

## DAFTAR PUSTAKA

- Achsien, Iggi H., 2003. *Investasi Syariah di Pasar Modal: Menggagas Konsep dan Praktek Manajemen Portofolio Syariah*. PT Gramedia Pustaka Utama, Jakarta.
- Andrade, Jenifer. 2014. *Construction of Optimal Portfolio of Equity, Using Sharpe's Single Index Model: A Case Study of IT Sector*. International Journal of Advanced Research in Management and Social Sciences.
- Arsyad, Lincolin. 2010. *Ekonomi Pembangunan*. Yogyakarta: UPP STIM YKPN.
- Atta, Hajara, 2003. *Ethical Rewards: An Examination of The Effect of Islamic Ethical Screens on Financial Performance and of Conditioning Information on Performance Measures, MSc Dissertation University of Durham Bank Indonesia*. 2004. Bank Indonesia.
- Bodnar dan William. 2005. *Sistem Informasi Akuntansi*, Salemba Empat, Jakarta.
- Brigham, Eugene F. dan Houston, Joel F. 2011. *Dasar-dasar Manajemen Keuangan Terjemahan*. Edisi 10. Jakarta: Salemba Empat.
- Brown, Stephen J.; William N. Goetzmann; and Alok Kumar. 1998. *The Dow Theory: William Peter Hamilton's Track Record Reconsidered, The Journal of Finance*,.Vol. LII, No. 4, August 1998.
- Campbell, John Y. and Luis M. Viceira. 1999. *Consumption and Portfolio Decisions When Expected Returns Are Time Varying*. The Quarterly Journal of Economics, May.
- Chen, Zhiwu and Peter J. Knez. 1996. *Portfolio Performance Measurement: Theory and Applications, The Review of Financial Studies*. Summer 1996, Vol.9, No.2.
- Conover, Mitchell C.; H. Swint Friday and Shelly W. Howton. 2002. *An Analysis of the Cross Section of Returns for EREITs Using a Varying-Risk Beta Model, Real Estate Economics*. Vol 28 No. 1.
- Effendi, M. Irhas dan Muafi. 2001. *CAPM: Berbagai Kajian Terhadap Model dan Peranannya dalam Pengukuran Kinerja Portofolio*. Usahawan No. 07 Th. XXXX, Juli 2001.
- Eko, Umanto. 2008. *Analisis dan Penilaian Kinerja Portofolio Optimal Saham-Saham LQ-45*. Bisnis dan Birokrasi (Jurnal Ilmu Administrasi dan Organisasi). Volume 15, Nomor 3. Sept-Des 2008. Hlm 178-187. Universitas Indonesia.

- Elton, Edwin J. and Martin J. Gruber. 1995. *Modern Portfolio Theory and Investment Analysis 5 th Edition*. John Wiley & Sons, Inc; New York.
- Faaf, R.W. and R.D. Brooks. 1998. *Time-Varying Beta Risk for Australian Industry Portfolios: An Exploratory Analysis*. Journal of Business Finance & Accounting, 25(5)& (6), June/July 1998.
- Fabozzi, Frank J. 2000. *Manajemen Investasi*. Buku Dua. Salemba Empat, Pearson Education Asia Pte. Ltd. Prentice-Hall.
- Fock, H. J., Klein, C., & Zwergel, B. 2005. *Performance of Candlesticks Analysis on Intraday Future Data*. The Journal of Derivatives. Vol. 4 (4) pp.28-40.
- Hadita, Jose. 2014. Analisis Perbandingan Kinerja Portofolio Saham-Saham Jakarta Islamic Index Pada Pasar *Bullish dan Bearish*. E-Jurnal Manajemen Unud, Vol. 4, No. 12 ISSN 2302-8912. Universitas Udayana.
- Harmono. 1999. *Analisis Portofolio Saham untuk Menentukan Return Optimal dan Risiko Minimal (Studi Kasus di PT Bursa Efek Surabaya 1999), Simposium Nasional Akuntansi II*). Jurnal Ekonomi dan Bisnis, V.12 No.5.
- Hartono, Jogiyanto. 2003. Metode Penelitian Bisnis. Edisi Ke-6. Yogyakarta. Universitas Gadjah Mada.
- Husnan, Suad. 2004. *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas (Edisi Kedua)*. UPP AMP YKPN. Yogyakarta.
- Ibrahim, Haslindar; Zamri Ahmad and Suhaimi Shahnnon. 2002. *KLSE Syariah Index: A Study of Performance and Impact of Delisting*. Proceedings for The Fourth Annual Malaysian Finance Association Symposium.
- Jobson, J.D. and Bob M. Korkie. 1988. *The Trouble with Performance Measurement: Comment*. The Journal of Portfolio Management, Winter.
- Jogiyanto. 2003. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi (Edisi 3)*. BPF, Yogyakarta.
- Jones, Charles Parker. 2006. *Investments: Analysis and Management (5Th ed)*. John Wiley & Sons, Inc.
- Lubatkin, Michael and Sayan Chatterjee. 1994. *Extending Modern Portfolio Theory into The Domain of Corporate Diversification: Does It Apply?*. Academy of Management Journal, Vol. 37 No. 1.
- Mankiw, N. Gregory, 2000. *Pengantar Ekonomi Makro*. Ghalia Indonesia. Jakarta.

- Markowitz. 1952. *Portfolio Selection*. The Journal of Finance, Vol. 7, No. 1. (Mar., 1952), pp. 77-91.
- Mc Gowan, Jr., Henry W. Collier, Colin M. Young. 1992 . *Optimal Portfolio Selection: A Pedagogical Not*. Managerial Finance, Vol. 18 Issue: 2, pp.49-62.
- Morey, Matthew R. and Ricard C. Morey. 2000. *An Analytical Confidence Interval for the Treynor Index: Formula, Conditions and Properties*. Journal of Business Finance & Accounting, 27(1) & (2), January/March 2000.
- Natalia, Euginia, Darminto, Endang NP. 2012. *Penentuan Portofolio Saham Yang Optimal Dengan Model Markowitz Sebagai Dasar Penetapan Investasi Saham (Studi pada Perusahaan Food and Beverage yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2012)*. Universitas Brawijaya. Malang
- Pasaribu. 2013. *Pembentukan Portofolio Saham Optimal Dengan Model Indeks Tunggal Pada Saham Indeks LQ-45 Periode 2007-2012*. Jurnal Ilmiah Vol.4 No.IX. Universitas Sumatera Utara.
- Pujiani, Dewi. 2007. *Analisa Portofolio Optimal Dengan Model Indeks Tunggal Atas Saham Industri LQ45*. Journal of Business and Economics Vol.9, No.20.
- Purnawati. 2015. *Pembentukan Portofolio Optimal Pada Saham-Saham di Indeks LQ 45 Dengan Menggunakan Model Indeks Tunggal*. E-Jurnal Manajemen Unud, Vol. 4, No. 12 ISSN 2302-8912. Universitas Udayana.
- PT BEJ. 2013. [www.jsx.co.id](http://www.jsx.co.id)
- PT BEJ. 2014. BEJ Statistics
- PT BEJ. 2015. BEJ Statistics
- PT BEJ. 2016. BEJ Statistics
- PT BEJ. 2017. BEJ Statistics
- Rahmadin, Ria, Topowijono, Zahroh Z.A. 2014. *Pembentukan Portofolio Optimal Saham Berdasarkan Model Indeks Tunggal (Studi Pada Saham Indeks LQ-45 Di BEI Tahun 2011-2013)*. Jurnal Ilmu Administrasi. Universitas Brawijaya. Malang.
- Salvatore, Dominick. 2004. *Theory and Problem of Micro Economic Theory*. 3rd Edition. Alih Bahasa oleh Rudi Sitompul. Penebit Erlangga.
- Sawir, Agnes. 2004. *Analisis Kinerja Keuangan dan Perencanaan Keuangan Perusahaan*, Jakarta : PT. Gramedia Pustaka Utama.

- Silvapulle, Faaf, R.W. and R.D. Brooks. 2015. *Time-Varying Beta Risk for Australian Industry Portfolios: An Exploratory Analysis*. Journal of Business Finance & Accounting, Vol.25 No. 5-6, June-July.
- Son-Nan, Chen and Stephen J. Brown. 2015. *Estimation Risk and Simple Rules for Optimal Portfolio Selection*. The Journal Of Finance. Vol.38. No.4. American Finance Association. Pp.1087-1093.
- Solechan, Achmad . 2009. *Pengaruh Karakteristik Sistem Akuntansi Manajemen dan Desentralisasi sebagai Variabel Moderating terhadap Kinerja Manajerial (Studi Empiris Perusahaan Manufaktur di Kabupaten Semarang)*.
- Stevens, Jerry L. John M. Clinebell and Jan R Squires and. 2014. *Investment Performance Over Bull and Bear Markets: Fabozzi and Francis Revisited, Quarterly journal of Business and Economics*. Autumn, Vol. 31 No. 4.
- Subardi, Agus. 2001. *Manajemen Pengantar*. Edisi Revisi, UPP AMP YKPN, Yogyakarta.
- Sudjana. 2014. *Analisis Portofolio Menggunakan Capital Asset Pricing Model (CAPM) Untuk Penetapan Kelompok Saham-Saham Efisien (Studi pada Seluruh Saham Perusahaan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2010-2012)*. Jurnal Administrasi Bisnis Vol. 9 No. 1. Universitas Brawijaya.
- Sugiyono. 1999. *Statistika untuk Penelitian*. CV. Alfabeta, Bandung.
- Sukarno. 2007. *Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Saham Menggunakan Metode Single Index di Bursa Efek Jakarta*. Jurnal Ekonomi Bisnis Vol.2 No. 4.
- Sukirno, Sadono. 2008. *Ekonomi Pembangunan (Proses, Masalah, dan Dasar Kebijakan)*. Jakarta: Fakultas Ekonomi UI.
- Umam. 2017. *Penentuan Portofolio Optimal Dengan Metode Indeks Tunggal Di Bursa Efek Indonesia Pada BEI Periode 2012-2015*. Bisnis Indonesia, Vol. 2 No.4.
- Usman, B. 2010. *Analisis Bearish Versus Bullish Saham PT Bakrie Telecom Tbk. Pada Interval Waktu 1 Januari sampai Dengan 31 Desember 2010, dengan menggunakan Analisis Candlestick*. Perpustakaan Jurusan Manajemen.(Tidak dipublikasikan). Universitas Bengkulu.

- Tandelilin, Eduardus. 2001. *Beta pada Pasar Bullish dan Bearish: Studi Empiris di Bursa Efek Jakarta*. Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia, Vol. 16, No.3.
- Treynor, Jack L. 1965. *How to Rate Management of Investment Funds*. Harvard Business Review 43, pp. 63–75.
- Turangga, Apriyani, Dinnul Alfian. 2013. *Analisis Model Indeks Tunggal Portofolio Saham Pada Perusahaan Manufaktur Indonesia Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI)*. Jurnal Akuntansi. STIE MDP.
- Wahyudi dan Hartini. 2000. *Influence of Institutional Ownership and Size Company toward Company Policy and Corporate Value (Empirical Studies Manufacturing Companies Listed on The Indonesia Stock Exchange)*. IKIP PGRI Madiun.
- Wahyudi, Henry. 2002. *Analisis Investasi dan Penentuan Portofolio Saham Optimal di Bursa Efek Jakarta (Studi Komparatif Penggunaan Model Indeks Tunggal dan Model Random pada Saham - Saham Indeks LQ-45 Periode 1997-2000)*. Jurnal Akuntansi Keuangan. Universitas Muhammadiyah Surakarta.
- Widiastuti. 2012. *Strategi Untuk Menganalisis Kinerja Portofolio Dengan Pengujian Model Indeks Tunggal Dan Naive Diversification*. Tesis. Universitas Padjajaran.
- William F, Sharpe. 1997. *Investasi*. Edisi Bahasa Indonesia, Jilid 1, PT Prenhalindo: Jakarta.
- Yaacob, Mohd Hasimi and Noor Azuddin Yakob. 2002. *A Study on Portfolio Diversification Using Islamic-Approved Stocks in Malaysia*. Proceedings for The Fourth Annual Malaysian Finance Association Symposium.
- Yanawati dan Abundanti. 2012. *Kinerja Portofolio Saham Pada Perusahaan Manufaktur Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia*. Jurnal Ilmu Administrasi. Universitas Brawijaya. Malang.
- Yuniarti. 2010. *Pembentukan Portofolio Optimal Saham-Saham Perbankan yang Menggunakan Model Indeks Tunggal*. Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia, Vol. 2 No.7.
- Yunita, Ira dan Pratiwi. 2013. *Optimal Portfolio Construction (A Case Study of LQ45 Index in Indonesia Stock Exchange)*. International Journal of Science and Research ISSN 2319-7064. Telkom University.