

DAFTAR PUSTAKA

- Abdullah, Abdi, A. R., & Razak, M. (2021). Pasar Modal Syariah di Indonesia: Tinjauan Teori dan Aspek Hukum. In A. Firman, M. Hidayat, & M. Hamzah (Eds.), *Nobel Press*. Penerbit Nobel Press (STIE Nobel Indonesia Makasar).
<http://repo.handayani.ac.id/52/>
- Amin, N. F., Garancang, S., & Abunawas, K. (2023). Konsep Umum Populasi dan Sampel Penelitian. *Jurnal Kajian Islam Kontemporer*, 14(1), 15–31.
<https://journal.unismuh.ac.id/index.php/pilar/article/view/10624>
- Dewi, P. E. D. M. (2017). Pengaruh Rasio Likuiditas, Profitabilitas, Solvabilitas, Aktivitas Dan Penilaian Pasar Terhadap Return Saham. *Jurnal Ilmiah Akuntansi*, 1(2), 109–132. <https://doi.org/10.23887/jia.v1i2.9988>
- Duan, J., Gong, Y., Luo, J., & Zhao, Z. (2023). Air-quality prediction based on the ARIMA-CNN-LSTM combination model optimized by dung beetle optimizer. *Scientific Reports*, 13(1), 1–16. <https://doi.org/10.1038/s41598-023-36620-4>
- E.P.Box, G., M.Jenkins, G., Reinsel, G. C., & Ljung, G. (2016). Time Series Analysis Forecasting and Control. In *Sustainability (Switzerland)*, 11(1).
 simultaneously in Canada.
<http://scioteca.caf.com/bitstream/handle/123456789/1091/RED2017-Eng-8ene.pdf?sequence=12&isAllowed=y%0Ahttp://dx.doi.org/10.1016/j.regsciurbeco.2008.06.005%0Ahttps://www.researchgate.net/publication/305320484>
- I
- Engle, R. F., & Granger, C. W. J. (1987). Co-Integration and Error Correction: Representation, Estimation, and Testing. *Econometrica*, 55(2), 251–276.

<http://links.jstor.org/sici?sici=0012->

[9682%28198703%2955%3A2%3C251%3ACAECRE%3E2.0.CO%3B2-T](http://links.jstor.org/sici?sici=0012-9682%28198703%2955%3A2%3C251%3ACAECRE%3E2.0.CO%3B2-T)

Fadhilah, D. N., Parmikanti, K., & Ruchjana, B. N. (2024). Peramalan Return Saham Subsektor Perbankan Menggunakan Model ARIMA-GARCH. *Jurnal Fourier*, 13(1), 1–19. <https://doi.org/10.14421/fourier.2024.131.1-19>

Hardani, Auliya, N. H., Andriani, H., Fardani, R. A., Ustiawaty, J., Utami, E. F., Sukmana, D. J., & Istiqomah, R. R. (2020). *Buku Metode Penelitian Kualitatif dan Kuantitatif* (H. Abadi (ed.)). CV. Pustaka Ilmu Group. <https://www.researchgate.net/publication/340021548>

Hidayana, R. A., & Ruchjana, B. N. (2023). Peramalan Return Saham Menggunakan Model Integrated Moving Average. *Jambura Journal of Mathematics*, 5(1), 199–209. <https://doi.org/10.34312/jjom.v5i1.17381>

Ibrahim, Z., Anita, Marfuah, S., & Fitriani, N. (2023). *Pengukuran Model Penerapan Harga Kesimbangan Pasar: Uji Perbandingan Indonesia Versus Malaysia (Diuji Pada Bank Umum Syariah Yang Melakukan Go Public)*. Fakultas Ekonomi dan Bisnis Islam UIN Sultan Maulana Hasanuddin Banten.

Juanda, B., & Junaidi. (2012). *Ekonometrika Deret Waktu Teori Dan Aplikasi*. IPB Press. <https://bambangjuanda.com>

Kayla, D., Mayari, P., Cupian, C., & Noven, S. A. (2025). Estimasi Peramalan Volatilitas Return Saham Perusahaan Sektor Energi Pada Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI). *Jurnal Inovasi Syariah Dan Akuntansi*, 2(1), 130–141. <https://doi.org/https://doi.org/10.61132/jiesa.v2i1.826>

Khan, S., & Alghulaiakh, H. (2020). ARIMA model for accurate time series stocks

forecasting. *International Journal of Advanced Computer Science and Applications*, 11(7), 524–528.

<https://doi.org/10.14569/IJACSA.2020.0110765>

KSEI Indonesia Central Securities Depository. (2024). *Statistik Pasar Modal Indonesia*. Publikasi PT Kustodian Sentral Efek Indonesia. <https://www.ksei.co.id>

Lemiyana. (2015). Analisis Model CAPM dan APT Dalam Memprediksi Tingkat Return Saham Syariah (Studi kasus Saham di Jakarta Islamic Index). *I-Finance*, 1(1), 1–20. <https://www.neliti.com/id/publications/276462/analisis-model-capm-dan-apt-dalam-memprediksi-tingkat-return-saham-syariah-studi>

Luthfi, F., Aya, S. A., Arminingsih, D., Mubaraq, A., Iman, M., & Achmad, T. (2022). Analisis Prediksi Perkembangan Pasar Modal Syariah Di Indonesia Menggunakan Model Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA). *Prosiding Seminar Nasional Seminar Akademik Tahunan Ilmu Ekonomi Dan Studi Pembangunan*, 5(1), 6–14. <https://feb.untan.ac.id/wp-content/uploads/2023/06/2.pdf>

Miharja, J. (2023). *Instrumen Pasar Modal Syariah Pada Era Global* (Zulpawati (ed.)). UIN Mataram Press. <https://repository.uinmataram.ac.id>

Mubarok, F., & Bisma, M. F. A. (2020). Modeling of Jakarta Islamic Index Stock Volatility Return Pattern with Garch Model. *Al-Tijary*, 6(1), 17–30. <https://doi.org/10.21093/at.v6i1.2468>

Mulhan, M. S., & Qudratullah, M. F. (2021). Pemodelan Return Saham Syariah di Indonesia menggunakan Model AGARCH dengan Distribusi Skewed Student-

- t. *Jurnal Fourier*, 10(1), 1–12. <https://doi.org/10.14421/fourier.2021.101.1-12>
- Munawaroh, H., & Suryaningsih, R. (2024). Pengaruh ROA, DER, dan EPS Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Makanan dan Minuman di ISSI 2019-2022. *Niqosiya: Journal of Economics and Business Research*, 4(01), 159–176. <https://doi.org/10.21154/niqosiya.v4i01.3434>
- Nisa, E. K. (2022). Penentuan Saham Syariah Terbaik melalui Pendekatan Peramalan. *Journal of Mathematics and Mathematics Education*, 4(1), 27–42. <https://doi.org/10.21580/square.2022.4.1.11229>
- Otoritas Jasa Keuangan (OJK). (2021). Bertumbuh di Masa Pemulihan Ekonomi Laporan Perkembangan Pasar Modal Syariah 2021. In *Pasar Modal Syariah - Sharia Capital Market Development Report*. <https://ojk.cp.id>
- Otoritas Jasa Keuangan (OJK). (2023). *Statistik Daftar Efek Syariah (DES)*. Otoritas Jasa Keuangan. <https://ojk.co.id>
- Prasetya, A., Ahmar, N., Mulyadi, J., & Suyanto, S. (2020). Faktor Yang Mempengaruhi Return Saham Perusahaan Properti Dalam Indeks Saham Syariah Indonesia. *Jurnal Manajemen Kewirausahaan*, 17(2), 161. <https://doi.org/10.33370/jmk.v17i2.464>
- Ridha, M. R., & Wibowo, A. (2020). Analisis Volatilitas Return Indeks Saham Sektor Barang Konsumsi Di Indonesia: Aplikasi Metode Threshold-Garch(TGARCH). *Journal of Statistics and Its Applications*, 2(1), 35–43. <https://ojs3.unpatti.ac.id/index.php/variance/> Accepted: 2020-06-29
- Santoso, I., & Madiistryatno, H. (2015). *Metodologi Penelitian Kuantitatif*. Indigo Media. www.pustakaindigo.com

- Srihari, G., Kusuma, T., Chetanraj, D. B., Kumar, S. J. P., & Aluvala, R. (2024). "Predictive modeling of return volatility in sustainable investments: An in-depth analysis of ARIMA, GARCH, and ARCH techniques." *Investment Management and Financial Innovations*, 21(1), 213–228. [https://doi.org/10.21511/imfi.21\(1\).2024.17](https://doi.org/10.21511/imfi.21(1).2024.17)
- Subhaktiyasa, P. G. (2024). Menentukan Populasi dan Sampel : Pendekatan Metodologi Penelitian Kuantitatif dan Kualitatif. *Jurnal Ilmiah Profesi Pendidikan*, 9(4), 2721–2731. pgs@stikeswiramedika.ac.id
- Sudarmadji. (2022). *Buku Ajar Analisis Investasi* (Samryn (ed.)). Tanri Abeng University Press. www.tau.ac.id
- Suratna, Widjanarko, H., & Wibawa, T. (2020). Investasi saham. In H. S. Utomo (Ed.), *IPPM UPN "Veteran" Yogyakarta*. Lppm Upn Veteran Yogyakarta.
- Widodo, P., & Suryanto, D. (2021). Pengujian Terhadap Volatilitas Return Indeks Saham Konvensional Dengan Indeks Saham Saham Syariah Sebelum Covid 19. *Jurnal Sosial Humaniora Terapan*, 4(1), 1–13. <https://scholarhub.ui.ac.id/jsht/vol4/iss1/8%0AThis>
- Winarno, W. W. (2017). Analisis Ekonometrika dan Statistika Dengan EViews (Edisi 5). *Analisis Ekonometrika Dan Statistika Dengan EViews (Edisi 5)*, 102(1), 53–71. <https://www.belbuk.com/analisis-ekonometrika-dan-statistika-dengan-eviews-edisi-4-p-10178.html>