

DAFTAR PUSTAKA

- Box, G. E., & Jenkins, G. M. (1976). *Time Series Analysis Forecasting and Control (Second Edition)*. San Fransisco: Holden-Day.
- Brockwell, P. J., & Davis, R. A. (2016). *Introduction to Time Series and Forecasting* (Vol. Edition 3). Switzerland: Springer.
- Cryer, J. D., & Chan, K. S. (2008). *Time Series Analysis with Application in R*. New York: Springer New York.
- Darmadji, & Fakhrudin. (2006). *Pasar Modal di Indonesia Pendekatan Tanya Jawab*. Jakarta: Salemba Empat.
- Darmawan, G. (2008). Perbandingan Penaksiran Parameter Pembeda Pada Model Regresi Spektral. *Jurnal Sains*.
- Ekanda, M. (2014). *Analisis Data Time Series untyk Penelitian Ekonomi, Manajemen dan Akuntansi*. Jakarta.
- Enders, W. (1995). *Applied Econometric Time Series*. New York: John Wiley and Sons Inc.
- Engle, R. F. (1982). *Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of United Kingdom Inflation* (Vol. 50). *Econometrica*.
- Faiza, M. (2016). Perkembangan dan Tantangan Pasar Modal Indonesia. *Jurnal Lembaga Keuangan dan Perbankan*.
- Geweke, J., & Huldak, S. P. (1983). The Estimation and Application of Long Memory Time Series Models. *Journal of Time Series*, 221-238

- Hariyanto. (2023, May 23). *Saham BBKA: Emiten dengan Kapitalisasi Pasar Terbesar di BEI*. Retrieved from Ajaib.co.id: <https://ajaib.co.id/investasi-di-saham-bbca-dan-produk-yang-digunakan-setiap-hari/>
- Hartini, D. N. (2018). Penerapan Model Autoregressive Fractional Integrated Moving Average (ARFIMA) dalam Prakiraan Data Suku Bunga PUAB (Pasar Uang Antar Bank). *Jurnal Logika*.
- Hosking, J. M. (1981). Fractional Differencing. *Journal Biometrika*, 165-176.
- Hurst, H. E. (1956). The Problem of Long-Term Storage in Reservoirs. *Hydrological Sciences Journal*, 13-27.
- Husnan, S. (2004). Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas. *UPP AMP YKPN*.
- Kartikasari, P. (2020). Prediksi Harga Saham PT. Bank Negara Indonesia dengan Menggunakan Model Autoregressive Fractional Integrated Moving Average (ARFIMA). *Jurnal UNIMUS*. Retrieved from Jurnal UNIMUS.
- Makridakis, S. d. (1999). *Metode dan Aplikasi Peramalan Edisi Kedua Jilid 1*. Jakarta: Binarupa Aksara.
- Mar'ati, F. S. (2010). Mengenal Pasar Modal (Instrumen Pokok Dan Proses Go Public). *Jurnal STIE AMA*.
- Montgomery, D. d. (2008). *Forecasting Methods and Applications*. United State: John Wiley & Sons.
- Muklis, F. (2016). Perkembangan dan Tantangan Pasar Modal Indonesia. *Universitas Islam Negri Imam Bonjol*.

- Mutiara, S. (2016). Long Memory Model Dengan Garch Untuk Meramalkan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG). *Jurnal Universitas Negeri Semarang*.
- Ningrum, L. K. (2009). Penerapan Model ARFIMA (Autoregressive Fractional Integrated Moving Average) Dalam Peramalan Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia (SBI). *Universitas Sebelas Maret*.
- Paranikta, C., Dzukirom, M., & Hidayat, R. R. (2015). Analisis Kinerja Investasi Dalam Reksadana Saham (Equity Funds) dengan Metode Sharpe dan Treynor. *Jurnal Administrasi Bisnis*, 2. Retrieved from Media Neliti.
- Rosadi, D. (2011). *Analisis Ekonometrika & Runtun Waktu Terapan dengan R*. Yogyakarta: Andi Publisher.
- Satyarini, R. (2007). Menentukan Metode Peramalan Yang Tepat. *Jurnal UNPAR*. Retrieved from Bina Ekonomi Majalah Ilmiah Fakultas Ekonomi Unpar.
- Soejoeti, Z. (1987). *Analisi Runtun Waktu*. Jakarta: Universitas Terbuka.
- Suwardika, G., & Kuswanto, H. (2014). Performansi GPH Terkoreksi Terhadap Skip Sampling pada Proses Long Memory dan Spurious Long Memory. *Jurnal UNIMUS*. Retrieved from Jurnal UNIMUS.
- Tandelilin, E. (2007). Analisis Investasi dan Mnajemen Portofolio. In E. Tandelilin, *Analisis Investasi dan Mnajemen Portofolio*. Yogyakarta: BPFE.
- Tsay, R. S. (2010). Analysis of Financial Time Series Third Series Third Edition. *University Of Chicago*.
- Ubay, S. (2012). Peramalan Harga Saham Dengan Menggunakan Jaringan Syaraf Tiruan Metode Extreme Learning Machine. *Skripsi Universitas Airlangga*.
- Wei, W. (2006). Time Series Analysis : Univariate and Multivariate Methods. *Pearson Education, I*