turun-dalam-tiga-bulan-ini-sebabnya> [diakses pada tanggal 3 Januari 2020].
- Lawrence, K.D., Klimberg R. K., dan Lawrence S. M. (2009), *Fundamentals of forecasting using excel*, Industri Press Inc, America.
- Ma'aruf, Ahmad & Wihastuti, L. (2008). "Pertumbuhan Ekonomi Indonesia: Determinan dan Prospeknya". *Jurnal Ekonomi dan Studi Pembangunan*, 9(1):44-45.
- Nachrowi, Djalal dan Usman, Hardius. (2006), *Pendekatan Populer dan Praktis Ekonometrika untuk Analisis Ekonomi dan Keuangan*, Badan Penerbit Universitas Indonesia : Jakarta.
- Omar, A., Jaffar, M.M.. (2011), "Forecasting Share Price of Small Size Companies in Bursa, Malaysia Using Geometric Brownian Motion". *Journal International, Applied Mathematics & Information Sciences* 8, No.1, hal. 107-112.
- Tandelilin, Eduardus. (2007), *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*, BPFE, Universitas Gadjah Mada : Yogyakarta.
- Willmot, P. (2007), *Introduces Quatitative Finance*, 2<sup>nd</sup> edition, John Wiley & Son, Ltd : Chichester.