

DAFTAR PUSTAKA

- Aswi dan Sukarna. (2006). *Analisis Deret Waktu Aplikasi dan Teori*. Makassar: Andira Publisher.
- Azmi, U., dan Syaifudin, W. H. (2020). Peramalan Harga Komoditas dengan Menggunakan Metode Arima-Garch. *Jurnal Varian*, 3(2), 113-124.
- Batten, J. A., Ciner, C., dan Lucey, B. M. (2010). The macroeconomic determinants of volatility in precious metals markets. *Resources Policy*, 35(2), 65–71.
- Baur, D. G. dan Lucey, B. M. (2010). Is gold a hedge or a safe haven? An analysis of stocks, bonds and gold. *The Financial Review*, 45(2), 217–229.
- Bollerslev, T. (1986). Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity. *Journal of Mathematical Analysis and Applications*, 15(2), 243-252.
- Box, G. E. P., dan Cox, D. R. (1964). An analysis of transformations. *Journal of the Royal Statistical Society: Series B (Methodological)*, 26(2), 211–252.
- Box, G. E. P., dan Jenkins, G. M. (1976). *Time Series Analysis: Forecasting and Control* (Revised Edition). San Francisco: Holden Day.
- Chang, P. -C., Wang, Y. -W., dan Liu, C. -H. (2007). The development of a weighted evolving fuzzy neural network for PCB sales forecasting. *Expert Systems with Applications*, 32(1), 86–96.
- Cryer, J. dan Chan, K. (2008). *Time Series Analysis with Applications in R* (2nd ed.). New York: Springer.
- Daniel, W. W. (1989). *Statistika Nonparametric Terapan*. Jakarta: PT Gramedia Pustaka Utama.
- Dickey, D. A. dan Fuller, W. A. (1979). Distribution of the Estimators for Autoregressive Time Series with a Unit Root. *Journal of the American Statistical Association*, 74(366), 427-431.
- Draper, N., dan Smith, H. (1992). *Analisis Regresi Terapan* (Edisi Kedua). Jakarta: PT. Gramedia Pustaka Utama.
- Durbin, J. (1960). Estimation of Parameters in Time-Series Regression Models. *Journal of the Royal Statistical Society: Series B (Methodological)*, 22(1), 139-153.
- Engle, R. F. (1982). Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of United Kingdom Inflation. *Econometrica*, 50(4), 987-1007.

- Fajriyansyah, Beeg., Paendong, M. S., dan Mananohas, M. L. (2024). Penerapan Model ARIMA-GARCH untuk Peramalan Harga Emas Dunia. *d'Cartesian: Jurnal Matematika dan Aplikasi*, 13(2), 73–79.
- Hamid, Y., Hirzi, R. H., dan Septiani, A. (2024). Analisis perbandingan peramalan harga emas menggunakan metode ARIMA-GARCH dan Fuzzy Time Series Markov Chain. *Jurnal Penelitian Multidisiplin Terpadu*, 8(11).
- Hasan, A. (2019). Peramalan harga emas menggunakan pengukuran volatilitas model GARCH. *SEIKO: Journal of Management & Business*, 2(2), 157–173.
- Herjanto, E. (2008). *Manajemen Operasi*, Edisi Ketiga. Jakarta: Grasindo.
- Ispriyanti, D. (2004). Pemodelan Statistika dengan Transformasi Box-Cox. *Jurnal Matematika dan Komputer*, 7(3), 8-17.
- Kutner, M. H., Nachtsheim, C. J., Neter, J., dan Li, W. (2005). *Applied Linear Statistical Models* (5th ed.). New York: McGraw-Hill/Irwin.
- Lo, M. S. (2003). *Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedastic Time Series Models*. Spanyol: Simon Fraser University.
- Makridakis, S., Wheelwright, S. C., dan McGee, V. E. (1999). *Metode dan Aplikasi Peramalan* (Jilid 1). Jakarta: Erlangga.
- Montgomery, D. C., Jennings, C. L., dan Kulachi, M. (2008). *Introduction to Time Series Analysis and Forecasting*. Canada: John Wiley and Sons, Inc.
- Nurulhuda, E. S., dan Kosasih. (2019). Pengaruh inflasi, kurs dolar AS, dan suku bunga (BI) terhadap penentuan harga emas (Studi empiris: PT ANTAM Tbk tahun 2014–2018). *KINERJA: Jurnal Ekonomi dan Bisnis*, 2(1).
- Prasetya, B. D., Pamungkas, F. S., dan Kharisudin, I. (2020). Pemodelan dan Peramalan Data Saham dengan Analisis Time Series menggunakan Python. *PRISMA, Prosiding Seminar Nasional Matematika*, 3, 714-718.
- Rosadi, D. (2011). *Ekonometrika dan Analisis Runtun Waktu Terapan dengan Eviews*. Yogyakarta: ANDI.
- Sari, H. R., Wahyuningsih, S., dan Siringoringo, M. (2024). Peramalan harga emas Indonesia menggunakan model ARIMA (0,1,1) – GARCH (1,0). *Jurnal Eksponensial*, 15(1).
- Soejoeti, Z. (1987). *Analisis Runtun Waktu*. Jakarta: Karunika.
- Tarno. (2013). Kombinasi Prosedur Pemodelan Subset ARIMA dan Deteksi Outlier untuk Prediksi Data Runtun Waktu. *Prosiding Seminar Nasional Statistik Universitas Diponegoro 2013*, 583-592.

- Tsay, R. S. (2010). *Analysis of Financial Time Series* (Third Edition). New York: John Wiley & Sons, Inc.
- Wei, W. W. (2006). *Time Series Analysis Univariate and Multivariate Methods* (Second Edition). New York: Pearson.
- Widarjono, A. (2009). *Ekonometrika: Pengantar dan Aplikasinya* (Edisi Ketiga). Yogyakarta: Ekonesia.
- World Gold Council. (2023). *Gold Demand Trends Full Year 2023*. <https://www.gold.org/goldhub/research/gold-demand-trends/gold-demand-trends-full-year-2023>. (Diakses pada tanggal 1 Februari 2025).
- Wulandari, R. A., dan Gernowo, R. (2019). Metode Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) dan Metode Adaptive Neuro Fuzzy Inference System (ANFIS) dalam Analisis Curah Hujan. *Berkala Fisika*, 22(1), 41-48.
- Yahoo Finance. (2024). *Gold Futures Historical Data*. <https://finance.yahoo.com/quote/GC%3DF/history/?period1=1551398400&period2=1725062400>. (Diakses pada tanggal 1 Februari 2025).
- Yuwono, W., Calvin, C., Budiman, J., dan Marheni, D. K. (2025). Pengaruh faktor ekonomi makro terhadap harga emas di Indonesia. *Jurnal Lentera Bisnis*, 14(2), 1592–1606.