

DAFTAR PUSTAKA

- Adnyana, I. M. (2020). Manajemen Investasi dan Portofolio. Lembaga Penerbitan Universitas Nasional (LPU-UNAS), Jakarta Selatan.
- Alqiha, M. F., & Imani, G. L. L. (2021). Analisis Portofolio Optimal Dengan Model CAPM Pada Saham-Saham Syariah Jakarta Islamic Index (JII) Tahun 2017-2020. *Accounting and Financial Review (AFRE)*, 1(1), 1-14.
- Anandita, A., dan Wahyuningsih, T. (2024). Prediksi Indeks Saham Syariah Menggunakan Model *Long Short-Term Memory* (LSTM). *Jurnal Ilmu Manajemen (JIMMU)*, 9(1), 1-12. <https://doi.org/10.33474/jimmu.v9i1.21547>.
- Aprilia, A.D., Nurdin, A.A., & Mai, M.U. (2021). Analisis Pembentukan Portofolio Optimal dan Penentuan Nilai Risiko pada Saham Syariah. *Journal of Applied Islamic Economics and Finance*, 1(2), 487– 498. <https://doi.org/10.35313/jaief.v1i2.2480>.
- Aunillah, M. W., & Wahyudi. (2022). Analisis Portofolio Optimal CAPM dan *Single Index Model* pada Perusahaan IDX30. *Jurnal Ilmiah Ekonomi Islam*, 8(02), 2231–2240. <http://dx.doi.org/10.29040/jiei.v8i2.5772>.
- Aprian, B. A., Azhar, Y., & Nastiti, V. R. S. (2020). Prediksi Pendapatan Kargo Menggunakan Arsitektur *Long Short Term Memory*. *Jurnal Komputer Terapan*, 6(2), 148–157. <https://doi.org/10.35143/jkt.v6i2.3621>.
- Aulia, N. (2020). Prediksi Harga Ethereum Berdasarkan Informasi *Blockchain* Menggunakan *Metode Long Short Term Memory* (Doctoral dissertation, Universitas Islam Indonesia).
- Adiningsih, S. U. (2021). Aktualisasi model GARCH dan peramalan volatilitas *Return* saham Asia (Skripsi, Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Universitas Islam Negeri Jakarta). <https://repository.uinjkt.ac.id/dspace/handle/123456789/59271>.
- Alhafiz, F. (2023). *Simulasi model GARCH menggunakan program R* (Skripsi, Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam, Universitas Lampung). <http://digilib.unila.ac.id/70004/4/SKRIPSI%20TANPA%20BAB%20PEMBAHASAN.pdf>.
- Aigidya, A., Wigati, A., Ansori, A., Ramadhanty, D., Sofiana, K., & Maruddani, D. (2025). Penerapan Metode MVEP dalam Penyusunan Saham Portofolio LQ45 dan Perhitungan Ukuran Risiko dengan Simulasi Monte-Carlo Menggunakan R-GUI. *PROSIDING SEMINAR NASIONAL SAINS DATA*, 4(1), 1137 - 1148. <https://doi.org/https://doi.org/10.33005/senada.v4i1.362>.
- Budiprasetyo, G., Hani'ah, M., dan Aflah, D. Z. (2023). Prediksi Harga Saham Syariah Menggunakan Algoritma *Long Short-Term Memory* (LSTM). *Jurnal Nasional Teknologi dan Sistem Informasi*, 8(3), 164-172. <https://doi.org/10.25077/TEKNOSI.v8i3.2022.164-172>.

- Baidowi, M. I., & Buniarto, E. A. (2020). Analisis Ramalan Penjualan Menggunakan Metode *Time Series* dalam Menentukan Jumlah Produksi. *Management Science: Journal of Management Economics*, 1(1), 33–40.
- Badu, R. M. (2021). Pemodelan Harga Saham dengan Pendekatan Model ARCH-GARCH (Studi Kasus: Harga Saham PT. TELKOM) (Skripsi, Fakultas Sains dan Teknologi, Universitas Islam Negeri Maulana Malik Ibrahim Malang). <http://etheses.uin-malang.ac.id/27815/6/14610091.pdf>.
- Brilliantya, S. N. (2022). Model EGARCH dan TGARCH untuk Mengukur Volatilitas Asimetris *Return* Saham. (Skripsi, Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam, Universitas Lampung, Bandar Lampung). <http://digilib.unila.ac.id/64437/3/3.%20SKRIPSI%20TANPA%20BAB%20PEMBAHASAN.pdf>.
- Cahyadi, R., Damayanti, A., & Aryadani, D. (2020). *Recurrent Neural Network* (Rnn) dengan *Long Short Term Memory* (LSTM) untuk Analisis Sentimen Data Instagram. *Jurnal Informatika dan Komputer* (JIKO), 5(1). <http://dx.doi.org/10.26798/jiko.v5i1.407>.
- Ermanely, Devianto, D., & Yanuar, F. (2023). Model Volatilitas Saham LQ45 dengan Pendekatan *Markov-Switching* GARCH. *Lebesgue: Jurnal Ilmiah Pendidikan Matematika, Matematika dan Statistika*, 4(2), 1211-1219. <https://doi.org/10.46306/lb.v4i2.402>.
- Ekananda, M. (2019). *Manajemen Investasi*. Erlangga, Jakarta.
- Fitrinanda, G., & Djunaidy, A. (2022). Peramalan Harga Saham PT Adaro Energy Indonesia Tbk yang Mempertimbangkan Faktor Kurs Dolar Amerika Menggunakan *Bidirectional Long-Short Term Memory*. *Jurnal Teknik ITS*, 11(3), A169–A176. <http://dx.doi.org/10.12962/j23373539.v11i3.92124>.
- Garini, F. C., & Anbiya, W. (2022). *The Application of GARCH Forecasting Method in Predicting The Number of Rail Passengers (Thousands of People) in Jabodetabek Region*. *Jurnal Matematika, Statistika Dan Komputasi*, 18(2), 198–223. <https://doi.org/10.20956/j.v18i2.18382>.
- Hartono, J. (2017). *Teori Porotofolio dan Analisis Investasi*, Edisi 11. BPFE Yogyakarta, Yogyakarta.
- Handini, S., & Astawinetu, E.D. (2020). *Teori Portofolio dan Pasar Modal Indonesia*. Scopindo Media Pustaka, Surabaya.
- Jumiaty, Pimpi, L., Muhtar, N., Abapihi, B., Aswani, A., & Ningtyas, R.A. (2024). Analisis Volatilitas Saham Sektor Perbankan Menggunakan Metode GARCH (Studi Kasus: Bank BUMN pada Saham LQ45 yang Terdaftar di BEI). *Jurnal Matematika, Komputasi dan Statistika*, 4(2), 663–674. <https://doi.org/10.33772/jmks.v4i2.98>.

- Kalsum, U., Efendi, B., Fikri, Z., & Astuti, N. (2023). Optimalisasi Alokasi Sumber Daya Keuangan: Strategi Maksimalkan *Return*. PT Literasi Nusantara Abadi Grup, Malang. https://www.researchgate.net/publication/377296946_05_E-BOOK_-_OPTIMALISASI_ALOKASI_SUMBER_DAYA_KEUANGAN
- Kuncoro, I. B. (2023). Analisa *Capital Asset Pricing Model* (CAPM); Konseptual. Universitas Mercu Buana.
- Kwanda, K., Herwindiati, D. E., dan Lauro, M. D. (2024). Perbandingan LSTM dan *Bidirectional* LSTM pada Sistem Prediksi Harga Saham Berbasis *Website*. *Ranah Research: Journal of Multidisciplinary Research and Development*, 7(1), 16-25. <https://doi.org/10.38035/rrij.v7i1.1255>.
- Karno, A. S. B. (2020). Analisis Data *Time Series* Menggunakan LSTM (*Long Short Term Memory*) dan ARIMA (*Autocorrelation Integrated Moving Average*) Dalam Bahasa *Python*. *Ultima InfoSys: Jurnal Ilmu Sistem Informasi*, 11(1). <https://doi.org/10.31937/si.v9i1.1223>.
- Kalengkongan, C. S., Langi, Y. A. R., & Nainggolan, N. (2020). Analisis Volatilitas Harga Bawang Putih Di Kota Manado Menggunakan Model GARCH. *D'Cartesian: Jurnal Matematika dan Aplikasi*, 9(1), 43–49. <https://doi.org/10.35799/dc.9.1.2020.27398>.
- Karlina, S., Sulistianingsih, E., & Satyahadewi, N. (2024). Analisis conditional value at risk portofolio saham dengan copula Clayton. *Epsilon: Jurnal Matematika Murni dan Terapan*, 18(2), 228-239. <https://ppjp.ulm.ac.id/journals/index.php/epsilon/p>.
- Martalena, & Malinda, M. (2019). Pengantar Pasar Modal. ANDI, Yogyakarta.
- Nasthasya, N., Yozza, H., & Devianto, D. (2023). Model *Capital Asset Pricing Model* (CAPM) dalam Pembentukan Portofolio Optimal Saham Jakarta Islamic Index (JII). *Jurnal Matematika UNAND*, 12(4), 299–308. <https://doi.org/10.25077/jmua.12.4.299-308.2023>
- Ngantung, M., & Jan, A. H. (2019). Analisis Peramalan Permintaan Obat Antibiotik pada Apotek Edelweis Tatelu. *EMBA: Jurnal Riset Ekonomi, Manajemen, Bisnis dan Akuntansi*, 7(4), 1–10. <https://doi.org/10.35794/emba.v7i4.25439>.
- Nur Fadhila, S., & Zuliana, S. U. (2023). Optimasi Portofolio Saham Menggunakan Model Markowitz Berdasarkan Prediksi Harga Saham. *Kaunia: Integration and Interconnection Islam and Science Journal*, 18(1), 35–40. <https://doi.org/10.14421/kaunia.3948>
- Pasaribu, R. H. (2024). Analisis Perbandingan Potensi Risiko Maksimum yang Dihadapi Investor dengan Berinvestasi di Portofolio Optimal Metode Markowitz dan Portofolio Optimal Metode *Single Index Model*. *Jurnal Ilmiah Multidisiplin*, 3(01), 71–87. <https://doi.org/10.56127/jukim.v3i01.1147>.
- Pipin, S. J., Purba, R., & Kurniawan, H. (2023). Prediksi Saham Menggunakan *Recurrent Neural Network* (RNN-LSTM) dengan Optimasi *Adaptive Moment Estimation*.

- Journal of Computer System and Informatics (JoSYC)*, 4(4), 806-815.
<https://doi.org/10.47065/josyc.v4i4.4014>.
- Pratami, A., Virgantari, F., & Andriyati, A. (2023). *Penerapan Model Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) untuk Peramalan Indeks Harga Konsumen Di Provinsi Jawa Barat* (Skripsi, Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam, Universitas Pakuan). <http://eprints.unpak.ac.id/id/eprint/7660>.
- Rahmawati, E. S. (2023). *Analisis Capital Asset Pricing Model (CAPM) Dalam Pengambilan Keputusan Investasi Pada Saham yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) Periode Januari 2017 - November 2022* (Skripsi, Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Universitas Pakuan, Bogor). <http://localhost:8080/xmlui/handle/123456789/7127>.
- Ramadhan, M. F. (2024). *Prediksi harga Bitcoin menggunakan metode Long Short Term Memory* (Skripsi, Fakultas Sains dan Teknologi, Universitas Jambi). <https://repository.unja.ac.id/62231/6/FULL%20SKRIPSI.pdf>.
- Riyantoko, P. A., Fahrudin, T. M., Hindrayani, K. M., & Safitri, E. M. (2020). *Analisis Prediksi Harga Saham Sektor Perbankan Menggunakan Algoritma Long-Short Term Memory (LSTM)*. Seminar Nasional Informatika 2020 (SEMNASIF 2020), 1(1). <http://jurnal.upnyk.ac.id/index.php/semnasif/article/view/4135/3094>.
- Sumarga, C. C., Herwindiati, D. E., & Hendryli, J. (2023). *Rancangan Sistem Prediksi Harga Saham dengan Menggunakan Metode LSTM dan ARMA klasik*. *Jurnal Ilmu Komputer dan Sistem Informasi*, 11(1), 1-15. <https://doi.org/10.24912/jiksi.v11i1.24075>
- Sriwahyuni, D. (2023). *Pengujian Markowitz dan CAPM dalam Pembentukan Risk-Return Portofolio Saham Syariah* (Skripsi, Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah Jakarta).
- Silitonga, G. N. N. br., & Aziz, A. (2023). *Analisis Portofolio Optimal Model CAPM dalam Pengambilan Keputusan Investasi Saham pada IDXQ30*. *Media Mahardhika*, 22(1), 125–137. <https://doi.org/10.29062/mahardhika.v22i1.802> \.
- Todingan, N., Manurung, T. & Mongi , C. E. (2023). *Analisis Saham-Saham dengan Menggunakan Capital Asset Pricing Model (CAPM) dalam Pembentukan Portofolio Optimal*. *D'Cartesian: Jurnal Matematika dan Aplikasi*, 12(2), 45–55. <https://doi.org/10.35799/dc.12.2.2023.50257>.
- Tandelilin, E. (2017). *Pasar Modal: Manajemen Porotofolio & Investasi*. Yogyakarta.
- Wefi, A. (2020). *Manajemen Investasi dan Pasar Modal*. Pamekasan..
- Wiranda, L., & Sadikin, M. (2020). *Penerapan Long Short Term Memory Pada Data Time Series Untuk Memprediksi Penjualan Produk Pt. Metiska Farma*. *Jurnal Nasional Pendidikan Teknik Informatika : JANAPATI*, 8(3), 184–196. <https://doi.org/10.23887/janapati.v8i3.19139>.