

## DAFTAR PUSTAKA

- Agus Harjito, dan Martono. 2011. Manajemen Keuangan. Edisi Kedua, Cetakan Pertama, Penerbit EKONISIA. Yogyakarta.
- Bodie Zvi, Alex Kane, Alan J. Marcus. 2014. Investasi. Jakarta : Salemba Empat.
- Darmadji, dan Hendy M. Fakhruddin. 2012. Pasar Modal di Indonesia: Pendekatan Tanya Jawab. Edisi Ketiga. Jakarta : Salemba Empat.
- David, dan Kurniawan Indonanjaya. 2010. Manajemen Investasi Pendekatan Teknikal dan Fundamental untuk Analisis Saham. Graha Ilmu.
- Elton, E.J, *et, al.* 2007. *Modern Portfolio Theory and Investment Analysys*. News Jersey : John Wiley & Sons.
- Elton, E.J, *et, al.* 2009. *Modern Portfolio Theory and Investment Analysys 8th Edition*. United States of America : John Wiley & Sons.
- Elton, E.J, *et, al.* 2011. *Modern Portfolio Theory and Investment Analysis, US* : John Wiley & Sons Ltd.
- Gumanti, Tatang Ary. 2011. Manajemen Investasi. Bogor : Mitra Wacana Media.
- Hadi, Nor. 2013. Pasar Modal. Yogyakarta : Graha Ilmu.
- Halim, Abdul. 2005. Analisis Investasi (cet.ke-2). Jakarta : Salemba Empat.
- Hasibuan, S.P. Malayu. 2013. Manajemen Sumber Daya Manusia. Jakarta: PT Bumi Aksara.
- Heykal Mohammad. 2012. Tuntunan dan Aplikasi Investasi Syariah. Jakarta: PT. Elex Media Komputindo.
- Horne, James C. Van, dan John M. Wachowicz, Jr. 2012. Prinsip-prinsip Manajemen Keuangan (Edisi 13). Jakarta : Salemba Empat.
- I Made Sudana. 2011. Manajemen Keuangan Perusahaan Teori & Praktik. Penerbit Erlangga.
- Irham Fahmi. 2012. Pengantar Pasar Modal. Alfabeta, Bandung.

- Jensen, Michael C. 1969. *The Pricing of Capital Assets, and The Evaluation of Investment Performance*, *Journal of Business* 42, 167-247.
- Jogiyanto Hartono. 2013. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi (Edisi Kedelapan)*. Yogyakarta: BPFE.
- Jones Charles P. 2014. *Investment Analysis and Management*, Twelveth Edition, John Wiley and Sons Inc. New York.
- Kamaludin, dan Rini Indriani. 2012. *Manajemen Keuangan “Konsep Dasar dan Penerapannya” Edisi Revisi*. Penerbit CV. Mandar, Bandung.
- Keown J. Arthur, Martin D. John, Petty William J. JR. David F.Scott. 2011. *Manajemen Keuangan: Prinsip dan Penerapan, Alih Bahasa : Marcus Prihminto Widodo*. Edisi Kesepuluh. PT. Index Yogyakarta.
- King, Benjamin F. 1966. *Market and Industry Factors in Stock Price Behavior*. *The Journal of Business*. University of Chicago Press. Vol.39. pages 139.
- Kotter John. 2014. *Leading Change with a new Preface*, Kindle Edition, Library of Congress Catalog in Published Data, USA.
- Markowitz, Harry M. 1952. *Portfolio Selection Journal of Finance*, 7(1), pp:77-91.
- Martelena, dan Malinda. 2011. *Pengantar Pasar Modal*. Edisi Pertama. Yogyakarta: Andi.
- Marzuki Usman. 2005. *Pengetahuan Dasar Pasar Modal*, diterbitkan atas Kerjasama Jurnal Keuangan dan Moneter dengan Institut Bankir Indonesia.
- Robbin P. Stephen, & Coutler Marry. 2014. *Management*, 12<sup>th</sup> Edition, Pearson Education. New York.
- Syofian, Siregar. 2013. *Metode Penelitian Kuantitatif*. Jakarta: Prenada Media Group.
- Sharpe, William F. 1963. *A Simplified Model for Portfolio Analysis*.
- Suad Husnan. 2009. *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*, Edisi Keempat. Penerbit UPP STIM YKPN. Yogyakarta.

- Sugiyono. 2016. *Metode Penelitian Manajemen*, Cetakan Ke-5. Alfabeta, Bandung.
- Sugiyono. 2014. *Metode Penelitian Kuantitatif Kualitatif dan R&D*. Alfabeta, Bandung.
- Sunariyah. 2011. *Pengantar Pengerahuan Pasar Modal*. Edisi ke-6. Yogyakarta: Sekolah Tinggi Ilmu Manajemen YKPN.
- Susaty Herlambang. 2013. *Pengantar Manajemen (cara mudah memahami ilmu manajemen)*. Gosyen Publishing. Yogyakarta.
- Suharsimi Arikunto. 2013. *Prosedur Penelitian Suatu Pendekatan Praktik*. Jakarta : Rineka Cipta.
- Tandelilin Eduardus. 2010. *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi*. Yogyakarta : Kanisius.
- Treynor, J.L. 1966. *How to rate management investment funds*. Harvard Business Review, 43, 63-75.
- Zubir, Zalmi. 2011. *Manajemen Portofolio Penerapannya dalam Investasi Saham*. Jakarta : Salemba Empat.

#### **Jurnal :**

- Artie, dan Igo Febrianto. 2012. *Stock Portfolio Performance Analysis in Estate Crop Subsector Using Sharpe Measure, Treynor Measure, and Jensen Measure*. Jurnal Ilmiah ESAI Vol. 6, No.3, Juli 2012.
- Berto Usman, Ridwan, dan Iskandar. 2012. *Analisis Akurasi Bearish Versus Bullish Dengan Menggunakan Candlestick Analysis : Studi Empiris Terhadap Indeks Saham LQ45 (1999-2012)*. Management Insight, 7 (2), pp.154-171. ISSN 1978-3884 (<http://repository.unib.ac.id> diakses pada tanggal 8 Mei 2017)
- Dhea Ayu, dan Irni Yunita. 2015. *Pembentukan Dan Perbandingan Kinerja Portofolio Optimal Menggunakan Single Index Model dan Constant Correlation Model (Studi Kasus Pada LQ45 Periode Februari 2010- Januari 2015)*. Jurnal. Universitas Telkom.
- I Putu Putra, dan Ni Ketut Purnawati. 2015. *Pembentukan Portofolio Optimal Pada Saham-Saham Di Indeks LQ45 Dengan Menggunakan Model*

Indeks Tunggal. E-Jurnal Manajemen Unud, Vol. 4, No. 12, 2015-4334-4361 ISSN : 2302-8912.

Jose Hadita. 2014. Analisis Perbandingan Kinerja Portofolio Saham-Saham *Jakarta Islamic Index* Pada Pasar *Bullish* dan *Bearish*. TAZKIA *Islamic Business and Finance Review*.

Mary J. Francis, and Rathika G. 2015. *The Single Index Model And The Construction of Optimal Portfolio With CNCPHARMA SCRIP*. *International Journal of Management (IJM)*, ISSN 0976-6502 (Print), ISSN 0976-6519 (Online), Vol 6, Issue 1, *January* 2015.

Mulat Arja'i dan Mohammad Farhan Q. 2013. Analisis Portofolio Optimal Saham Syariah Menggunakan Multi Index Models (Periode : 04 Januari 2010 – 1 Juli 2013). *Journal. FOURIER* Oktober 2013, Vol.2, No. 2129-137. UIN Sunan Kalijaga Yogyakarta.

Muruganandan S. 2013. *Performance Persistence of Indian Fund of Mutual Fund: With Special Reference to Bull and Bear Market Period*. *IOSR Journal of Economics and Finance*. e-ISSN: 2321-5933, p-ISSN: 2321-5925. [www.iosrjournals.org](http://www.iosrjournals.org) (diakses pada tanggal 7 Agustus 2017).

Ramudu P. Janaki, and Kumar Krishna. 2014. *Composite Portfolio Performance : An Investigation into Indian Mutual Funds*. *SDMIMD Journal of Management*, Vol 5, Issue 1, *March* 2014.

Suryanto. 2013. Perbandingan Kinerja Portofolio Saham Optimal Yang Dibentuk Dengan Menggunakan Model Indeks Tunggal Dan Model Korelasi Konstan Pada Indeks Pefindo25. <http://repository.unpad.ac.id/20738/1/04-perbandingan-kinerja-portofolio-saham-optimal.pdf> (diakses pada tanggal 4 Juli 2017).

Surya Darmitha, dan I.B Anom Purbawangsa. 2016. Studi Komparatif Portofolio Optimal Saham LQ 45 dan 50 *Most Active Stocks By Trading Frequency*. E-Jurnal Manajemen Unud, Vol. 5, No. 11, 2016 : 7185-7213. Universitas Udayana. Bali.

Siti Azizah, Sugito, dan Alan Prahutama. 2014. Pengukuran Kinerja Portofolio Saham Menggunakan Model Black-Litterman Berdasarkan Indeks Treynot, Indeks Sharpe, dan Indeks Jensen (Studi Kasus Saham-

Saham yang Termasuk dalam *Jakarta Islamic Index* Periode 2009-2013). *Jurnal Gaussian*, Vol. 3, No. 4, Tahun 2014, Hal 859-868. ISSN : 2339-2541. Universitas Diponegoro.

Windy, Sri, dan Maria Gorreti. 2014. Penerapan Model Indeks Tunggal Untuk Menetapkan Komposisi Portofolio Optimal (Studi Pada Saham-Saham LQ45 yang Listing di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2010-2012). *Jurnal Administrasi Bisnis*. Vol. 9 No. 1 April 2014. Universitas Brawijaya. Malang.

Venkataraman, R. and Venkatesan Thilak. 2016. *Evaluation of Growth of Mutual Funds and Exchange Traded Funds in India*. *SDMIMD Journal of Management*. Vol.7, Issue 1, March 2016.

#### **Skripsi:**

Agus Juniyanto. 2016. Analisis Portofolio Optimal Menggunakan Model Korelasai Konstan (*Constant Correlation Model*) (Studi Kasus : Saham Syariah di *Jakarta Islamic Indexs* (JII) Periode 27 Agustus 2014-26 Agustus 2015. <http://digilib.uin-suka.ac.id> (diakses pada tanggal 4 Juli 2017)

#### **Tesis:**

Debra Febiana, dan Johan Halim. 2014. Analisis Perbandingan Kinerja Portofolio Optimal Yang Dibentuk Menggunakan Single Index Model dan Multi Index Model Dalam Kondisi Pasar Bullish dan Bearish. *Thesis*. BINUS. [http://thesis.binus.ac.id/Doc/Lain-lain/Technical%20Report\\_2014\\_0080.pdf](http://thesis.binus.ac.id/Doc/Lain-lain/Technical%20Report_2014_0080.pdf) (diakses pada tanggal 12 April 2017).

Murphy John Lee. 2015. *Portfolio Performance Evaluation on Various Financial Model*. *Thesis*. *University of California*. <http://escholarship.org/ic.item.3839g8f6> (diakses pada tanggal 30 Juni 2017).

#### **Peraturan Perundang-Undangan:**

Undang-Undang No. 8 tahun 1995 Tentang Pasar Modal

**Internet:**

[www.idx.co.id](http://www.idx.co.id)

[www.bi.go.id](http://www.bi.go.id)

[www.finance.yahoo.com](http://www.finance.yahoo.com)

[www.sahamok.com](http://www.sahamok.com)

[www.duniainvestasi.com](http://www.duniainvestasi.com)

[www.investing.com](http://www.investing.com)

[www.imq21.com](http://www.imq21.com)

[www.britama.com](http://www.britama.com)

[www.infovesta.com](http://www.infovesta.com)

[www.katadata.co.id](http://www.katadata.co.id)

[www.dream.co.id](http://www.dream.co.id)

[www.infovesting.com](http://www.infovesting.com)