

DAFTAR PUSTAKA

- Akaike, H. (1973). Maximum Likelihood Identification of Gaussian Autoregressive Moving Average Models. *Biometrika*, 60(2), 255–265.
- Aktivani, S. (2021). Uji Stasioneritas Data Inflasi Kota Padang Periode 2014-2019. *Jurnal Statistika Industri Dan Komputasi*, 6(01), 26–33.
- Annila, N., & Kristanti, F. T. (2015). Model Garch (Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity) untuk Prediksi dan Akurasi Harga Saham Masa Depan. *EProceedings of Management*, 2(1), 255-266.
- Arifin, M., Tarno, T., & Warsito, B. (2017). Pemodelan Return Portofolio Saham menggunakan Metode Garch Asimetris. *Jurnal Gaussian*, 6(1), 51–60.
- Chan, K. C. G., Han, J., Kennedy, A. P., & Yam, S. C. P. (2022). Testing Network Autocorrelation without Replicates. *PLoS One*, 17(11), e0275532.
- Deviana, S., Nusyirwan, N., Azis, D., & Ferdias, P. (2021). Analisis Model Autoregressive Integrated Moving Average Data Deret Waktu dengan Metode Momen sebagai Estimasi Parameter. *Jurnal Siger Matematika*, 2(2), 57–67.
- Karami, R. (2019). Pengaruh Return Saham Terhadap Volatilitas Return Saham dengan Membandingkan Saham Sebelum Masuk dan Setelah Masuk di ISSI. *Jurnal Ilmiah Mahasiswa FEB*, 7(2).
- Olivia, H., & Hirawati, H. (2021). Pengaruh Struktur Aktiva dan Profitabilitas terhadap Struktur Modal (Penelitian pada PT. Unilever Indonesia, Tbk). *Business Management Analysis Journal (BMAJ)*, 4(2), 160–173.
- Putri, L. P. (2015). Pengaruh Profitabilitas terhadap Harga Saham pada Perusahaan Pertambangan Batubara di Indonesia. *Jurnal Ilmiah Manajemen Dan Bisnis*, 16(2), 49–59
- Raneo, A. P., & Muthia, F. (2018). Penerapan Model GARCH dalam Peramalan Volatilitas di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Manajemen Dan Bisnis Sriwijaya*, 16(3), 194–202.
- Retha, H. M. A., & Taslim, G. D. D. P. (2021). Forecasting dengan Double Exponential Smoothing pada Saham Unilever untuk Membantu Pengambilan Keputusan Swing Trader. *Prosiding Seminar Nasional Riset Pasar Modal*, 1(1).

- Saluza, I. (2017). Aplikasi GARCH dalam Mengatasi Volatilitas pada Data Keuangan. *Jurnal Matematika Vol*, 7(2), 107–118.
- Setiawan, A. (2012). Penentuan Distribusi Skewness dan Kurtosis dengan Metode Resampling berdasar Densitas Kernel: Studi Kasus pada Analisis Inflasi Bulanan Komoditas Bawang Merah, Daging Ayam Ras dan Minyak Goreng di Kota Semarang. *Prosiding Seminar Nasional Sains dan Pendidikan Sains VII UKSW*, 3(1), 240–247.
- Sianti, R. F., Surjanto, S. D., & Apriliani, E. (2022). Estimasi Tingkat Inflasi Nasional Menggunakan ARCH-GARCH Filter Kalman. *Jurnal Sains Dan Seni ITS*, 11(2), A37–A42.
- Sihombing, C. V. M., & Martha, S. (2022). Analisis Metode Hybrid Arima–Svr pada Indeks Harga Saham Gabungan. *Bimaster: Buletin Ilmiah Matematika, Statistika Dan Terapannya*, 11(3), 413–422.
- Simanjuntak, C. N., & Hoesin, S. H. (2022). Akibat Hukum Terhadap Notaris Atas Terjadinya Hibah Saham Berdasarkan Surat Kuasa yang Tidak Memiliki Kekuatan Hukum (Studi Kasus Putusan Pengadilan Negeri Nomor 94/Pdt. G/2017/Pn. Lbp). *PAKUAN LAW REVIEW*, 8(1), 18–33.
- Siregar, O. K. (2019). Pengaruh Deviden Yield dan Price Earning Ratio terhadap Return Saham di Bursa Efek Indonesia Tahun 2016 Sub Sektor Industri Otomotif. *Jurnal Akuntansi Bisnis dan Publik*, 9(2), 60–77.
- Sudarto, S., Wati, H. H., & Kurniasih, R. (2021). Memodel Volatilitas Return Saham dengan Model E-GARCH dan T-GARCH. *Jurnal Ekonomi, Bisnis, dan Akuntansi*, 23(2), 77–92.
- Sungkawa, I., & Megasari, R. T. (2011). Penerapan Ukuran Ketepatan Nilai Ramalan Data Deret Waktu dalam Seleksi Model Peramalan Volume Penjualan PT Satria Mandiri Citra Mulia. *ComTech: Computer, Mathematics and Engineering Applications*, 2(2), 636–645.
- Wahyuni, E. S. (2015). Analisa Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Harga dan Perkembangan Saham Syari'Ah di Indonesia. *EKOMBIS REVIEW: Jurnal Ilmiah Ekonomi Dan Bisnis*, 3(2).
- Wei, W. W. S. (2006). *Time Series Analysis: Univariate and Multivariate Methods*. Boston, MA: Pearson Addison Wesley.

- Wijaya, J. H., & Nugraha, N. M. (2020). Peramalan Kinerja Perusahaan Perbankan Tahun 2017 yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia dengan Metode ARCH-GARCH. *BISMA: Jurnal Bisnis Dan Manajemen*, 14(2), 101–108.
- Yolanda, N. B., Nainggolan, N., & Komalig, H. A. H. (2017). Penerapan Model ARIMA-GARCH untuk Memprediksi Harga Saham Bank BRI. *Jurnal MIPA*, 6(2), 92–96.
- Zili, A. H. A., Hendri, D., & Kharis, S. A. A. (2022). Peramalan Harga Saham dengan Model Hybrid Arima-Garch dan Metode Walk Forward. *Jurnal Statistika Dan Aplikasinya*, 6(2), 341–354.

