

DAFTAR PUSTAKA

- A. Hakim.(2014). Pengantar Ekonometrika dengan Aplikasi EViews. Yogyakarta : Penerbit EKONISIA.
- A. R. Tagliafichi.(2003). The estimation of Market VaR using Garch models and a heavy tail distributions. 13th AFIR Colloq. 2003. p. 28.
- A. Widarjono.(2017). *Ekonometrika Pengantar dan Aplikasinya disertai panduan Eviews*. Yogyakarta: UPP STIM YKPN.
- Andriana. S.. Wana. D.. & Widodo. A. (2021). Determinan Volatilitas Harga Saham (Studi Pada Perusahaan Yang Terdaftar Pada Lq45). Jurnal Simposium Nasional Akuntansi Vokasi. 9. 78.
- Ariefianto. M.D. (2012). Ekonometrika Esensi dan Aplikasi dengan Menggunakan Eviews. Jakarta: Erlangga.
- Aswi. S. (2006). Analisis Deret Waktu Teori dan Aplikasi. Makassar: Andira Publisher.
- Bhuntar. C. P. .. Indah. M. W.. & Indrawat. N. (2023). Pengaruh Volume Perdagangan Saham. Volatilitas Saham dan Kapitalisasi Pasar Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Perdagangan Besar Yang Terdapat di Bursa Efek Indonesia Periode 2016-2020. Jurnal Penelitian Ekonomi Manajemen Dan Bisnis (JEKOMBIS). 2(1). 187
- Bolanle. A. D.. & Oluwadare. A. (2017). ARIMA And ARIMAX Stochastic Models For Fertility In Nigeria. International Journal of Mathematics and. Vol. 7. Issue 5. 1-20.
- Bollerslev. (1986). Generalize Autoregressive Conditional Heteroskedasticity. Journal of Econometric. 307-327.
- Box. G. E.. & Cox. D. R. (1964). An Analysis of Transformations. Journal of the Royal Statistical Society. Vol. 26. No. 2. pp.211-252.
- D. N. Gujarati.(2006). *Dasar Dasar Ekonometrika Edisi Ketiga*. Jakarta: Erlangga.
- Engle. R. F. (1982). Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimation of the Variance of United Kingdom Inflation. Econometrica. Vol. 50. 987-1008.
- Faustina R.S., Agoestanto A., & Hendikawati P. (2017). Model Hybrid ARIMAGARCH untuk Estimasi Volatilitas Harga Emas Menggunakan Software R. Unnes Journal of Mathematics, 6(1), 11-24
- Gujarati, D. N. (2003). Basic Econometrics Fourth Edition. New York: Mc Graw Hill.
- H. Winata dan Y. D. Hapsari.(2017) Penggunaan Metode Threshold GARCH dalam Memprediksi Harga Saham PT. Gudang Garam. Tbk. *J. Optim.* vol. 7. no. 1. pp. 59–70.
- Hamjah. M. A.. & Chowdhury. A. K. (2014). Measuring Climatic and Hydrological Effects on Cash Crop Production and Production Forecasting in Bangladesh Using ARIMAX Model. Mathematical Theory and Modeling. Vol.4. No.6.
- J. D. Cryer dan K.-S. Chan.(2008). *Time series Analysis with Application with R*. Second Edi. New York: Springer Science+Business. LLC.
- J. M. Zakoian. (1994). Threshold heteroskedasticity models," Journal of Economic Dynamics and Control, vol. 18, no. 5, pp. 931-955.
- Makridakis. S. G.. Wheelwright. S. C.. & Hyndman. R. J. (1998). Forecasting: Methods and Applications. 3rd Edition. New York: John Wiley & Sons.
- Montgomery. D. C. (2001). Design and Analysis of Experiments. Fifth Edition. New York: John Wiley & Sons. Inc

- M. Y. W. a. A. M. Yanne Irene.(2020). Perbandingan Metode APARCH, EGARCH dan TGARCH untuk Prakiraan Harga Emas Dunia, InPrime, vol. 2, no. 2, pp. 71-78.
- Neter, J., Wasserman, W., and Kutner, M. H. (1990). Applied linear statistical models, Illinois: Irwin.
- R. S. Tsay.(2005). *Analysis of Financial Time series*. Second Edi. Canada: A John Wiley and Sons. INC Publication.
- R. S. Tsay. (2010). *Analysis of Financial Time Series Third Edition*. New York:John Wiley & Sons. Inc.
- Rosadi. Dedi. (2012). Ekonometri dan Analisis Runtun Waktu Terapan dengan Eviews. Yogyakarta :C.V Andi Offset
- Rukini. & Suhartono. (2013). Model ARIMAX dan Deteksi GARCH untuk Peramalan Inflasi Kota Denpasar. Prosiding.
- Suryani. A. R.. Sugiman. & Hendikawati. P. (2018). Peramalan Curah Hujan dengan Metode Autoregressive Integrated Moving Average with Exogenous Input (ARIMAX). UNNES Journal of Mathematics.
- W. Enders.(1995). *Applied Econometric Time series*. Fourth Edi. New York: John Wiley and Sons. INC.
- Wei. William W.S. (2006). *Time series Analysis Univariate and Multivariate Methods*. Pearson: New York.
- Winarno. W.W. (2011). Analisis Ekonometrika dan Statistik dengan Eviews. UPPT STIM YKPN:Yogyakarta.