

DAFTAR PUSTAKA

- [1] A. W. d. N. F. Yuyun Naelufar, “Faktor yang mempengaruhi harga saham pada perusahaan manufaktur sub sektor otomotif,” *Fakultas Ekonomi, Universitas Islam Batik Surakarta*, vol. 22, no. 01, pp. 296–303, 2021.
- [2] D. F. H. dan Edi Wibowo, “Pengaruh harga saham, return saham, dan pelatihan pasar modal terhadap minat investasi,” *Lokawati: Jurnal Penelitian Manajemen dan Inovasi Riset*, vol. 2, no. 5, pp. 280–292, 2024.
- [3] A. d. A. Mie, “Analisis pengaruh indeks harga saham gabungan asing terhadap indeks harga saham gabungan indonesia,” *Jurnal Wira Ekonomi Mikroskil*, vol. 4, no. 2, pp. 123–132, 2014.
- [4] Mulyono, “Analisa korelasi return indeks-indeks saham terhadap indeks harga saham gabungan pada bursa efek indonesia,” *Management Department, School of Business Management, BINUS University*, vol. 6, no. 2, pp. 330–339, 2015.
- [5] H. R. T. dan Stefie Fiorella Sinaga dan Kurnya Suparto Saragi dan Rikho Givson Artono dan Roy Alfonso Efrain Sinaga dan Christnova Hasugian dan Hamonangan Siallagan, “Pengaruh suku bunga terhadap harga saham bank bca di bei tahun 2023,” *Islamic Economics and Business Journal*, vol. 9, no. 1, 2025.

- [6] E. H. d. G. S. U. Vina C. Nugroho, “Faktor yang mempengaruhi volume transaksi pada harga saham pt. bank central asia tbk.” *Jurnal Manajemen Terapan dan Keuangan (Mankeu)*, vol. 10, no. 01, 2021.
- [7] N. Nurrahmawati, B. Sartono, and S. Wahyudi, “The effect of return on asset, return on equity, and earnings per share on stock return (study of banking companies listed on the indonesia stock exchange in 2014–2017),” *International Journal of Economics and Financial Issues*, vol. 9, no. 3, pp. 113–118, 2019.
- [8] D. N. Gujarati and D. C. Porter, *Basic Econometrics 5th Edition*. Boston: McGra-Hill Irwin, 2009, 922 pp., ISBN: 978-0-07337577-9.
- [9] I. D. d. M. R. F. P. Hariyati H. Usman, “Pendekatan model vector autoregressive (var) untuk meramalkan faktor-faktor yang mempengaruhi inflasi di provinsi gorontalo,” *Jurnal Ilmiah MEA (Manajemen, Ekonomi, dan Akuntansi)*, vol. 1, no. 1, 2020.
- [10] A. H. W. d. A. D. Dewi Retno Sari Saputro, “Model vector autoregressive untuk peramalaan curah hujan di indramayu (vector autoregressive model for forecast rainfall in indramayu),” *Jurnal Forum Statistika dan Komputasi*, vol. 16, no. 2, pp. 7–11, 2011.
- [11] T. M. d. N. N. Yulin Tunang, “Penerapan model vector autoregressive (var) untuk memprediksi harga cengkeh, kopra, dan pala di sulawesi utara,” *Jurnal Jurusan Matematika-Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam*, vol. 8, no. 2, pp. 100–107, 2019.

- [12] D. I. d. T. W. U. Alan Prahutama, Suparti, “Pemodelan sektor-sektor inflasi di indonesia menggunakan vector autoregressive (var),” *Jurnal ILMU DASAR*, vol. 20, no. 1, pp. 47–52, 2019.
- [13] W. Zucchini and I. L. MacDonald, *Hidden Markov Models for Time Series: An Introduction Using R*. Springer, 2009.
- [14] B. W. d. S. Hayuk Permatasari, “Pemodelan markov switching vector autoregressive (msvar),” *Jurnal Gaussian*, vol. 3, no. 3, pp. 421–430, 2014.
- [15] E. W. Okereke and O. R. Uwaeme, “Markov switching vector autoregressive modelling of the nigerian stock price and oil price series,” *University of Port Hartcourt, Nigeria*, vol. 1, no. 2, 2018.
- [16] B. Tannadi, *Pengenalan Saham*. Elex Media Komputindo, 2020.
- [17] S. H. dan Erwin Dyah Astawinetu, *Teori Portofolio dan Pasar Modal Indonesia*. Surabaya: Scopindo Media Pustaka, 2020.
- [18] S. Zuliarni, “Pengaruh kinerja keuangan terhadap harga saham terhadap perusahaan mining and mining service di bursa efek indonesia (bei),” *Jurnal Aplikasi Bisnis*, vol. 3, no. 1, pp. 36–48, 2012.
- [19] S. Widoatmodjo, *Cara Sehat Investasi di Pasar Modal*. Jakarta: PT Jurnalindo Aksara Grafika, 2012.
- [20] F. N. Erawati, “Analisis harga saham, return saham dan likuiditas saham sebelum dan sesudah akuisisi pada pt. semen indonesia,” vol. 4, pp. 356–361, 2022.

- [21] B. C. P. dan Ari Darmawan, “Pengaruh nilai tukar usd dan bursa asean terhadap indeks harga saham gabungan (ihsg) (studi pada bursa efek indonesia periode 2014-2016),” *Jurnal Administrasi Bisnis*, vol. 60, no. 1, 2018.
- [22] M. Samsul, *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Penerbit Erlangga, 2019.
- [23] P. J. Brockwell and R. A. Davis, *Introduction to Time Series and Forecasting*. New York: Springer, 2002.
- [24] S. K. d. T. A. Ilma Sri Yulianti, Khoirul Umam, “Analisis univariate time series dan stasioneritas data,” 2023.
- [25] J. R. dan Syahrul Akbar, “Perbandingan uji stasioner data time series antara metode: Control chart, correlogram, akar unit dickey fuller, dan derajat integrasi,” *Jurnal Gradien*, vol. 11, pp. 1040–1046, 2015.
- [26] W. W. Wei, *Multivariate Time Series Analysis and Applications*. New York: Wiley, 2019.
- [27] G. E. P. Box, G. M. Jenkins, G. C. Reinsel, and G. M. Ljung, *Time Series Analysis: Forecasting and Control*, 5th ed. Hoboken, NJ: John Wiley & Sons, 2015.
- [28] M. Ekananda, *Analisis Data Time Series*. Jakarta: Mitra Wacana Media, 2014.

- [29] F. R. Wilujeng, “Metode transformasi box cox pada model regresi berganda untuk mengetahui faktor yang berpengaruh pada produktivitas penangkapan ikan laut,” *Jurnal Muara Sains, Teknologi, Kedokteran, dan Ilmu Kesehatan*, vol. 2, no. 1, pp. 166–175, 2018.
- [30] A. M. dan S.S.U. Brodjol, “Peramalan temperatur udara di kota surabaya dengan menggunakan arima dan artificial neural network,” *Jurusan Statistika FMIPA ITS*, vol. 1, no. 1, pp. 118–123, 2012.
- [31] R. H. Shumway and D. S. Stoffer, *Time Series Analysis and Its Applications : With R Examples*, 3rd ed. New York: Springer, 2011.
- [32] H. Anton, *Elementary Linear Algebra*. Wiley, 1988.
- [33] J. D. Hamilton, *A New Approach To The Economic Analysis Of Nonstationary Time Series and The Business Cycle*. Econometrica, 1989.
- [34] E. Zivot and J. Wang, *Modelling Financial Time Series With S-PLUS, Second Edition*. New York: Springer-Verlag, 2006.
- [35] H. M. Krolzig, *Markov Switching Vector Autoregressive : Modelling, Statistical Inference, and Application to Bussiness Cycle Analysis*. Berlin: Springer, 1997.