

DAFTAR PUSTAKA

Buku

- Aziz, Abdul. *Manajemen Investasi Syariah*. Bandung: Alfabeta, 2010.
- Citra Santyaningtyas, Ayu, dan Dina Tsalist Wildana. *Investasi Syariah*. Jember: UPT Percetakan & Penerbitan Universitas Jember, 2019.
- Faisal Rinaldi, Sony, dan Bagya Mujianto. *Metodologi Penelitian dan Statistik*. Jakarta: Kementerian Kesehatan RI, 2017.
- Ibrahim, Azharsyah. *Pengantar Ekonomi Islam*. Jakarta: Departemen Ekonomi dan Keuangan Syariah - Bank Indonesia, 2021.
- Lasmi Wardiyah, Mia. *Manajemen Pasar Uang dan Pasar Modal*. Bandung: Pustaka Setia, 2017.
- Nafis, Cholil. *Teori Hukum Ekonomi Syariah*. Jakarta: UI-Press, 2011.
- Najib Al-Bantani, Tubagus. *Al-Qur'an Mushaf Al-Bantani*. Banten: Majelis Ulama Indonesia Provinsi Banten, 2010.
- Raihan. *Metodologi Penelitian*. Jakarta: Universitas Islam Jakarta, 2017.
- Rosadi, Dedi. *Ekonometrika & Analisis Runtun Waktu Terapan dengan Eviews*. Yogyakarta: Andi Offset, 2012.
- Rumawi, dkk. *Hukum Pasar Modal*. Bandung: Widina Bhakti Persada, 2021.
- Siyoto, Sandu, dan Ali Sodik. *Dasar Metodologi Penelitian*. Yogyakarta: Literasi Media Publishing, 2015.
- Soemitra, Andri. *Bank dan Lembaga Keuangan Syariah*. Jakarta: KENCANA, 2016.

Syahrum, dan Salim. *Metodologi Penelitian Kuantitatif*. Bandung: Citapustaka Media, 2012.

Wahyu Winarno, Wing. *Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan Eviews*. Yogyakarta: UPP STIM YKPN, 2017.

Widarjono, Agus. *EKONOMETRIKA Pengantar dan Aplikasinya Disertai Panduan Eviews*. Yogyakarta: UPP STIM YKPN, 2018.

Jurnal dan Skripsi

Agustina, Irvan, dan Charitas Fibriani. “Analisis Data Mahasiswa Baru Menggunakan Metode ARIMA (Studi Kasus: UKSW Salatiga).” Artikel Ilmiah, Fakultas Teknologi Informasi, Universitas Kristen Satya Wacana Salatiga November 2014, 2015.

Ahnaf Zufar, Muhammad. “Perbandingan Metode ARIMA Dengan RBFNN Dalam Peramalan Rata-Rata Banyaknya Bilangan Sunspot.” Skripsi, Fakultas Sains Dan Teknologi Universitas Islam Negeri Maulana Malik Ibrahim, 2018.

Aksan, Ilham, dan Khalilah Nurfadilah. “Aplikasi Metode ARIMA Box-Jenkins Untuk Meramalkan Penggunaan Harian Data Seluler.” *Journal Of Mathematics, Theory, And Applications* 2, no. 1, 2020.

Arum Pitaloka, Riski. “Perbandingan Metode ARIMA Box-Jenkins Dengan ARIMA ENSEMBLE Pada Peramalan Nilai Impor Provinsi Jawa Tengah.” *Jurnal Gaussian* 8, no. 2, 2019.

Bastian, Firliyansah, dan Fitrah Sari Islami. “Peramalan Harga Saham PT. Bank Mandiri (Persero) Tbk. Menggunakan Metode ARIMA.” *Jurnal Paradigma Multidisipliner* 2, no. 2, 2021.

Dwi Nurindah Sari, Erna. “Peramalan Harga Saham Perusahaan Industri Perbankan Menggunakan Metode ARIMA Box-Jenkins.” Tugas Akhir, Departemen Statistika Bisnis, Fakultas Vokasi, Institut Teknologi Sepuluh Nopember, 2017.

- Fadilla. "Pasar Modal Syariah dan Konvensional." *Journal Islamic Banking* 3, no. 2, 2018.
- Fadlullah Hana, Kharis. "Dialetika Hukum Trading Saham Syariah Di Bursa Efek Indonesia." *Journal Of Sharia Economic Law* 1, no. 2, 2018.
- Faqih, Ahmad. "Praktik Jual Beli Saham Syariah Perspektif Hukum Islam." *Jurnal IQTISAD* 5, no. 1, 2018.
- Farhan Putra Abdillah, Muhammad, Etik Zukhronah, dan Respatiwulan. "Peramalan Harga Saham PT. Bank Central Asia (BCA) Menggunakan Metode Auto Regressive Intergrated Moving Average (ARIMA)." *Jurnal Prosiding Seminar Nasional Aplikasi Sains & Teknologi*, 2021.
- Galuh Hendriana, Nadia. "Analisis Perkembangan dan Prediksi Tingkat Pertumbuhan Bank Syariah Di Indonesia." Skripsi, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah, 2011.
- Hariang Kencana, Dimas, dan Rani Apriani. "Perspektif Hukum Investasi Terhadap Pengaruh Pertumbuhan dan Perkembangan Ekonomi Nasional." *Jurnal Ilmu Hukum dan Humaniora* 8, no. 4, 2021.
- Istiqomah, Widia, dan Mohamad Yamin Darsyah. "Efektivitas Metode ARIMA dan Exponential Smoothing untuk Meramalkan Nilai Tukar Petani Di Jawa Tengah." *Jurnal Prosiding Seminar Nasional Mahasiswa Unimus* 1, 2018.
- Latumahina, Handy, dan dkk. "Peramalan Inflasi Kota Ambon Tahun 2021 Menggunakan Metode ARIMA Box Jenkins." *Jurnal Matematika, Statistika Dan Terapannya* 1, no. 2, 2021.
- Mustikowati. "Pengaruh Inflasi, Non Performing Finance (NPF), Volume Perdagangan Saham (VPS) dan Biaya Operasional Terhadap Pendapatan Operasional (BOPO) Terhadap Return Saham Bank Panin Dubai Syariah Periode 2014-2018." Skripsi, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam Universitas Islam Negeri Walisongo Semarang, 2019.

- Nur Inayah, Ina. "Prinsip-Prinsip Ekonomi Islam Dalam Investasi Syariah." *Jurnal Ilmu Akuntansi dan Bisnis Syariah* 2, no. 2, 2020.
- Pris Hadi, Hikmat. "Analisis Data Time Series Dengan Model ARIMA Box-Jenkins Pada Parameter Model Peramalan (Studi Kasus: PT. Lippo Karawaci Tbk. Periode Januari 2010-Desember 2015)." Skripsi, Fakultas Sains Dan Teknologi Universitas Islam Negeri Sunan Kalijaga Yogyakarta, 2016.
- Salwa, Nany, dan dkk. "Peramalan Harga Bitcoin Menggunakan Metode ARIMA (Auto Regressive Integrated Moving Average)." *Jurnal Of Data Analisis* 1, no. 1, 2018.
- Schima Wulandari, Suci. "Penerapan Metode Arima Box-Jenkins dalam Memprediksi Fluktuasi Harga Saham (Studi Kasus Pada PT Bank Central Asia Tbk)." Skripsi, Fakultas Sains dan Teknologi Universitas Jambi, 2021.
- Syaifullah, Muhammad. "Manajemen Strategi Galeri Investasi Syariah Dalam Meningkatkan Minat Mahasiswa Untuk Berinvestasi Di Pasar Modal Syariah." *Jurnal Ekonomi Keuangan dan Perbankan Syariah* 3, no. 2, 2019.
- Yamin Darsyah Sismi, Moh. "Perbandingan Prediksi Harga Saham PT. BRI Tbk dengan Metode ARIMA dan Moving Average." *Jurnal Prosiding Seminar Nasional Mahasiswa Unimus* 1, 2018.
- Yamin, Moh., dan Muhammad Saifudin. "Model Terbaik ARIMA dan WINTER Pada Peramalan Data Saham Bank." *Jurnal Statistika* 4, no. 1, 2016.
- Yulia Rusyida, Wilda, dan Versiandika Yudha Pratama. "Prediksi Harga Saham Garuda Indonesia di Tengah Pandemi Covid-19 Menggunakan Metode ARIMA." *Journal of Mathematics and Mathematics Education* 2, no. 1, 2020.
- Yusuf, Muhammad, dan dkk. "Determinasi Investasi Dan Pasar Modal Syariah Terhadap Pertumbuhan Ekonomi Di Indonesia." *Jurnal Kajian Ekonomi dan Kebijakan Publik* 6, no. 1, 2021.

LAMPIRAN

Harga Penutupan Saham PT. Bank Panin Dubai Syariah periode bulanan Januari 2015-Januari 2022

Bulan	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022
Januari	187	236	109	86	61	50	64	68
Februari	193	220	104	87	72	50	100	
Maret	233	218	113	93	62	50	80	
April	266	202	116	86	65	50	151	
Mei	276	196	117	88	61	50	119	
Juni	265	210	140	73	59	50	153	
Juli	270	212	111	72	55	50	148	
Agustus	252	216	101	68	56	50	110	
September	224	199	100	67	50	50	88	
Oktober	232	169	94	61	50	50	85	
November	242	146	77	50	50	69	85	
Desember	250	120	65	50	50	83	85	

Output Hasil Estimasi Parameter Model ARIMA (1,1,2)

Dependent Variable: D(LOG(ADJ_CLOSE))
 Method: ARMA Maximum Likelihood (OPG - BHHH)
 Date: 02/08/22 Time: 20:23
 Sample: 2015M02 2022M01
 Included observations: 84
 Convergence achieved after 20 iterations
 Coefficient covariance computed using outer product of gradients

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.011690	0.018537	-0.630629	0.5301
AR(1)	-0.149205	0.091543	-1.629895	0.1071
MA(2)	0.213506	0.092324	2.312580	0.0233
SIGMASQ	0.019822	0.002517	7.875090	0.0000
R-squared	0.088708	Mean dependent var		-0.012043
Adjusted R-squared	0.054534	S.D. dependent var		0.148371
S.E. of regression	0.144268	Akaike info criterion		-0.986342
Sum squared resid	1.665071	Schwarz criterion		-0.870589
Log likelihood	45.42637	Hannan-Quinn criter.		-0.939810
F-statistic	2.595800	Durbin-Watson stat		1.962446
Prob(F-statistic)	0.058148			
Inverted AR Roots	-.15			
Inverted MA Roots	-.00+.46i			

Output Hasil Estimasi Parameter Model ARIMA (1,1,3)

Dependent Variable: D(LOG(ADJ_CLOSE))
 Method: ARMA Maximum Likelihood (OPG - BHHH)
 Date: 02/08/22 Time: 20:23
 Sample: 2015M02 2022M01
 Included observations: 84
 Convergence achieved after 48 iterations
 Coefficient covariance computed using outer product of gradients

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.012103	0.013332	-0.907799	0.3667
AR(1)	-0.147456	0.106398	-1.385891	0.1696
MA(3)	-0.185589	0.087672	-2.116849	0.0374
SIGMASQ	0.020468	0.002591	7.899088	0.0000
R-squared	0.059043	Mean dependent var		-0.012043
Adjusted R-squared	0.023757	S.D. dependent var		0.148371
S.E. of regression	0.146598	Akaike info criterion		-0.954273
Sum squared resid	1.719273	Schwarz criterion		-0.838520
Log likelihood	44.07945	Hannan-Quinn criter.		-0.907741
F-statistic	1.673276	Durbin-Watson stat		1.904386
Prob(F-statistic)	0.179363			
Inverted AR Roots	-.15			
Inverted MA Roots	.57	-.29-.49i	-.29+.49i	

Output Hasil Estimasi Parameter Model ARIMA (4,1,1)

Dependent Variable: D(LOG(ADJ_CLOSE))
 Method: ARMA Maximum Likelihood (OPG - BHHH)
 Date: 02/08/22 Time: 20:23
 Sample: 2015M02 2022M01
 Included observations: 84
 Convergence achieved after 25 iterations
 Coefficient covariance computed using outer product of gradients

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.011678	0.017734	-0.658534	0.5121
AR(4)	0.057181	0.080615	0.709311	0.4802
MA(1)	-0.131184	0.098364	-1.333663	0.1861
SIGMASQ	0.021092	0.002504	8.424341	0.0000
R-squared	0.030336	Mean dependent var		-0.012043
Adjusted R-squared	-0.006027	S.D. dependent var		0.148371
S.E. of regression	0.148817	Akaike info criterion		-0.925386
Sum squared resid	1.771725	Schwarz criterion		-0.809633
Log likelihood	42.86620	Hannan-Quinn criter.		-0.878854
F-statistic	0.834262	Durbin-Watson stat		2.042011
Prob(F-statistic)	0.478968			
Inverted AR Roots	.49	-.00+.49i	-.00-.49i	-.49
Inverted MA Roots	.13			

Output Hasil Estimasi Parameter Model ARIMA (4,1,2)

Dependent Variable: D(LOG(ADJ_CLOSE))
 Method: ARMA Maximum Likelihood (OPG - BHHH)
 Date: 02/08/22 Time: 20:23
 Sample: 2015M02 2022M01
 Included observations: 84
 Convergence achieved after 43 iterations
 Coefficient covariance computed using outer product of gradients

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.011588	0.026067	-0.444551	0.6578
AR(4)	0.127800	0.082193	1.554879	0.1239
MA(2)	0.278935	0.082786	3.369360	0.0012
SIGMASQ	0.019959	0.002292	8.708796	0.0000
R-squared	0.082412	Mean dependent var		-0.012043
Adjusted R-squared	0.048002	S.D. dependent var		0.148371
S.E. of regression	0.144766	Akaike info criterion		-0.978712
Sum squared resid	1.676574	Schwarz criterion		-0.862959
Log likelihood	45.10591	Hannan-Quinn criter.		-0.932180
F-statistic	2.395022	Durbin-Watson stat		2.215100
Prob(F-statistic)	0.074393			
Inverted AR Roots	.60	.00-.60i	-.00+.60i	-.60
Inverted MA Roots	-.00+.53i	-.00-.53i		

Output Hasil Estimasi Parameter Model ARIMA (4,1,3)

Dependent Variable: D(LOG(ADJ_CLOSE))
 Method: ARMA Maximum Likelihood (OPG - BHHH)
 Date: 02/08/22 Time: 20:24
 Sample: 2015M02 2022M01
 Included observations: 84
 Convergence achieved after 36 iterations
 Coefficient covariance computed using outer product of gradients

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.012253	0.016366	-0.748654	0.4563
AR(4)	0.056475	0.086157	0.655492	0.5140
MA(3)	-0.252922	0.080418	-3.145106	0.0023
SIGMASQ	0.020766	0.002199	9.443573	0.0000
R-squared	0.045340	Mean dependent var		-0.012043
Adjusted R-squared	0.009540	S.D. dependent var		0.148371
S.E. of regression	0.147661	Akaike info criterion		-0.938829
Sum squared resid	1.744310	Schwarz criterion		-0.823076
Log likelihood	43.43083	Hannan-Quinn criter.		-0.892297
F-statistic	1.266484	Durbin-Watson stat		2.233437
Prob(F-statistic)	0.291541			
Inverted AR Roots	.49	-.00+.49i	-.00-.49i	-.49
Inverted MA Roots	.63	-.32+.55i	-.32-.55i	

