

DAFTAR PUSTAKA

- Amelia, N. (2015). *Pemodelan volatilitas menggunakan metode constant conditional correlation multivariate GARCH pada pasar modal Indonesia* (Tesis Sarjana, Institut Teknologi Sepuluh Nopember).
- Chalimatusadiah, C., Lesmana, D. C., & Budiarti, R. (2021). Penentuan harga opsi dengan volatilitas stokastik menggunakan metode Monte Carlo. *Jambura Journal of Mathematics*, 3(1), 80–92. <https://doi.org/10.34312/jjom.v3i1.10137>
- Febrianti, W. (2018). Penentuan harga opsi dengan model Black-Scholes menggunakan metode beda hingga forward time central space. *Journal of Fundamental Mathematics and Applications (JFMA)*, 1(1), 45–51.
- Haruman, T., & Hendrawan, R. (2009). Pengujian GARCH option model untuk barrier option di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Keuangan dan Perbankan*, 13(2), 228–236.
- Jange, B. (2023). Prediksi volatilitas indeks harga saham gabungan menggunakan GARCH. *Arbitrase: Journal of Economics and Accounting*, 4(1), 1–6. <https://doi.org/10.47065/arbitrase.v4i1.1122>
- Kurniawati, N. P., Yundari, & Rizki, S. W. (2022). Analisis harga opsi beli tipe Eropa dengan metode antithetic variate dari Monte Carlo. *Jurnal EurekaMatika*, 10(1), 53–60. <https://doi.org/10.17509/e.v10i1.47673>
- Kusumahadi, K., & Sastika, W. (2015). Analisis perbandingan penentuan harga call option dengan menggunakan metode Black-Scholes dan metode simulasi Monte Carlo. *Ecodemica*, 3(1), 355–362.
- Mooy, M. N., Rusgiyono, A., & Rahmawati, R. (2017). Penentuan harga opsi put dan call tipe Eropa terhadap saham menggunakan model Black-Scholes. *Jurnal Gaussian*, 6(3), 407–417. <https://doi.org/10.14710/j.gauss.6.3.407-417>
- Nadia, S., Sulistianingsih, E., & Imro'ah, N. (2018). Penentuan harga opsi tipe Eropa dengan metode binomial. *Buletin Ilmiah Matematika, Statistika dan Terapannya (Bimaster)*, 7(2), 127–134.
- Nissa, Q., Satyahadewi, N., & Perdana, H. (2020). Penentuan harga opsi beli tipe Eropa menggunakan metode trinomial. *Buletin Ilmiah Math. Stat. dan Terapannya (Bimaster)*, 9(3), 379–386.
- Nugraheni, S., Fadilla, A., & Solihah, D. R. (2022). Pemodelan volatilitas indeks harga saham dengan metode GARCH dan E-GARCH: Studi kasus pada Jakarta Stock Exchange Composite Index (JCI) dan Strait Times Index (STI). *Ekonomi dan Bisnis*, 9(2), 121–132. <https://doi.org/10.35590/jeb.v9i2.5555>
- Pramuditya, S. A. (2016). Perbandingan metode binomial dan metode Black-Scholes dalam penentuan harga opsi. *Jurnal Sainsmat*, 5(1), 1–6. <https://doi.org/10.35580/sainsmat5130432016>
- Priyono, A., Nugroho, D. B., & Susanto, B. (2020). Pemodelan volatilitas return indeks saham menggunakan model GARCH(1,1) berdistribusi skew-normal. *PRISMA, Prosiding Seminar Nasional Matematika*, 3, 46–51. <https://journal.unnes.ac.id/sju/index.php/prisma/article/view/37769>

- Raneo, A. P., & Muthia, F. (2018). Penerapan model GARCH dalam peramalan volatilitas di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Manajemen dan Bisnis Sriwijaya*, 15(3), 194–202.
- Saria, L. K., Achsani, N. A., & Sartono, B. (2017). Pemodelan volatilitas return saham: Studi kasus pasar saham Asia. *Jurnal Ekonomi dan Pembangunan Indonesia*, 18(1), 35–52.
- Siswanto, H., Purnomo, K. D., & Kusbudiono. (2014). Penentuan harga opsi pada model Black-Scholes menggunakan metode beda hingga Dufort-Frankel. *Prosiding Seminar Nasional Matematika*, Universitas Jember, 329–335.
- Situmorang, A. M., Adinata, M. D., Adrell, L. R., Ramadhani, M. A. P., Noviyanti, L., & Widhastika, E. H. (2024). Penentuan harga opsi put Amerika dengan metode trinomial Kamrad Ritchken harga saham penutupan BBKA. *BIAStatistics: Journal of Statistics Theory and Applications*, Edisi Khusus: SNSA 3, 168–179.
- Sulastri, S., Novieyanti, L., & Sukono. (2019). Penentuan harga opsi barrier menggunakan metode *Trinomial Kamrad-Ritchken* dengan volatilitas model GARCH. *Jurnal Ilmu Manajemen dan Bisnis*, 10(1), 83–91.
- Syazali, M., Novia, Y. N., & Wahyuningsih, S. (2015). Penentuan harga opsi saham tipe Amerika dengan model binomial (Studi kasus: PT Rio Tinto Plc). *Jurnal Eksponensial*, 6(2), 121–126.
- Widyaningrum, M., & Safaatullah, M. F. (2020). Penentuan harga opsi jual menggunakan metode elemen hingga di Bursa Efek Indonesia. *UNNES Journal of Mathematics*, 9(1), 58–68. <https://doi.org/10.15294/ujm.v9i1.33900>
- Zubedi, F., Achmad, N., Mahmud, S. L., & Mowuu, R. (2022). Penentuan harga beli opsi Asia menggunakan Monte Carlo-Antithetic Variate dan Monte Carlo-Control. *EULER: Jurnal Ilmiah Matematika, Sains dan Teknologi*, 10(1), 7–14. <https://doi.org/10.34312/euler.v10i1.12055>