

DAFTAR PUSTAKA

- Arisandi, D. A., Ferdiansyah, Atika, L., Negara, E. S., & Wardani, K. R. N. (2020). Prediksi Mata Uang Bitcoin Menggunakan LSTM dan Analisis Sentimen pada Sosial Media. *Jurnal Ilmiah KOMPUTASI*, 559–566.
- Bowerman, B. L., & O'Connell, R. T. (1993). *Time series and forecasting: An applied approach* (3rd ed.). Boston: Duxbury Press.
- Box, G. E. P., Jenkins, G. M., Reinsel, G. C., & Ljung, G. M. (1970). *Time series analysis: Forecasting and control*. San Francisco: Holden Day.
- Cryer, J., & Chan, K. (2008). *Time series analysis with applications in R* (2nd ed.). New York: Springer.
- Daniel, W. W. (1989). *Statistika nonparametrik terapan*. Alih Bahasa: Alex Tri Jantjono W. Jakarta: PT Gramedia.
- Dickey, D. A., & Fuller, W. A. (1979). Distribution of the estimators for autoregressive time series with a unit root. *Journal of the American Statistical Association*, 74, 427–431.
- Durbin, J. (1960). Estimation of parameters in time-series regression models. *Journal of the Royal Statistical Society*, 139–153.
- Fadhilah, D. N., Parmikanti, K., & Ruchjana, B. N. (2024). Peramalan return saham subsektor perbankan menggunakan model ARIMA-GARCH. *Jurnal Fourier*, 13(1), 1–19.
- Firmansyah. (2006). *Analisis volatilitas harga kopi internasional*. Jakarta: Usahawan.
- Francq, C., & Zakoian, J. M. (2010). *GARCH models: Structure, statistical inference and financial applications*. Chicester: John Wiley & Sons Ltd.
- Goojier, J. G. D., & Hyndman, R. J. (2014). 25 years of time series forecasting. *International Journal of Forecasting*, 22(3), 443–473.
- Gyamerah, S. A. (2019). Modelling the volatility of Bitcoin returns using GARCH models. *Quantitative Finance and Economics*, 739–753.
- Handini, S., & Astawinetu, E. D. (2020). *Teori Portofolio dan Pasar Modal Indonesia*. Surabaya: Scopindo Media Pustaka.

- Ispriyanti, D. (2004). Pemodelan statistika dengan transformasi Box-Cox. *Jurnal Matematika dan Komputer*, 7(3), 8–17.
- Kim, J. M., Jun, C., & Lee, J. (2021). Forecasting the volatility of the cryptocurrency market by GARCH and stochastic volatility. *MDPI*, 91(14), 1–16.
- Laila, A. N., Anindita, R., & Koerniawati, T. (2017). Analisis volatilitas harga sayuran di Jawa Timur. *Jurnal Ekonomi Pertanian dan Agribisnis*, 1(2), 144–154.
- Lo, M. S. (2003). *Generalized autoregressive conditional heteroscedastic time series models*. Spanyol: Simon Fraser University.
- Makridakis, S., Wheelwright, S. C., & McGee, V. E. (1999). *Metode dan Aplikasi Peramalan* (Jilid 1). Alih Bahasa: Binarupa Aksara. Jakarta: Erlangga.
- Manuella Widodo, D., Sudarno, & Hoyyi, A. (2018). Pemodelan return harga saham menggunakan model intervensi-ARCH/GARCH (Studi kasus: Return harga saham PT Bayan Resources Tbk). *Jurnal Gaussian*, 7(2), 110–118.
- Pangaribuan, J. J., Fanny, F., Barus, O. P., & Romindo. (2023). Prediksi penjualan bisnis rumah properti dengan menggunakan metode autoregressive integrated moving average (ARIMA). *Jurnal Sistem Informasi Bisnis*, 13(2), 154–161.
- Panjaitan, H., Prahutama, A., & Sudarno. (2018). Peramalan jumlah penumpang kereta api menggunakan metode ARIMA, intervensi dan ARFIMA. *Jurnal Gaussian*, 7(1), 96–109.
- Paolella, M. S. (2019). *Linear models and time-series analysis regression, ANOVA, ARMA and GARCH*. Chennai: John Wiley & Sons.
- Prasetya, B. D., Pamungkas, F. S., & Kharisudin, I. (2020). Pemodelan dan peramalan data saham dengan analisis time series menggunakan Python. *PRISMA*, 714–718.
- Putri, F., Zukhronah, E., & Pratiwi, H. (2021). Model ARIMA-GARCH pada peramalan harga saham PT. Jasa Marga (Persero). *Business Innovation and Entrepreneurship Journal*, 3(3), 164–170.
- Ratnasari, D. H., Tarno, & Yasin, H. (2014). Peramalan volatilitas menggunakan model generalized autoregressive conditional heteroscedasticity in mean (GARCH-M). *Jurnal Gaussian*, 3(4), 655–662.

- Rosadi, D. (2011). *Ekonometrika dan analisis runtun waktu terapan dengan Eviews*. Yogyakarta: ANDI.
- Student. (1908). *The probable error of a mean*. *Biometrika*, Vol. 6, No. 1, 1-25.
- Sugiarto, & Harijono. (2000). *Peramalan bisnis*. Jakarta: PT. Gramedia Pustaka Utama.
- Suratna, Hendro, W., & Tri, W. (2020). *Investasi Saham*. LPPM Universitas Pembangunan Nasional “Veteran” Yogyakarta.
- Tandelilin, E. (2017). *Pasar Modal: Manajemen Portofolio dan Investasi*. Yogyakarta: Kanisius.
- Tarno. (2013). Kombinasi prosedur pemodelan subset ARIMA dan deteksi outlier untuk prediksi data runtun waktu. *Prosiding Seminar Nasional Statistik Universitas Diponegoro*, 583–592.
- Tsay, R. S. (2010). *Analysis of financial time series* (3rd ed.). New York: John Wiley & Sons.
- Warsito, D. O. L. (2020). Analisis volatilitas cryptocurrency, emas, dollar, dan indeks harga saham gabungan (IHSG). *International Journal of Social Science and Business*, 40–46.
- Wei, W. W. (2006). *Time series analysis: Univariate and multivariate methods* (2nd ed.). New York: Pearson.
- Widarjono, A. (2009). *Ekonometrika pengantar dan aplikasinya* (Edisi ketiga). Yogyakarta: Ekonesia.
- Widiharih, T., Widyanti, D., & Sudarno. (2023). Analisis volatilitas bitcoin menggunakan model ARCH dan GARCH. *Jurnal Gaussian*, 12(2), 254–265.