

DAFTAR PUSTAKA

- Aswi & Sukarna. (2006). *Analisis Deret Waktu: Teori dan Aplikasi*. Makassar: Andira Publisher.
- Badan Ekonomi Indonesia (BEI). (2010). *Buku Panduan Indeks Harga Saham Bursa Efek Indonesia*. Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Boediono. (2018). *Ekonomi Moneter*. Yogyakarta: BPFE.
- Engle, R. F., & Granger, C. W. J. (1987). Cointegration and error correction: Representation, estimation, and testing. *Econometrica*, 55(2), 251–276.
- Gujarati, D. N., & Porter, D. C. (2009). *Basic Econometrics* (5th ed.). New York: McGraw-Hill.
- Hadiyatullah. (2011). Model Vector Autoregressive (VAR) dan penerapannya untuk analisis pengaruh harga migas terhadap Indeks Harga Konsumen (IHK). *Jurnal Statistika*.
- Hendayanti, N., & Nurhidayati. (2018). Analisis hubungan inflasi, kurs dan IHSG menggunakan pendekatan VECM. *Jurnal Ekonomi Pembangunan*.
- Heizer, J., & Render, B. (2009). *Operations Management* (10th ed.). New Jersey: Pearson Education.
- Johansen, S., & Juselius, K. (1990). Maximum likelihood estimation and inference on cointegration with applications to the demand for money. *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, 52, 169–210.
- Jogiyanto. (2017). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFE.
- Lütkepohl, H. (2005). *New Introduction to Multiple Time Series Analysis*. Berlin: Springer-Verlag.
- Makridakis, S., Wheelwright, S. C., & Hyndman, R. J. (1999). *Forecasting: Methods and Applications* (3rd ed.). New York: John Wiley & Sons.
- Mishkin, F. S. (2019). *The Economics of Money, Banking, and Financial Markets* (12th ed.). Boston: Pearson.
- Nopirin. (2013). *Ekonomi Moneter*. Yogyakarta: BPFE.
- Pindyck, R. S., & Rubinfeld, D. L. (1981). *Econometric Models and Economic Forecasts*. New York: McGraw-Hill.

- Ramadhan. (2009). Analisis hubungan harga antar kelompok komoditas pembentuk inflasi di Sumatera Barat menggunakan pendekatan VECM. *Jurnal Ekonomi Daerah*.
- Respati, R. (2006). Analisis peramalan menggunakan model VAR dan VECM pada data ekonomi multivariat. *Jurnal Statistika Indonesia*.
- Subagyo. (1986). *Peramalan Bisnis*. Yogyakarta: BPFE.
- Sukirno, S. (2011). *Makroekonomi Teori Pengantar*. Jakarta: Rajawali Pers.
- Tandelilin, E. (2017). *Pasar Modal: Manajemen Portofolio dan Investasi*. Yogyakarta: Kanisius.
- Walpole, R. E., & Myers, R. H. (1986). *Probability and Statistics for Engineers and Scientists*. New York: Macmillan Publishing Company.
- Wei, W. W. S. (2006). *Time Series Analysis: Univariate and Multivariate Methods* (2nd ed.). Pearson Addison Wesley.
- Yahoo Finance. (2026a). Historical Data Indeks Harga Saham Gabungan (^JKSE). Tersedia: <https://finance.yahoo.com/quote/%5EJKSE/history> (diakses pada 6 Oktober 2025).
- Yahoo Finance. (2026b). Historical Data S&P 500 (^GSPC). Tersedia: <https://finance.yahoo.com/quote/%5EGSPC/history> (diakses pada 6 Oktober 2025).
- Yahoo Finance. (2026c). Historical Data USD/IDR (USDIDR=X). Tersedia: <https://finance.yahoo.com/quote/USDIDR%3DX/history> (diakses pada 6 Oktober 2025).
- Zainun, N. Y. (2003). Evaluasi ketepatan metode peramalan menggunakan MAPE. *Jurnal Teknologi Informasi*.