

## DAFTAR PUSTAKA

- Al Anshory, M. A. H., Sulandari, W., & Susanti, Y. (2020, December). Peramalan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dolar Amerika Serikat Menggunakan *Singular Spectrum Analysis*. In *Seminar Nasional Pendidikan dan Ilmu Matematika (SENANDIKA) 2020*.
- Al Haris, M. (2020). Peramalan Harga Emas Dengan Model Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (GARCH). *Jurnal Saintika Unpam: Jurnal Sains dan Matematika Unpam*, 3(1), 19-30.
- Anonim. 2021. Satu Data Kementerian Perdagangan. Diakses tanggal 23 Desember 2021 dari <https://satudata.kemendag.go.id/exchange-rates>
- Arifin, S., & Mayasya, S. (2018). Faktor-faktor yang mempengaruhi nilai tukar rupiah terhadap dolar amerika serikat. *Jurnal Ekonomi-Qu*, 8(1).
- Asmawati, K. (2018). *Volatilitas Nilai Tukar Rupiah terhadap Dolar Amerika Serikat Tahun 2007-2016* (Doctoral dissertation, University of Muhammadiyah Malang).
- Bollerslev, T. (1986). Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity. *Journal of econometrics*, 31(3), 307-327.
- Chatfield, Dean C dkk. 2004. The Bullwhip Effect-Impact of Stochastic Lead Time, Information Quality, and Information Sharing: A Simulation Study. *Production and Operations Management*, Vol. 13 No. 4, pp. 340-353
- Dwitanto, D. 2011. Analisis Runtun Waktu Untuk Meramalkan Jumlah Pasien yang Berobat di Puskesmas Wilayah Blora dengan Menggunakan Software Minitab 14. Tugas Akhir. Semarang: FMIPA Universitas Negeri Semarang.
- Elvierayani, R. R. (2017, July). Peramalan Peramalan Nilai Tukar (Kurs) Rupiah Terhadap Dolar Tahun 2017 dengan Menggunakan Metode Arima Box-Jenkins. In *Prosiding SI MaNIs (Seminar Nasional Integrasi Matematika dan Nilai-Nilai Islami)* (Vol. 1, No. 1, pp. 253-261).
- Faustina, R. S., Agoestanto, A., & Hendikawati, P. (2017). Model Hybrid ARIMA-GARCH Untuk Estimasi Volatilitas Harga Emas Menggunakan Software R. *UNNES Journal of Mathematics*, 6(1), 11-24.
- GesafitoTandianus, G. (2016). *Aplikasi Peramalan Data Time Series Harga Saham Dengan Menggunakan Artificial Neural Network* (Doctoral dissertation, Sekolah Tinggi Informatika Dan Komputer Indonesia Malang).

- Hakimah, M., Rahmawati, W. M., & Afandi, A. Y. (2020). Pengukuran Kinerja Metode Peramalan Tipe *Exponential Smoothing* Dalam Parameter Terbaiknya. *Network Engineering Research Operation*, 5(1), 44-50.
- Hendikawati, Putriaji. 2015. Peramalan Data Runtun Waktu Metode dan Aplikasinya dengan Menggunakan Minitab dan Eviews. Semarang: FMIPA Universitas Negeri Semarang.
- Kesumawati, A. (2020). Implementasi Metode *Extreme Learning Machine* untuk Prediksi Nilai Tukar Rupiah Terhadap US Dollar (Studi Kasus: Kurs Jual Rupiah Terhadap US Dollar Tahun 2009-2019).
- Kusuma, B. E. (2019). Prediksi Kurs Mata Uang Rupiah Dengan Metode Backpropagation. *Journal of Informatics Engineering Research and Technology*, 1(1).
- Kusumawati, N., Marisa, F., & Wijaya, I. D. (2017). Prediksi Kurs Rupiah Terhadap Dollar Amerika Dengan Menggunakan Metode Regresi Linear. *JIMP (Jurnal Informatika Merdeka Pasuruan)*, 2(3).
- Kustiara, S. (2019). Penerapan Metode ARCH GARCH Dalam Meramalkan Indeks Harga Konsumen (IHK) Di Kota Semarang (Doctoral dissertation, Muhammadiyah University, Semarang).
- Kustiara, S., Nur, I. M., & Utami, T. W. (2020). ARCH GARCH *Method Of Forecasting Consumer Price Index (CPI) In Semarang: ARCH GARCH Method Of Forecasting Consumer Price Index (CPI) In Semarang. Jurnal Litbang Edusaintech*, 1(1), 14-22.
- Mukhlis, I. (2011). Analisis Volatilitas Nilai Tukar Mata Uang Rupiah Terhadap Dolar. *Journal Of Indonesian Applied Economics*, 5(2).
- Mutiara, S. 2015. Peramalan Dengan Menggunakan Metode Double Exponential Smoothing dari Brown dengan Studi Kasus Indeks Harga Konsumen (IHK). Skripsi. Samarinda: FMIPA Universitas Mulawarman.
- Nurrohim, M. (2013). Analisis Kausalitas Volatilitas Nilai Tukar Mata Uang Dengan Kinerja Sektor Keuangan Dan Sektor Rill. *Economics Development Analysis Journal*, 2(4).
- Putri, F. T. A., 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.
- Raharjo, G. S. Y., Umbara, R. F., & Murdiansyah, D. T. (2015). Peramalan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dolar Amerika Menggunakan Jaringan Syaraf Tiruan (p, d, q). *eProceedings of Engineering*, 2(3).

- Ramadhana, A. F. (2021). Perbandingan Model *Integrated Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity (IGARCH)* Dan *Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity In Mean (GARChM)* Untuk Perhitungan *Value At Risk* (Doctoral dissertation, Muhammadiyah University, Semarang).
- Ramadhan, B. A., & Rikumahu, B. (2015). Analisis Perbandingan Metode Arima Dan Metode Garch Untuk Memprediksi Harga Saham.(Studi Kasus Pada Perusahaan Telekomunikasi Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode Mei 2012-April 2013). *eProceedings of Management*, 2(1).
- Risma, R., & Sahrinan, S. (2020). Perbandingan Estimasi Metode Kuadrat Terkecil Terboboti dan Metode Transformasi Box-Cox Pada Data Heteroskedastisitas. *ESTIMASI: Journal of Statistics and Its Application*, 83-93
- Rosadi, Dedi. 2014. Analisis Runtun Waktu dan Aplikasinya dengan R. Gadjah Mada University Press: Yogyakarta.
- Sari, I. P. (2019). *Model Hybrid Glosten Jagannathan Runkle Garch Dan Radial Basis Function Neural Network (GJR GARCH-RBFNN) Untuk Peramalan Indeks Harga Saham Gabungan Di Bursa Efek Indonesia* (Doctoral dissertation, Universitas Gadjah Mada).
- Shumway, R. H. and Stoffer, D. S. (2011) *Time Series Analysis and Its Applications With R Examples*. Third edit, Revista do Hospital das Clínicas. Third edit. New York: Springer Science and Business Media LLC.
- Susilowati, I. H., & Rosento, R. (2020). Peramalan Nilai Tukar Kurs IDR Terhadap Dollar USD Dengan Metode *Moving Average* dan *Exponential Smoothing*. *Jurnal Perspektif*, 18(1), 91-98.
- Wei, W.W.S. 1990. *Times Series Analysis Univariate and Multivariate Methods*. California: Addison Wesley Publishing.
- Wei, W.W.S. 2006 *Time Series Analysis*. New York: Addison Wesley.
- Yusri, D. (2015). Peramalan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dollar Amerika Melalui Penerapan Model GARCH.