

DAFTAR PUSTAKA

- Ahsanah, D. N. Jurnal Kajian Ekonomi Hukum Syariah : Emas Sebagai Instrumen Investasi Jangka Panjang. Vol. 8, No. 1, Januari-Juni 2022, Hal. 177-187.
- Alhafiz, Faturahman (2023). Simulasi Model GARCH Menggunakan Program R.
- Amelia, Noor (2015). Pemodelan Volatilitas Menggunakan Metode Constant Conditional Correlation Multivariate GARCH Pada Pasar Modal Indonesia.
- Aristianti S, Waluyo B, & Arman A. (2021) SERAMBI : Jurnal Ekonomi Manajemen dan Bisnis Islam : Pengaruh Fluktuasi Harga Emas, Tingkat Inflasi, dan Non Performing Financing Terhadap Penyaluran Pembiayaan Produk Gadai Emas. Vol 3, No. 1, 2021, 23 – 32.
- Badu, Rhazilun Marsyahid (2021). Pemodelan Harga Saham dengan Pendekatan Model Arch – Garch (Studi Kasus : Harga Saham PT. Telkom).
- Bollerslev, Tim (1986). Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity. Journal of Econometrics 31 (1986) 307-327. North-Holland.
- Brilliantya, Sofalina Nodra (2022). Model EGARCH Dan TGARCH Untuk Mengukur Volatilitas Asimetris Return Saham.
- Box, G E P, Jenkins, G M, Ljung, G M, & Reinsel, G C. (2016). Time Series Analysis Forecasting and Control (Fifth). John Wiley & Sons.
- Burnham, K.P & Anderson. D R (2004). Multimodel Inference Understanding AIC and BIC in Model Selection. Sociological Methods & Research , Vol. 33, No. 2, 2 November 2004, 261-304.
- Chang, Pei-Chan., Wang, Yen Wen., Liu, Chen Hao (2007). The Development of a Weighted Evolving Fuzzy Neural Network for PCB Sales forecasting, Vol. 32, Issue 1, January 2007, Pages 86-96. Dapat diakses melalui laman berikut : <https://doi.org/10.1016/j.eswa.2005.11.021>
- D.Cryer, Jonathan, Chan, K. S . (2008). Time Series Analysis With Applications in R. New York: Springer.
- Engle, R. F. (1982). Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of United Kingdom Inflation. Econometrica, Vol. 50(4), 987–1008.

- Fadila, A.N & Nuswandari, Cahyani (2022) Jurnal Ilmiah Ekonomi dan Bisnis : Apa Saja Faktor –Faktor Yang Mempengaruhi Harga Saham?. Vol 15, No. 2, Desember 2022, pp 283 – 293.
- Faustina, R S, dkk (2017) Jurnal Matematika : Model Hybrid ARIMA-GARCH Untuk Estimasi Volatilitas Harga Emas Menggunakan Software R.
- Ferli, O, dkk (2022) Jurnal Keuangan dan Perbankan : Pengaruh CR, DER dan ROE Terhadap Harga Saham pada Perusahaan Consumer Goods Periode 2018-2021. Vol 19, No. 01, Desember 2022 : 27-36.
- Gustiansyah, MA, dkk (2023) Jurnal Statistika dan Aplikasinya : Aplikasi Model ARIMA dalam Peramalan Data Harga Emas Dunia Tahun 2010 – 2022. Vol 7 No. I, June 2023.
- Hanke, J. E., & Winchen, D. W. (2014). Business forecasting : Ninth Edition. Harlow:Pearson Education Limited
- Haris, M Al dan Arum, P R. (2020). Peramalan Harga Emas Dengan Model Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (GARCH). Jurnal Sains dan Matematika Unpam, Vo. 3, No. 1, 3rd article. 19 – 30.
- Hendri, Derick (2021). Peramalan Harga Saham dengan Model Hybrid ARIMA-GARCH dan Metode Walk Forward.
- Kanal, F A., Manurung, T., & Prang, J D. (2018). Penerapan Model GARCH (Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity) Dalam Menghitung Nilai Beta Saham Indeks Pefindo25. Jurnal Ilmiah Sains, 18(2), 67–74.
- Maharani, Hilda (2019). Analisis Data Deret Waktu yang Saling Berkointegrasi dengan Menggunakan Model ECM (Error Correction Model).
- Maas, Cora J M & Hox, Joop J. (2004). The Influence of Violations of Assumptions on Multilevel Parameter Estimates and Their Standard Errors. Computational Statistics & Data Analysis 46 (2004) 427-440.
- Makridakis, S., Wheelwright, S C, & McGee, V E. (1999). Metode dan Aplikasi Peramalan (H. Suminto (ed); 2nd ed.). Binarupa Aksara.
- Maulia, S D, dkk. (2024). Perbandingan Kinerja Model ARIMA dan GARCH dalam Peramalan Harga Saham Bank BRI. Journal of Mathematics and Its Applications, Vol. 20, No. 1. pp. 65-76.

- Mawarsyah, Andani Niti (2024). Analisis Intervensi dengan Model Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) untuk Peramalan Jumlah Penumpang Kereta Commuter Line Jabodetabek
- Montgomery, D C., Cheryl L Jennings., Murat Kulahci. (2015). Introduction to Time Series Analysis and Forecasting (D. J. Balding, A. C. C. Noel, & G. M. Fitzmaurice, Eds.; 2nd Edition). John Wiley & Sons, Inc., Hoboken, New Jersey.
- Nuryadi., Astuti, T D., Utami, E S., Budiantara M. (2017). Dasar – Dasar Statistik Penelitian.
- Ping, Y P., Miswan, N H., Ahmad, M H., (2013). Applied Mathematical Sciences : Forecasting Malaysian Gold Using GARCH Model, Vol. 7, No. 58.
- Purba, Switany Angnitha. (2020). Estimasi Parameter Data Berdistribusi Normal Menggunakan Maksimum Likelihood Berdasarkan Newton Raphson. Jurnal Sains Dasar 2020 9(1) 16 – 18.
- Rahayu, P I., Famalika, A., Sihombing, P R. (2021). Penerapan Model Vector Autoregressive (Var (2)) Pada Data Inflasi Di Provinsi Jawa Timur Dan Bali. Vol. 1, No. 1, Maret 2021.
- Ristanto, Mohammad Nahrul Fikri. (2022). Peramalan Volatilitas Harga Bawang Merah Indonesia dengan Pendekatan ARCH (Autoregressive Conditional Heteroscedasticity) dan GARCH (Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity) Tahun 2019 – 2021.
- Sagala, Junita Putri & Tarigan, Ernita Dewi (2023) Jurnal Seminar Nasional Teknologi Informasi dan Matematika : Analisis Peramalan Harga Emas Antam Menggunakan ARIMA. Vol 2, No. 1, 2023 : Hal 77 – 84.
- Sanchia, Niksie K. (2020). Implementasi Model ARIMA-GARCH Menggunakan Metode Maximum Likelihood.
- Santoso, Teguh. (2011). Aplikasi Model GARCH pada Data Inflasi Bahan Makanan Indonesia, Vol 13, No. 1, Maret 2011 : Hal 65 - 76.
- Spiegel, M R & Stephens, L J. (1999). Statistika. Alih Bahasa Wiwit Kastawan dan Irzam Harmein. Jakarta:Erlangga.

- Tamara, dkk. (2024). Jurnal Sekuritas : Analisa Pengaruh Kebijakan Moneter dan Makro Ekonomi Terhadap Kinerja Pasar Modal, Vol. 7, No. 3, Mei 2024, Hal. 290-301.
- Verayani, Muslidar (2019). Pengaruh Fluktuasi Harga Emas Dan Strategi Promosi Penjualan Terhadap Minat Beli Emas Pada Bank Syariah Mandiri Banda Aceh.
- Vo, N & Slepaczuk, R. (2022). Applying Hybrid ARIMA-SGARCH in Algorithmic Investment Strategies on S&P500 Index. Entropy, 24(2).
- Wardah, S & Iskandar. (2016). Analisis Peramalan Penjualan Produk Keripik Pisang Kemasan Bungkus Studi Kasus : Home Industry Arwana food Tembilahan. Jurnal Teknik Industri, vol. XI, No. 3.
- Wei, W W S. (2006). Time Series Analysis Univariate and Multivariate Methods (Deirdre Lynch, Ed.; 2nd ed.). Greg Tobin.
- Widiarti, Tara (2018). Faktor – Faktor yang Mempengaruhi Volatilitas Harga Saham pada Perusahaan yang Terdaftar di Indeks LQ 45.
- Yani, Ditha Fitri (2023). Metode ARIMA-GARCH untuk Menyelesaikan Masalah Heteroskedastisitas dalam Peramalan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dolar Amerika Serikat
- Yaziz, S R., dkk. (2013). The Performance of Hybrid ARIMA-GARCH Modeling in Forecasting Gold Price.
- Yuliana, A F & Robiyanto. (2019). Jurnal Ilmiah Bisnis dan Ekonomi Asia : Peran Emas Sebagai Safe Haven Bagi Saham Pertambangan Indonesia pada Periode Pandemi Covid-19.