

DAFTAR PUSTAKA

- Abidin, M. (2015). Dampak Kebijakan Impor dan Ketahanan Pangan dalam Perspektif Kesejahteraan Sosial. *Sosio Informa*, 213-230.
- Ariefianto, M., & Doddy. (2012). *Ekonometrika Esensi dan Aplikasi dengan Menggunakan EViews*. Jakarta: Erlangga.
- Arifin, B. (2000). *Spektrum Kebijakan Pertanian Indonesia : Telaah Struktur, kasus dan alternatif strategi*. Jakarta: Erlangga.
- Bappenas. (2010). *Rencana Pembangunan Jangka Menengah (RPJHMN) 2010-2014 (Peraturan Pemerintah Nomor 5 Tahun 2010)*. Jakarta: Badan Perencanaan Pembangunan Nasional.
- Ederington, L. H., & Guan, W. (2010). How Asymmetric is us stock market volatility? *Journal of Financial Markets*, 13(2):225-248.
- Enders, W. (1995). *Applied Econometric Time Series*. Jhon Wiley & Sons, Inc: Canada.
- Enders, W. (2004). *Applied Econometric Time Series*. John Wiley & Son, Inc. New York.
- Engle, R. (2001). The Use of ARCH/GARCH Models in Applied Econometrics. *Journal of Economics Perspectives*, 4, 157-168.
- Ermawati, Nurzarina, & Nurfadila, K. (2018). Pemodelan Beban Puncak Energi Listrik Menggunakan Model GJR-GARCH. *Jurnal MSA Vol.6 No.1*.
- Fardhani, A. A., Simanjuntak, D. I., & Wanto, A. (2018). Prediksi Harga Eceran Beras Di Pasar Tradisional Di 33 Kota Di Indonesia Menggunakan Algoritma Backpropagation. *Jurnal Infomedia*.
- Glosten, L. R., Jagannathan, R., & Runkle, D. E. (1993). On the relation between the expected value and the volatility of the nominal excess return on stocks. *The Journal of Finance*, 48(5):1779-1801.
- Gujarati, D. (2003). *Basic Econometric, 4th Edition*. New York:USA: McGraw-Hill.
- Hanke, J., & Wichers, D. (2005). *Business Forecasting Eight Edition*. New Jersey: Pearson Prentice hall.
- Harianto. (2001). Pendapatan, Harga dan Konsumsi Beras. Dalam A. Suryana, & S. Mardianto, *Dalam Bunga Rampai Ekonomi Beras* (hal. 103-110). Jakarta: Lembaga Penyelidikan Ekonomi dan Masyarakat, Fakultas Ekonomi, Universitas Indonesia.
- Haryati, Y., & Hendrati, I. M. (2010). Ekonomi Perbesaran: Keterkaitan Pasar Beras Dunia Dengan Pasar Indonesia. *Jurnal Mitra Ekonomi dan Manajemen Bisnis Vol. 1, No. 2*, 194-201.

Hestiningtyas, R., & Sulandari, W. (2009). Pemodelan TARCH pada Nilai Tukar Kurs Euro Terhadap Rupiah. *Prosiding Seminar Nasional Matematika dan Pendidikan Matematika. 5 Desember 2009. ISBN:978-979-16353-3-2.*

<https://hargapangan.id> diakses pada tanggal (21 Februari).

<https://jateng.bps.go.id> diakses pada tanggal (10 Februari).

Ikhsan, M. (2001). Kemiskinan dan Harga Beras . Dalam A. Suryana, & S. Mardianto, *Dalam Bunga Rampai Ekonomi Beras* (hal. 173-210). Indonesia: Lembaga Penyelidikan Ekonomi dan Masyarakat, Fakultas Ekonomi, Universitas Indonesia.

Iswara, A. Y., Putri, A., & Murni, D. (2017). Value-at-Risk Pada Satu Aset Saham dan Portofolio Berbasis Model Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity dan Glosten-Jaganathan-Runkle Heavy Tail dan Copula. *e-Proceeding of Engineering*, Vol.4, No.2 Page 3045-3052.

Larasati, E. N., Hendikawati, P., & Zaenuri. (2016). Analisis Volatility Forecasting Sembilan Bahan Pokok Menggunakan Metode GARCH dengan Program R. *UNNES Journal of Mathematics*, 90-99.

Lestari, N., & Wahyuningsih, N. (2012). Peramalan Kunjungan Wisata dengan Pendekatan Model SARIMA. *Jurnal Sains dan Seni ITS*, Vol.1, No. 1, Hal A-29-A-33.

Lo, M. (2003). *Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedastic Time Series Model*. Thesis Department of Statistics and Actuarial Science. Simon Fraser University.

Makridakis. (1995). *Metode dan Aplikasi Peramalan*. Jakarta: Erlangga.

Muljawan, R. E., & Alibaba, R. B. (2009). Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi Harga Beras Di Jawa Timur. *Buana Sains*, Vol 9 No 2: 111-118.

Mulyana. (2004). *Buku Ajar Analisis Data Deret Waktu*. Bandung: FMIPA Universitas Padjajaran.

Murwaningsari, E. (2008). Pengaruh Volume Perdagangan Saham, Deposito dan Kurs Terhadap IHSG Beserta Prediksi IHSG (Model GARCH dan ARIMA). *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia*, Vol. 23, No. 2, hal 178-195.

Nastiti, K. L., & Suharsono, A. (2012). Analisis Volatilitas Saham Perusahaan Go Public dengan Metode ARCH-GARCH. *Jurnal Sains dan ITS*, Vol.1, No.1, hal D-259-D-264.

Nurzarina. (2018). *Analisis Perkiraan Beban Puncak Energi Listrik Menggunakan Model GJR-GARCH*. Skripsi. Makassar: Jurusan Matematika Fakultas Sains dan Teknologi Universitas Islam Negeri Alauddin.

Priyono, A. F. (2012). Efek Asimetris dalam Volatilitas Return Indeks LQ45: Pendekatan GJR-GARCH. *Journal Manajemen*, Vol. 12, No. 2 : 132.

- Rizal, J., & Akbar, S. (2015). Perbandingan Uji Stasioner Data Timeseries Antara Metode : Control Chart, Correlogram, Akar Unit Dickey Fuller, dan Derajat Integrasi. *Jurnal Gradien*, Vol.11 No. 1 Hal 1040-1046.
- Samsiah, D. N. (2008). Analisis Data Runtun Waktu menggunakan Model ARIMA (p,d,q). *Skripsi UIN Sunan Kalijaga*.
- Santoso. (2011). Aplikasi Model GARCH pada Data Inflasi Bahan Makanan Indonesia. *Aset*, 65-76.
- Santoso, T. (2011). Aplikasi Model GARCH pada Data Inflasi Bahan Makanan Indonesia. *Aset*, Vol. 13 No. 1 hal. 65-76.
- Sembiring, R. (2003). *Analisis Regresi, Edisi kedua*. Bandung: ITB.
- Sugema, I. (2006). *Inflasi, Kemiskinan dan Beras*. Kompas.
- Sukiyono, K., & Rosdiana. (2018). Pendugaan Model Peramalan Harga Beras Pada Tingkat Grosir. *AGRISEP*, 23-30.
- Suryana, A., & dkk. (2014). Harga Gabah Dan Beras Dalam Mendukung Ketahanan Pangan Nasional. *Pengembangan Inovasi Pertanian*, 7(4):155-168.
- Ulinnuha, N., & Farida, Y. (2018). Prediksi Cuaca Kota Surabaya Menggunakan Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) Box Jenkins dan Kalman Filter. *Jurnal Matematika "MANTIK"*, Vol. 04 No. 01 Hal 59-67.
- Untari, M., & Saefuddin. (2009). Analisis Deret Waktu dengan Ragam Galat Heterogen dan Asimetrik. *Forum Statistika dan Komputasi*, (14): 22-23.
- Wei, W. (2006). *Time Series Analysis Univariate and Multivariate Methods*. Temple University. USA.
- Widarjono, A. (2002). Aplikasi Model ARCH Kasus Tingkat Inflasi di Indonesia. *Jurnal Ekonomi Pembangunan*.
- Widarjono, A. (2007). *Ekonometrika:Teori dan Aplikasi*. Ekonisia.
- Winarno, W. (2007). *Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan Eviews*. Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan Sekolah Tinggi Ilmu Manajemen YKPN.