

## DAFTAR PUSTAKA

- Ariyani, F. D., Warsito, B., dan Yasin, H. 2014. Pemodelan Markov Switching Autoregressive, *Jurnal Gaussian* 3: 381-390.
- Asyariahnsyah, A. R., Iriawan, N. dan Mukarromah, A. 2020. Pemodelan Harga Cryptocurrency Menggunakan Markov Switching Autoregressive, *Inferensi* 3:81-88.
- Angela, Millania. 2021. Aplikasi Metode Markov Switching Autoregressive dalam Memodelkan Nilai Indeks Harga Saham Gabungan Indonesia. *Skripsi*. Universitas Pelita Harapan: Tangerang.
- Bartolomius, Shantika Martha dan Siti Aprizkiyandari. 2021. Pemodelan Markov Switching Autoregressive (MSAR) pada Data Inflasi di Indonesia. *Buletin Ilmiah Math. Stat dan Terapannya (Bimaster)* Volume 10, 4:495-504.
- Chen, M.Y. 2013. *Time series analysis: Conditional volatility models*. Department of Finance, National Chung Hsing University.
- Choirunnisak, 2019. Saham Syariah, Teori dan implementasi. *Islamic Banking* Vol.4 No.2.
- Chung-Ming Kuan. 2002. *Lecture On The Markov Switching Model*. Institute of Economics Academia Sinica.
- Cox, D.R., and Miller, C.R. 1965. *The Theory of Stochastic Process*. Chapman and Hall: London.
- Jarque, C. M., and Berra, 1980. Efficient Test for Nomality, Homoskedasticity, and Serial Independence of Regression Residuals. *Economic Letters*. 6: 255-259
- J. D. Hamilton, 1996. Specification Testing in Markov-Switching Time Series Model. *Journal of econometrics* Vol 70: 127-157.
- J. D. Hamilton, 1994. *Time Series Analysis*. Princeton University Press: New Jersey.
- J. D. Hamilton, 1989. A new approach to the economic analysis of nonstationary time series and the business cycle. *Journal of econometrics* 57:357–384.
- Kurniasari, Desy. 2014. Model Markov Switching Autoregressive (Msar) dan Aplikasinya pada Nilai Tukar Rupiah terhadap Yen. *Skripsi*. Universitas Sebelas Maret Surakarta: Surakarta.
- Makridakis, S, Wheelwright dan McGee. 1999. *Metode dan Aplikasi Peramalan Edisi Kedua*. Jakarta: Airlangga.

- Manullang, S. 2018. Analisis Runtun Waktu Menggunakan Model Markov. *Jurnal Generasi Kampus* 11:109-111.
- Munawwaroh, Nur Alifatul. 2020. Penerapan Model Markov Switching Autoregressive pada Data Inflasi (Indeks Harga Konsumen). *Skripsi*. Jurusan Matematika, Fakultas Sains Dan Teknologi, Universitas Islam Negeri Maulana Malik Ibrahim: Malang.
- Muthahharah, Isma. 2019. Peramalan Indeks Saham Syariah Indonesia menggunakan Autoregressive Integrated Moving Avarage (ARIMA). *Jurnal Matematika dan Statistika serta Aplikasinya* Vol 7 No.2.
- Prasyanti, A., Mustofa Usman., dan Dorah Aziz. 2017. Pemodelan Markov Switching Autoregressive (MSAR) Pada Data Time Series. *Prosiding Seminar Nasional Metode Kuantitatif*. ISBN No. 978-602-98559-3-7.
- Ruslaela, Elsa. 2019. Pemodelan Markov Switching Autoregressive (MSAR) pada Pravelensi Penyakit Diabetes Melitus di Kota Bandung. *Skripsi*. Universitas Padjajaran: Bandung.
- Syarief Fadholi, Achmad, Deni Saepudin dan Aniq Atiqi Rohmawati. 2017. Value-at risk menggunakan Model Markov Switching Autoregressive (Study Kasus Saham PT. Astra Internasional). *E Proceeding of Engineering* Vol.4, No.3.
- Syauqi Beik, Irfan dan Sri Wulan Fatmawati. 2014. Pengaruh Indeks Harga Saham Syariah Internasional Dan Variabel Makroekonomi terhadap Jakarta Islamic Index. *Al-Iqtishad*: Vol. VI No. 2.
- Taqiyyudin, Teguh Ammar dan Iyen Nugraha Faqih. 2021. Pemodelan Markov Switching Autoregressive (MSAR) Pada Prediksi Curah Hujan (Studi Kasus Curah Hujan Provinsi Riau Tahun 2007-2021). *Seminar Nasional Statistika Online (SNSO 2021)*. ISSN Online 2599-2546, ISSN Cetak 2087-2590.
- Undang-Undang Republik Indonesia Nomor 8 Tahun 1995. *Tentang Pasar Modal*. Jakarta
- Wei, Willian W. S. 2006. *Time Series Analysis Univariate and Multivariate Methods (2<sup>nd</sup> ed)*. Pearson: New York.
- Wizza, U. A., Devianto, D. dan Maiyastri. 2016. Model Laju Perubahan Nilai Tukar Rupiah (IDR) Terhadap Poundsterling (GBP) Dengan Metode Markov Switching Autoregressive (MSAR). *Jurnal Matematika Unand* 5:56–64.
- Xie, Y dan Ranney. 2007. A General Autoregressive Model with Markov Switching: Estimation and Consistency. *Research Report Centre of Biostochastics* ISSN.1651-8543:1-19.
- Yurinanda, Sherly dan Darvi Mailisa Putri. 2021. Pemodelan Laju Perubahan Nilai Tukar Rupiah (IDR) terhadap Dolar Amerika (USD) dengan Metode Markov Switching Autoregressive (MSAR). *Journal of Science and Technology* 1:1.