

DAFTAR PUSTAKA

- Anoraga, Pandji dan Pakarti, Piji. 2001. *Pengantar Pasar Modal*. Jakarta: PT.Rineka Cipta.
- Anton. 2006. *Analisis Model Volatilitas Return Saham*. Semarang: Universitas Diponegoro.
- Ariefianto, Doddy. 2012. *Ekonometrika: Esensi dan aplikasi dengan menggunakan Eviews*. Erlangga
- Eliyawati, Wenty Yolanda. 2012. *Penerapan Model GARCH (Generalized Autoregressive Conditional Heterokedasticity) untuk menguji Pasar Modal Efesien Di Indonesia*. Malang: Universitas Brawijaya
- Ferdinand, Augusty. 2006. *Metode Penelitian Manajemen*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Firdaus, Muhammad. 2011. *Ekonometrika Suatu pendekatan Aplikatif*, Jakarta: PT. Bumi Aksara.
- Husnan, Suad. 2003. *Teori Portofolio Analisis Sekuritas*, Cetakan Ketiga. Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan AMP YKPN.
- Jogiyanto. 2003. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi, Edisi Ketiga*. Yogyakarta: BPFE-YOGYAKATRA
- Mitha,Tiara.2014. *Peramalan Volatilitas Return dan Volatilitas Risk menggunakan Model GARCH (Generalized Autoregressive Conditional Heterokedasticity)*: Universitas Lampung.
- PT. Adro Energy Tbk, <http://www.britama.com/index.php/2012/05/sejarah-dan-profil-singkat-adro/>
- PT. AKR Corporindo Tbk, <http://www.britama.com/index.php/2012/05/sejarah-dan-profil-singkat-akra/>
- PT. Astra Internasional Tbk, <http://www.britama.com/index.php/2012/05/sejarah-dan-profil-singkat-asii/>

- PT. Alam Sutra Realty Tbk, <http://www.britama.com/index.php/2012/05/sejarah-dan-profil-singkat-asri/>
- PT. Charoen Pokphan Indonesia Tbk, <http://www.britama.com/index.php/2012/10/sejarah-dan-profil-singkat-cpin/>
- PT. Harum Energy Tbk, <http://www.britama.com/index.php/2012/10/sejarah-dan-profil-singkat-hrum/>
- PT. Indofood CBP Sukses Makmur Tbk, http://id.wikipedia.org/wiki/Indofood_Sukses_Makmur
- PT. Indocement Tunggul Prakarsa Tbk, http://id.wikipedia.org/wiki/Indocement_Tunggul_Prakarsa
- PT. Indo Tambangraya Mega Tbk, <http://www.itmg.co.id/id/page/about-us/history>
- PT. Kalbe Farma Tbk, <http://www.britama.com/index.php/2012/11/sejarah-dan-profil-singkat-klbf/>
- PT. Lippo Karawaci Tbk, <http://www.britama.com/index.php/2012/11/sejarah-dan-profil-singkat-lpkr/>
- PT. PP London Sumatra Indonesia Tbk, <http://www.britama.com/index.php/2012/11/sejarah-dan-profil-singkat-lsip/>
- PT. Tambang Batu Bara Bukit Asam Tbk, <http://ptba.co.id/id/about/history>
- PT. Semen Indonesia (Persero) Tbk, http://id.wikipedia.org/wiki/Semen_Indonesia
- PT. Telekomunikasi Indonesia Tbk, <http://www.telkom.co.id/category/investor-relations/profil-perusahaan>
- PT. United Tractors Tbk, <http://www.britama.com/index.php/2012/06/sejarah-dan-profil-singkat-untr/>
- PT. Unilever Indonesia Tbk, <http://www.unilever.co.id/id/aboutus/ourhistory/>
- Rosadi, Dedi. 2011. *Analisis Ekonometrika & Runtun Waktu Terapan dengan R*. Yogyakarta: ANDI.
- Sarwono, Jonathan dan Hendra. 2014. *Eviews: Cara Operasi dan Prosedur Analisis*. Yogyakarta: ANDI
- Setya, Tryning Rahayu. <http://profil.merdeka.com/indonesia/p/pt-astra-agro-lestari-tbk/>

Sugiyono. 2013. *Metode Penelitian Bisnis*. Bandung: Penerbit Alfabeta.

Sutedi, Adrian. 2011. *Pasar Modal Syariah*. Jakarta: Sinar Grafika.

Tandelilin, Eduardus. 2010. *Portofolio dan Investasi*. Yogyakarta: PT.Kanisius

Widarjono, Agus, 2013, *Ekonometrika: Pengantar dan Aplikasinya*. Edisi Keempat. Yogyakarta: UPP STIM YKPN.