

DAFTAR PUSTAKA

- [1] I. Isnaini, D. Hariyanto, and R. Ferdian, “Analisis Pengaruh Likuiditas, Solvabilitas, Profitabilitas Terhadap Harga Saham,” *JIBEMA J. Ilmu Bisnis, Ekon. Manajemen, dan Akunt.*, vol. 1, no. 2, pp. 163–175, 2023, doi: 10.62421/jibema.v1i2.15.
- [2] A. I. Wulandari and I. B. Badjra, “Pengaruh Profitabilitas Terhadap Harga Saham Pada Perusahaan Lq-45 Di Bursa Efek Indonesia (Bei),” *E-Jurnal Manaj. Univ. Udayana*, vol. 8, no. 9, p. 5722, 2019, doi: 10.24843/ejmunud.2019.v08.i09.p18.
- [3] C. D. Setiawan, W. Sulandari, and Y. Susanti, “Peramalan Harga Saham Pt Unilever Indonesia Menggunakan Metode Hibrida Arima-Neural Network,” *Semnas Ristek (Seminar Nas. Ris. dan Inov. Teknol.*, vol. 7, no. 1, pp. 186–192, 2023, doi: 10.30998/semnasristek.v7i1.6270.
- [4] F. W. Ningsih and P. Muniarty, “Pengaruh Return On Assets Terhadap Debt To Equity Ratio Pada PT. Unilever, Tbk.,” *GANEC SWARA*, vol. 18, no. 2, pp. 883–890, 2024.
- [5] E. Indriawati, A. N. Hidayati, and M. A. Fuadilah Habib, “Pengaruh Net Profit Margin (NPM), Return On Asset (ROA), Earning Per Share (EPS), dan Debt to Equity Ratio (DER) terhadap return saham sektor consumer goods industry pada Bursa Efek Indonesia periode 2017-2021,” *Fair Value J. Ilm. Akunt. dan Keuang.*, vol. 4, no. 9, pp. 3933–3941, 2022, doi: 10.32670/fairvalue.v4i9.1576.
- [6] A. Yuantoro and S. Andayani, “Pengaruh Eps, Roe, Der Terhadap Harga Saham Dengan Dpr Sebagai Variabel Moderasi,” *J. Ris. Terap. Akunt.*, vol. 5, no. 2, pp. 10–21, 2021.
- [7] Y. D. Purwanti and P. Nurastuti, “Pengaruh Analisis Fundamental dan Risiko Sistematis Terhadap Harga Saham Pada Pasar Modal Syariah,” *EKOMABIS J. Ekon. Manaj. Bisnis*, vol. 1, no. 01, pp. 103–116, 2020, doi:

10.37366/ekomabis.v1i01.12.

- [8] D. Priyadi and I. Mardhiyah, “Model Autoregressive Integrated Moving Average (Arima) Dalam Peramalan Nilai Harga Saham Penutup Indeks Lq45,” *J. Ilm. Inform. Komput.*, vol. 26, no. 1, pp. 78–94, 2021, doi: 10.35760/ik.2021.v26i1.3695.
- [9] A. Ishak and W. Pratiwi, “Analisis Peramalan dengan Metode Time Series Pada Produk Hair Dryer,” *Talent. Conf. Ser. Energy Eng.*, vol. 3, no. 2, pp. 8–16, 2020, doi: 10.32734/ee.v3i2.967.
- [10] E. N. Hidayati, *Prakiraan Harga Saham PT. Unilever Indonesia (Tbk) Menggunakan Holts Weighted Exponential Moving Average*, Skripsi, UIN Syarif Hidayatullah Jakarta, Jakarta, 2020.
- [11] S. Supriyanto, A. P. Utami, and N. Istikanaah, “Model Peramalan Harga Saham Menggunakan Metode Arima – Garch (Studi Kasus Saham Pt. Unilever Indonesia),” *J. Ilm. Mat. dan Pendidik. Mat.*, vol. 15, no. 1, p. 1, 2023, doi: 10.20884/1.jmp.2023.15.1.8658.
- [12] R. Adisetiawan, N. Nuraini, H. T. Putri, and A. Ahmadi, “Permodelan GARCH pada IHSG dan Indeks LQ45,” *J-MAS (Jurnal Manaj. dan Sains)*, vol. 6, no. 2, p. 448, 2021, doi: 10.33087/jmas.v6i2.307.
- [13] N. Wati and A. Puspitaningtyas, “Pengaruh Volume Perdagangan Saham, Tingkat Inflasi dan Nilai Tukar Terhadap Volatilitas Harga Saham Sub Sektor Batu Bara yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia,” *J. Manaj. Bisnis Krisnadwipayana*, vol. 11, no. 2, pp. 881–890, 2023, doi: 10.35137/jmbk.v11i2.80.
- [14] M. Citra, “Comparative Study of Stock Price Forecasting Models PT. Unilever Indonesia Tbk Using Arima and Garch,” *Int. J. Community Serv.*, vol. 2, no. 1, pp. 1–22, 2021, doi: 10.55299/ijcs.v2i1.220.
- [15] R. S. Matondang, A. Indah, and L. Nasution, “The Impact of the Boycott on the Fall on Stock Price of PT . Unilever,” *Al-Mashrafiyah J. Ekon.*

Keuangan, dan Perbank. Syariah, vol. 8, no. 1, pp. 41–54, 2024.

- [16] L. N. Rahmawati, M. Mardlijah, and A. Hakam, “Penerapan Metode Kalman Filter dalam Estimasi Harga Saham Menggunakan Model ARCH-GARCH,” *J. Sains dan Seni ITS*, vol. 12, no. 1, 2023, doi: 10.12962/j23373520.v12i1.96240.
- [17] S. A. Rasyidah and D. A. Maulana, “Prediksi Harga Saham Pt. Goto Gojek-Tokopedia Menggunakan Geometric Brownian Motion Termodifikasi Kalman Filter Dengan Konstrain,” *J. Ilm. Mat.*, vol. 12, no. 3, pp. 704–713, 2024.
- [18] R. F. Sianti, S. D. Surjanto, and E. Apriliani, “Estimasi Tingkat Inflasi Nasional Menggunakan ARCH-GARCH Filter Kalman,” *J. Sains dan Seni ITS*, vol. 11, no. 2, 2022, doi: 10.12962/j23373520.v11i2.75827.
- [19] F. Rahma, A. Anwar, and N. Oktaviah, “Boikot Produk Unilever : Adakah Dampaknya Terhadap Return Saham PT Unilever Indonesia?,” *J. Iqtisaduna*, vol. 10, no. 2, pp. 384–395, 2024, doi: 10.24252/iqtisaduna.v10i2.52474.
- [20] M. I. Rizki, T. Ammar, F. Fitriyani, and S. Fasya, “Peramalan Indeks Harga Saham PT Verena Multi Finance Tbk Dengan Metode Pemodelan ARIMA Dan ARCH-GARCH,” *J Stat. J. Ilm. Teor. dan Apl. Stat.*, vol. 14, no. 1, pp. 11–23, 2021, doi: 10.36456/jstat.vol14.no1.a3774.
- [21] J. H. Wijaya and N. M. Nugraha, “Peramalan Kinerja Perusahaan Perbankan Tahun 2017 Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Dengan Metode Arch-Garch,” *BISMA J. Bisnis dan Manaj.*, vol. 14, no. 2, p. 101, 2020, doi: 10.19184/bisma.v14i2.17512.
- [22] M. I. Rizki, T. A. Taqiyyuddin, P. F. Rahmah, and A. E. Hasana, “Penerapan Model ARCH/GARCH untuk Memprediksi Harga Saham Perusahaan Tokai Carbon,” *J. Sains Mat. dan Stat.*, vol. 7, no. 2, 2021, doi: 10.24014/jsms.v7i2.13138.

- [23] M. Arashi and M. M. Rounaghi, "Analysis of market efficiency and fractal feature of NASDAQ stock exchange: Time series modeling and forecasting of stock index using ARMA-GARCH model," *Futur. Bus. J.*, vol. 8, no. 1, pp. 1–12, 2022, doi: 10.1186/s43093-022-00125-9.
- [24] A. H. A. Zili, D. Hendri, and S. A. A. Kharis, "Peramalan Harga Saham Dengan Model Hybrid Arima-Garch dan Metode Walk Forward," *J. Stat. dan Apl.*, vol. 6, no. 2, pp. 341–354, 2022, doi: 10.21009/jsa.06218.
- [25] E. Purnaningrum, "Pendekatan Metode Kalman Filter untuk Peramalan Pergerakan Indeks Harga Saham Terdampak Pandemi Coronavirus," *Maj. Ekon.*, vol. 25, no. 1411, pp. 103–109, 2020.
- [26] B. Liu and H. Zhu, "Analysis of market efficiency in main stock markets: using Karman-Filter as an approach," *arXiv Prepr. arXiv2404.16449*, 2024.
- [27] A. T. Biva, S. A. Khan, and S. Hossain, "A Comparative Study of ARIMA, Artificial Neural Networks, and Kalman Filter Models for Dhaka Stock Exchange Forecasting," *GANIT J. Bangladesh Math. Soc.*, vol. 44, pp. 29–58, 2024, doi: doi.org/10.3329/ganit.v44i1.73986.
- [28] R. Marten, A. Nugraha, A. Wahid, and V. Afifah, "Pengaruh Return On Assets (ROA), Return On Equity (ROE), Net Profit Margin (NPM), dan Debt To Equity Ratio (DER) Terhadap Harga Saham Perusahaan Sektor Property dan Real Estate yang Terdaftar di Bei Tahun 2017-2021," *Innobiz: J. Ilmu Manaj., Bisnis dan Keuang.*, vol. 1, no. 1, pp. 1–16, 2024.
- [29] M. Husni, A. Rahman, Y. Rura, S. Rasyid, "Abnormal Return Pada Perusahaan Sektor Barang dan Konsumsi di Bursa Efek Indonesia," *JIMAT (J. Ilm. Mahasiswa Akuntansi) Undiksha.*, pp. 1059–1065, 2022.
- [30] L. Khanady, D. Nababan, "Prediksi Harga Saham Dengan Menggunakan JST (Jaringan Syaraf Tiruan)," *J. Ilm. Informatika.*, no. 6, p. 9, 2019.
- [31] P. C. Puspa and M. A. Ghoni, "Peranan Pasar Modal Dalam Perekonomian Negara Indonesia," *J. AkunStie*, vol. 5, no. 2, pp. 50–61, 2019.

- [32] Y. N. Oktario, “Analisis Pengaruh ROE, DAR, dan CR Terhadap Harga Saham Farmasi di BEI,” *J. Ilmu dan Ris. Akunt.*, vol. 10, no. 9, pp. 1–20, 2021.
- [33] M. D. A. Rochim and B. N. Asiyah, “Pengaruh Analisis Teknikal, Fundamental, Dan Bandarmologi Terhadap Keuntungan Investor Tahun 2021 Di Bursa Efek Indonesia,” *SINOMIKA J. Publ. Ilm. Bid. Ekon. dan Akunt.*, vol. 1, no. 4, pp. 981–998, 2022, doi: 10.54443/sinomika.v1i4.483.
- [34] U. Auliah, R. Rafidah, and F. Mubarak, “Penerapan metode ARIMA terhadap perkiraan harga saham pada perusahaan Bank Syariah Indonesia (BSI),” *J. Perdagangan. Ind. dan Monet.*, vol. 11, no. 1, pp. 2303–1204, 2023.
- [35] R. Julian and M. R. Pribadi, “Peramalan Harga Saham Pertambangan Pada Bursa Efek Indonesia (BEI) Menggunakan Long Short Term Memory (LSTM),” *JATISI (Jurnal Tek. Inform. dan Sist. Informasi)*, vol. 8, no. 3, pp. 1570–1580, 2021, doi: 10.35957/jatisi.v8i3.1159.
- [36] W. Y. Rusyida and V. Y. Pratama, “Prediksi Harga Saham Garuda Indonesia di Tengah Pandemi Covid-19 Menggunakan Metode ARIMA,” *Sq. J. Math. Math. Educ.*, vol. 2, no. 1, p. 73, 2020, doi: 10.21580/square.2020.2.1.5626.
- [37] D. Safitri, P. Tazkia, X. Amanda, Y. Shintia, T. F. Putri, and S. N. Amada, “Analisa Strategi Bisnis pada PT. Unilever Indonesia,” *J. Publ. Ilmu Manaj.*, vol. 2, no. 2, pp. 2963–8712, 2023, doi: 10.55606/jupiman.v2i2.1661
- [38] R. A. Qadri, F. Cuandra, A. Alexander, J. Lim, A. N. Chandra, and J. Kurniawan, “Penerapan Manajemen Rantai Pasok Berbasis Sistem Erp Pada Pt. Unilever Indonesia,” *J. Inov. Penelit.*, vol. 3, no. 1, pp. 4555–4562, 2022.
- [39] N. Hayati, *Pengaruh Return On Asset (ROA) Dan Return On Equity (ROE) Terhadap Harga Saham (Studi Kasus PT. Unilever Indonesia Tbk.)*, Skripsi, Universitas Muhammadiyah Sumatra Barat, Padang, 2022.
- [40] B. Setianto, *Daftar Semua Emiten (769) yang Sudah Listed di Bursa Efek Indonesia*. BSK Capital, 2022.

- [41] M. P. Daeli, M. M. Bate'e, dan Y. N. Telaumbanua, "Analisis Net Profit Margin Pada Pt Unilever Indonesia Tbk (Perusahaan Manufaktur Yang Terdaftar Pada Bursa Efek Indonesia)," *J. EMBA J. Ris. Ekon. Manajemen, Bisnis dan Akunt.*, vol. 10 no. 4, pp. 1462–1471, 2022.
- [42] W. Y. Rusyida, *Teknik Peramalan: Metode ARIMA dan Holt Winter*. Penerbit NEM, 2022.
- [43] S. V. Natasya and R. M. Awangga, *Membuat Analisis Komparatif Arima & Prophet Pada Peramalan Penjualan*. Penerbit Buku Pedia, 2023.
- [44] N. C. Mamuaya, *Teknik Peramalan Bisnis*. CV. AZKA PUSTAKA, 2024.
- [45] S. Syahril, R. Masbar, S. Syahnur, M. Shabri, and I. Irmayani, *Kelapa Sawit (Perspektif Volatilitas Harga, Margin Pemasaran dan Lingkungan Hidup)*. Syiah Kuala University Press, 2022.
- [46] A. Nefi, *Insider Trading: Indikasi, Pembuktian, dan Penegakan Hukum*. Sinar Grafika, 2020.
- [47] N. M. N. Yudistira, L. M. D. Alfiansih, N. I. Andriyani, W. Essayem, I. W Nurdian, N. A. Maghfiroh, *Prediksi Deret Waktu Menggunakan Deep Learning*. Universitas Brawijaya Press, 2023.
- [48] J. E. Hanke and D. W. Wichern, *Business Forecasting*, 9th ed. New Jersey: Pearson Prentice Hall, 2009.
- [49] M. Silfiani, *Analisis Runtun Waktu (ST201419)*. Budi Publisher, 2022.
- [50] H. Kusdarwati, U. Effendi, and S. Handoyo, *Analisis Deret Waktu Univariat Linier Teori dan Terapannya dengan Rstudio*. Universitas Brawijaya Press, 2022.
- [51] D. Rosadi, *Ekonometrika dan Analisis Runtun Waktu Terapan dengan Eviews*. Penerbit Andi, 2012.
- [52] W. W. S. Wei, *Time Series Analysis Univariate and Multivariate Methods*.

Pearson Addison Wesley, 2006.

- [53] W. Irawan, “Peramalan Harga Saham PT.Unilever Tbk dengan Menggunakan Metode ARIMA,” *J. Mat. UNAND*, vol. 4, no. 3, p. 80, 2019, doi: 10.25077/jmu.4.3.80-89.2015.
- [54] Y. Maulana, “Pemodelan Volatilitas Indeks Harga Saham Sektor di Indonesia,” *Log. J. Penelit. Univ. Kuningan*, vol. 13, no. 1, pp. 53–72, 2022.
- [55] Z. B. Pambuko and N. L. Masrini, *EViews: Analisis Data Keuangan untuk Penelitian Mahasiswa Ekonomi*. Unimma Press, 2023.
- [56] M. Firdaus, *Aplikasi Ekonometrika dengan E-Views, Stata dan R*. PT Penerbit IPB Press., 2020.
- [57] R. F. Engle, “Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of United Kingdom Inflation,” *Econometrica*, vol. 50, no. 4, pp. 987–1007, 1982, doi: 10.1093/oso/9780198774310.003.0001.
- [58] J. L. Cheng-Few Lee, Hong-Yi Chen, *Financial Econometrics, Mathematics and Statistics*. 2019.
- [59] Y. Maulana, “Analisis Volatilitas dan Forecast Saham PT Antam (Persero) Tbk. Dan PT Adaro Energy Tbk. dengan Garch, Egarch dan Gjr,” *ECONBANK J. Econ. Bank.*, vol. 2, no. 1, pp. 37–42, 2020, doi: 10.35829/econbank.v2i1.73.
- [60] T. Bollerslev, “Generalized autoregressive conditional heteroskedasticity,” *J. Econom.*, vol. 31, no. 3, pp. 307–327, 1986, doi: doi:10.1016/0304-4076(86)90063-1.
- [61] F. J. Fabozzi, “Advances in Fixed Income Valuation Modeling and Risk Management,” Wiley, 1997.
- [62] D. A. Wulansari, Y. Yundari, and M. Shantika, “Pemodelan Gjr-Garch Pada Data Kurs Harian Rupiah Terhadap Dolar Amerika Saat Krisis Ekonomi,”

- Bul. Ilm. Math. Stat. dan Ter.*, vol. 10, no. 2, pp. 243–250, 2021.
- [63] N. Ngatini and D. Indriyani, “Aplikasi Kalman Filter untuk Memprediksi Jumlah Penderita Tuberkulosis di Indonesia,” *J. Mat. Sains, dan Pembelajarannya*, vol. 16, no. 1, pp. 52–61, 2022.
- [64] M. H. Pamungkuas, *Estimasi Parameter Model ARIMA Menggunakan Kalman Filter Untuk Peramalan Permintaan Darah (Studi Kasus: UTD PMI Surabaya)*, Institut Teknologi Sepuluh Nopember (ITS), Skripsi, Institut Teknologi Sepuluh Nopember (ITS), Surabaya, 2021.
- [65] R. Setiawan, H. H. Triharminto, and M. Fahrurrozi, “Gesture Control Menggunakan IMU MPU 6050 Metode Kalman Filter Sebagai Kendali Quadcopter,” *Pros. Semin. Nas. Sains Teknol. dan Inov. Indones.*, vol. 3, no. November, pp. 411–422, 2021, doi: 10.54706/senastindo.v3.2021.133.
- [66] F. L. Lewis, L. Xie, and D. Pota, *Optimal and Robust Estimation With an Introduction to Stochastic Control Theory, Second Edition*. Boca Raton, 2008. doi: <https://doi.org/10.1201/9781315221656>.
- [67] F. Hendajani, I. P. Wardhani, S. Widayati, and Soegijanto, “Data Analisis Permintaan Barang dengan Metode Peramalan (Data Analysis for Demand Parts with Forecasting Method),” *EKOMABIS J. Ekon. Manaj. Bisnis*, vol. 3, no. 2, pp. 169–180, 2022.
- [68] I. T. Petersen, *Principles of Psychological Assessment With Applied Examples in R*. CRC Press, 2024.
- [69] E. Wijaya *et al.*, *Buku Ajar Ekonometrika*. PT. Sonpedia Publishing Indonesia, 2024.
- [70] I. U. Moffat and E. A. Akpan, “Selection of Heteroscedastic Models: A Time Series Forecasting Approach,” *Appl. Math.*, vol. 10, no. 05, pp. 333–348, 2019, doi: 10.4236/am.2019.105024.
- [71] R. S. Tsay, *Analysis of Financial Time Series*, 2nd ed. Hoboken, NJ, USA:

Wiley-Interscience, 2005.

- [72] N. Azizah, K. Nugraheni, and S. A. W. Dinata, "Triple-Seasonal ARIMA Untuk Peramalan Data Konsumsi Beban Listrik," *Contemp. Math. Appl.*, vol. 5, no. 1, pp. 37–53, 2023, doi: 10.20473/conmatha.v5i1.44740.
- [73] M. Ningsih, "Prediksi Harga Saham Harian PT BTPN Syariah Tbk Menggunakan Model Arima dan Model Garch," *J. Ilm. Ekon. Islam*, vol. 7, no. 03, pp. 1573–1580, 2021, doi: 10.29040/jiei.v7i3.2795
- [74] L. Lasmadi, F. Kurniawan, and M. I. Pamungkas, "Estimasi Sudut Rotasi Benda Kaku Berbasis IMU Menggunakan Kalman Filter," *Avitec*, vol. 3, no. 1, pp. 57–68, 2021, doi: 10.28989/avitec.v3i1.909.
- [75] J. E. Saputra and W. Febrianti, "Application of Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) for Forecasting Inflation Rate in Indonesia," *J. Mat. Stat. Dan Komputasi*, vol. 21, no. 2, pp. 382–396, 2025, doi: 10.20956/j.v21i2.36609.