

DAFTAR PUSTAKA

- Anggraeni, W., & Suyahya, I. Prediksi Kurs Rupiah Terhadap Dolar Amerika Menggunakan Metode *Fuzzy Time Series Chen* dan HSU. *Jurnal String*, 1(1).
- Amelia, N. (2017). Pemodelan Volatilitas Menggunakan Metode EGARCH pada Jakarta Islamik Index. *Jurnal Humaniora Teknologi*, 3:33-39.
- Are, G. B., & Sitorus, S. H. (2020). Prediksi Nilai Tukar Mata Uang Rupiah Terhadap Dolar Amerika Menggunakan Metode *Hidden Markov Model*. *Jurnal Komputer dan Aplikasi*, 8:44-54.
- Bank Indonesia. Data Nilai Kurs Dolar. 2019-2022. <https://www.bi.go.id>. [27 Juni 2022].
- Bollerslev, T., Chao, R., & Kroner, K. (1992). *Arch Modelling in Exchange Rates: A Multivariate Generalized ARCH Model*, 72:498-504.
- Chitkasame, T., & Tansuchat, R. (2019). *An Analysis of Contagion Effect on ASEAN Stock Market Using Multivariate Markov Switching DCC GARCH*. *Thai Journal of Mathematics*, 135-152.
- Damayanti, E. N., & Kuswanto, H. (2019). Analisis Risiko Pada Return Saham Perusahaan Asuransi Menggunakan Metode VAR dengan Pendekatan ARMA-GARCH. *Jurnal Matematika Statistika dan Komputasi*, 16:40-50.
- Desvina, A. P., & Meijer, I. O. (2018). Penerapan ARCH/GARCH Untuk Peramalan Nilai Tukar Petani. *Jurnal Sains Matematika dan Statistika*, 4:2460-4542.
- Enders, W. (2008). *Applied Econometric Time Series*. John Wiley and Sons.
- Engle, R. (2002). *Dynamic Conditional Correlation: A Simple Class of Multivariate Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity Model*. *Journal of Business & Economic Statistics*.
- Famy, R., & Efriyenti, D. (2020). Pengaruh Inflasi, Tingkat Suku Bunga dan Kurs Terhadap Harga Saham di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Akuntansi Bareleng*.
- Firdaus, M., Holic, H., Amalias, S., Fazri, M., & Sangadji, M. (2018). Dampak Pergerakan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Aktivitas Ekspor dan Impor Nasional.

- Frassminggi, K. (2014). Analisis dan Evaluasi Kritis Sistem Moneter Internasional. *Jurnal UNAIR*, 8:233-254.
- Gujarati, D. (2004). *Basic Econometrics, Fourth Edition*. New York: The McGraw-Hill Companies.
- Hartati, & Saluza, I. (2017). Aplikasi GARCH Dalam Mengatasi Volatilitas Pada Data Keuangan. *Jurnal Matematika*, 7:107-118.
- Maulana, H. A. (2018). Pemodelan Deret Waktu dan Peramalan Curah Hujan Pada Dua Belas Stasiun di Bogor. *Jurnal Matematika Statistika dan Komputasi*, 15:50-63.
- Orskaug, E. (2009). *Multivariate DCC-GARCH Model*. Oslo: Norwegia University of Science and Technology Departement of Mathematical Sciences.
- Quadratullah. (2013). Perbandingan Berbagai Model *Conditional Heteroscedastic Time Series* dalam Analisis Risiko Investasi Saham Syariah dengan Metode Value at Risk. *Jurnal Faurier*, 1:1-9.
- Rasiyanti, A. D., & Suyeno. (2022). Analisis SWOT Kebijakan *Local Currency Settlement* Indonesia-China. *Jurnal Aplikasi Administrasi*.
- Rosadi, D. 2012. *Ekonometrika & Analisis Runtun Waktu Terapan dengan Eviews*. Yogyakarta: Andi Offset
- Salwa, N. (2018). Peramalan Harga Bitcoin Menggunakan Metode ARIMA. *Jurnal Statistika*, 1:21-31.
- Setyawan, E. B., Sari, N. N., & Muttaqin, P. S. (2020). Prediksi Volatilitas Harga Jual Produk Pada *E-Commerce* untuk *Independent Stokastik Data* Menggunakan Simulasi *Monte Carlo*. *Jurnal Management System & Industrial Engineering*, 3.
- Sirait, D. E. (2018). Analisis Data Return Saham Menggunakan Model *Dynamic Conditional Correlation -Generalized Autoregressive Heteroscedastic (DCC-GARCH) (1,1)*. Universitas Lampung Jurusan Matematika Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam, Bandar Lampung (Skripsi).
- Sudjionom, A. (2008). *Pengantar Statistik Pendidikan*. Jakarta: PT Raja Grafindo Persada.
- Sufianti, E. (2011). Model Garch-M untuk Estimasi VAR Data Harga Saham. Universitas Islam Negeri Maulana Malik Ibrahim, Fakultas Matematika dan Ilmu pengetahuan Alam, Malang, (Skripsi).
- Sugiyono. (2013). *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif dan R&D*. Bandung: Alfabeta.

- Tsay, R. (2005). *Analysis of Financial Time Series, Second Edition*. Canada: John Wiley & Sons, Inc.
- Tunang, Y., Manurung, T., & Nainggolan, N. (2019). Penerapan Model *Vector Autoregressive* (VAR) Untuk Memprediksi Harga Cengkeh, Kopra dan Pala di Sulawesi Utara. *Jurnal Matematika dan Aplikasi*, 8:100-107.
- Wei, W. W. (2006). *Time Series Analysis Univariate and Multivariate Methods Second Edition*. New York: Addison-Wesley Publishing Co.
- Wibowo, N. M., Sugito, & Rusgiyono, A. (2016). Pemodelan Return Saham Perbankan Menggunakan *Exponential Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity* (EGARCH). *Jurnal Gaussian*, 6:91-99.
- Widarjono, A. *Ekonometrika: Pengantar dan Aplikasinya Disertai Panduan Eviews*. Yogyakarta: UPP STIM YKPM.
- Wijoyo, N. A. (2006). Peramalan Nilai Tukar Rupiah Terhadap USD dengan Menggunakan Model GARCH. *Jurnal Ekonomi dan Keuangan*, 20.
- Wikayanti, N. L., Aini, Q., & Fitriyani, N. (2020). Pengaruh Kurs Dolar Amerika Serikat, Inflasi, dan Tingkat Suku Bunga Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan dengan Model *Vector Error Correction*. *Jurnal Eigen Mathematics*, 3.
- Yohana, C., & Dewi, A. S. (2020). Analisis Hubungan Antara Kurs Dolar Amerika dan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Dengan Menggunakan *Volatility Spillover*. *Jurnal Mitra Manajemen*, 4:51-64.