

DAFTAR PUSTAKA

- Aliakur, G. J. & Triaryati, N. (2017). Kinerja portofolio optimal berdasarkan single index model. *EJurnal Manajemen Unud*, 6 (5), 25282555.
- Alwan, A. (2020). Kinerja portofolio saham syariah dan faktor yang mempengaruhi kinerja saham. *Li Falah-Jurnal Studi Ekonomi dan Bisnis Islam* 5 (1), 17-41.
- Anggraini, A. (2012). Analisis pengaruh gempa dan tsunami di Jepang terhadap saham-saham perusahaan di Bursa Efek Indonesia. *etd.repository.ugm.ac.id*.
- Anshari, M. A., & Swandari, F., & Sadikin, A., (2019). Pengaruh faktor fundamental mikro dan makroekonomi terhadap return saham. *Jurnal Wawasan Manajemen* 7 (3), 202-213.
- Ardi, A. (2016). Analisis kinerja portofolio saham dengan metode sharpe, jensen dan treynor (15 saham di Bursa Efek Indonesia periode Januari-Februari 2016). <https://www.researchgate.net/publication/309611423>.
- Basuki, A.T. & Prawoto, N. (2015). *Analisis regresi dalam penelitian ekonomi dan bisnis*. Yogyakarta: Rajawali Pers.
- Bodie, Z. & Kane, A. & Marcus, A. J. (2012). *Portfolio management (8rd. Ed)*. USA: Pearson Prentice Hall.
- Bodie, Z. & Kane, A. & Marcus, A. J. (2014). *Investment (10rd. Ed)*. USA: MC Graw Hill Education.
- Brigham, E.F. & Houston, J.F. (2018). *Fundamental of financial management: Dasar-dasar manajemen keuangan*. (14rd. Ed.). Jakarta: Salemba Empat.
- Cahyani, P. C., et.al (2021). Analisis return saham LQ45 di Bursa Efek Indonesia. *Korelasi-Konferensi Riset Nasional Ekonomi, Manajemen, dan Akuntansi* 2. 349-361.
- Darmadji, T., & Fakhrudin. (2012). *Pasar modal di Indonesia (3rd. Ed)*. Jakarta: Salemba Empat.
- Darmawan, I. P. P. A & Purnawati, N. K. (2015). Pembentukan portofolio optimal pada saham-saham di indek LQ45 dengan menggunakan single index model. *Jurnal Manajemen Unud* 4 (12), 43354361.
- Darmayanti, N.P.A., et. al (2018). Perbandingan kinerja reksa dana saham dengan metode sharpe, treynor, dan jensen. *JREB* 11 (2), 93 – 107.
- Daryanto (2010). Analisis pengaruh rasionalitas investor terhadap pemilihan saham dan penentuan portofolio optimal model indeks tunggal di BEI. UMS. *B200060052*.
- Davesta, R. (2015) Pengaruh risiko sistematis dan likuiditas saham terhadap *return* saham pada industri pertambangan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode tahun 2010-2012.
- Djajadi, I. (2021). *IDX Stock index handbook v1.2*. Jakarta: BEI.

- Elton, J. E. & Gruber, M. J & Brown, S. J. & Goetzmann, W. N. (2014). *Modern portfolio theory and investment analysis*. USA: John Wiley & Sons. Inc.
- Evirrio, S., et.al (2018). Pengaruh risiko sistematis dan risiko tidak sistematis terhadap expected return portofolio optimal. Universitas Brawijaya Malang. *evirrio@gmail.com*.
- Fahmi, I. (2018). *Buku pengantar teori portofolio dan analisis investasi*. Bandung: Alfabeta
- Firmansyah, A. F. & Astawinetu, E. D. (2019). Analisis portofolio optimal dengan menggunakan Single Index Model pada saham IDX BUMN20 di Bursa Efek Indonesia Januari 2018 - Januari 2019. *Jurnal Ekonomi Manajemen (JEM17) 4 (2)*, 3146
- Ghozali, I. (2011). *Aplikasi analisis multivariate dengan program SPSS*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Gunawan, O. V. & Artini, L. G. S. (2016). Pembentukan portofolio optimal dengan pendekatan single index model pada saham LQ45 di Bursa Efek Indonesia. *EJurnal Manajemen Unud 5 (9)*, 55545584.
- Halim, A. (2015). *Analisis investasi di aset keuangan (1rd. Ed)*. Jakarta: Mitra Wacana Media.
- Hartono, J. (2017). *Teori portofolio dan analisis investasi (11rd. Ed)*. Yogyakarta: BPFE-YOGYAKARTA.
- Horne, J.C.V., & Wachowicz, J.M. (2012). *Financial management and policy: Prinsip-prinsip manajemen keuangan*. Jakarta: Salemba Empat.
- Husnan, S. (2015). *Dasar-dasar teori portofolio dan analisis sekuritas*. Yogyakarta: UPPN STIM YKPN.
- Jones, C.P. (2010). *Investments principles and concepts (12rd. Ed.)*. Singapore: John Wiley & Sons.
- Kamaludin & Indriani, R. (2012). *Manajemen keuangan: Konsep dasar dan penerapannya (Rev. Ed.)*. Bandung: Mandar Maju.
- Kulsum, U. (2016). Analisis portofolio saham optimal bank-bank yang tercatat pada LQ45 dengan pendekatan single index model. *Jurnal Ekonomi Bisnis 21 (2)*, 136144.
- Kurniawan, A. W. & Puspitaningtyas, Z. (2016). *Metode penelitian kuantitatif*. Yogyakarta: Pandiva Buku.
- Lal, K. & Rao, S.R.S. (2016). Selecting an optimal portfolio for investment in stocks in India: A sectoral approach. *Pacific Business Review International, 8 (9)*, 109115.
- Lestari, F. & Yunita, I. (2019). Analisis investasi portofolio saham optimal pada sektor perbankan menggunakan metode single index model dan capital asset pricing model (CAPM). *eProceeding of Management 6 (1)*, 115121.
- Lubis, T. A. (2016). *Manajemen investasi dan perilaku keuangan: Pendekatan teoritis dan empiris*. Jambi: Salim Media Indonesia (SMI)

- Lubis, Y. & Hermanto, B., & Edison, E. (2018). *Manajemen dan riset sumber daya manusia*. Bandung: Alfabeta
- Mandal, N. (2013). Sharpe's single index model and it's application to construct optimal portofolio: An empirical study. *YaleGreat Lakes Center for Management Research*, 7 (1), 160
- Milliondry, H.D. (2018). Analisis portofolio optimal perusahaan yang terdaftar di LQ45 Bursa Efek Indonesia. *Yogyakarta: UII*
- Mulyana, D. (2020). *Materi kuliah: Analisis investasi dan manajemen risiko*. Tasikmalaya: Universitas Siliwangi.
- Mulyana, D. (2020). *Materi kuliah: Sistem informasi keuangan, pasar uang & modal*. Tasikmalaya: Universitas Siliwangi.
- Mulyati, S. & Murni, A. (2018). Analisis investasi dan penentuan portofolio saham optimal dengan metode indeks tunggal (Studi empiris pada IDX30 yang terdaftar di di Bursa Efek Indonesia periode Agustus 2017 - Januari 2018). *Jurnal Akuntansi dan Keuangan* 6 (2), 23014717.
- Munawaroh. Yuniarti, D. & Hayati, M.N. (2015). Analisis regresi variabel mediasi dengan metode kausal step (Studi kasus: Produk Domestik Regional Bruto (PDRB) Perkapita di Provinsi Kalimantan Timur Tahun 2011-2013). *Jurnal Eksponensial* 6 (2), Nopember 2015, ISSN 2085-7829, 193-199.
- Nurhaliza, S. (2021). *Risiko investasi saham*. <https://www.idxchannel.com/market-news/risiko-investasi-saham>
- Oktaviana, R. (2019). Analisis perbandingan pembentukan portofolio saham optimal menggunakan model markowitz dan indeks tunggal sebagai dasar dalam pengambilan keputusan investasi (Studi kasus pada perusahaan LQ45 yang terdaftar dalam Bursa Efek Indonesia periode 2013-2017). *Jogyakarta: FE UII*.
- Pratama, L. A. (2019). Analisis pembentukan portofolio saham optimal menggunakan metode single index model (Studi empiris pada saham indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia). *Jogyakarta: FE UNY*.
- Prayogo, E. (2017). Analisis kinerja portofolio saham dengan metode sharpe dan metode treynor. *Akurat Jurnal Ilmiah Akuntansi* 8 (3), 100-113. 2086-4159.
- Qur'anitasari & Hidayat, R. R. & Sulasmiyatiet, S. (2016). Analisis pembentukan portofolio optimal dalam meminimalkan tingkat risiko investasi dengan menggunakan single index model (Studi kasus saham LQ45 di BEI periode Januari 2013-Juli 2015). *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB)* 31 (1), 140149.
- Robbins, S. P. & Coulter, M. (2014). *Manajemen (13rd. Ed)*. Jakarta: Erlangga
- Rosana, V., & Situmorang, M., & Maimunah, S., (2018). Pengaruh price earning ratio (PER) dan economic value added (EVA) terhadap return saham pada perusahaan sub sektor minyak dan gas bumi yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2012-2016. FE Unpak. vidiarossana@gmail.com.

- Samsul, M. (2015). *Pasar modal dan manajemen portofolio (2rd. Ed.)*. Jakarta: Erlangga.
- Saputri, R. I. (2018). Analisis pengaruh CAR, NIM, BOPO dan LDR terhadap return saham pada perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode tahun 2011 sampai dengan tahun 2015. *Jurnal Ekobis Dewantara 1* (1), 149 – 158.
- Saraswati, H. (2020). Dampak pandemi covid19 terhadap pasar saham di Indonesia. *JAD: Jurnal Riset Akuntansi dan Keuangan Dewantara 3* (2), 153 – 163.
- Sari, D.P. (2020). Pengaruh current rasio (CR), return on equity (ROE) earning per share (EPS), net profit margin (NPM) terhadap return saham pada perusahaan Perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2015-2019. *Palembang: STIE Multi Data*.
- Sari, F. A. & Nuzula, N. F. (2017). Pembentukan portofolio optimal dengan single index model (Studi pada perusahaan property, real estate and building construction yang tercatat di Bursa Efek Indonesia periode 2013-2015). *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB) 45* (1), 19.
- Sarker, M.R. (2013). Optimal portfolio construction: Evidence from Dhaka Stock Exchange in Bangladesh. *World Journal of Social Sciences 3* (6), 7587.
- Setyarini, N. L. P. D. S. & Rahyuda, H. (2017). Pengaruh kinerja keuangan terhadap return saham perusahaan perbankan di Bursa Efek Indonesia (BEI). *EJurnal Manajemen Unud 6* (1), 55525579.
- Setyoningsih & Tri, A. & Suhadak & Topowijono. (2015). Analisis portofolio optimal dengan single index model untuk meminimumkan risiko bagi investor di Bursa Efek Indonesia (Studi pada saham indeks Kompas 100 periode Februari 2010-Juli 2014). *Jurnal Administrasi Bisnis 23* (1), 19.
- Shiyammurti, N. R. & Saputri, D. A. & Syafira, E. (2020). Dampak pandemi covid19 di PT. Bursa Efek Indonesia (BEI). *Journal of Accounting Taxing and Auditing (JATA) 1* (1), 15.
- Silalahi, E. & Evelin. (2020). Faktor-faktor yang mempengaruhi return saham pada sektor Perbankan yang go publik di Bursa Efek Indonesia. *JRAK 6* (2), 271288.
- Sugiyono. (2016). *Metode penelitian: Kuantitatif, Kualitatif, dan R&D*. Bandung: Alfabeta
- Sujarweni, V. W. (2014). *Metode penelitian: Lengkap, praktis, dan mudah dipahami*. Yogyakarta: Pustaka Baru Press.
- Sulistiani, R. D. & Topowijono & Gorreti, M. (2017). Analisis pembentukan portofolio optimal saham berdasarkan metode single index model (Studi pada saham perusahaan yang tercatat dalam indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia tahun 2012-2016). *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB) 51* (2), 7684.
- Suriyani, N. K. & Sudiarta, G. M. (2018). Pengaruh tingkat suku bunga, inflasi dan nilai tukar terhadap return saham di Bursa Efek Indonesia. DOI: <https://doi.org/10.24843/EJMUNUD.2018.v7.i06.p12>.

- Suroto. (2015). Analisis portofolio optimal menurut single index model (Studi empiris pada saham LQ45 di Bursa Efek Indonesia periode Agustus 2012- Juli 2015). *Media Ekonomi dan Manajemen* 30 (2), 161177.
- Susilowati, D. & Juwari & Noviadinda. Analisis kinerja portofolio saham dengan menggunakan metode indeks sharpe, treynor, dan jensen pada kelompok saham indeks SriKehati di Bursa Efek Indonesia. DOI: doi.org/10.36277/geoekonomi.
- Sutrisno. (2017). *Manajemen keuangan: Teori konsep dan aplikasi (Rev. Ed.)*. Yogyakarta: Ekonesia
- Tandelilin, E. (2017). *Pasar modal: Manajemen portofolio & investasi*. Yogyakarta: BPFE.
- Utamayasa, K. N. & Wiagustini, N. L. P. (2016). Penentuan portofolio optimal dengan menggunakan single index model pada saham perbankan di Bursa Efek Indonesia. *EJurnal Manajemen Unud* 5 (6), 39053933.
- Wahyuni, K. T. (2018). Analisis perbandingan kinerja portofolio berdasarkan price earning ratio di Bursa Efek Indonesia. UMD. komangtriyunik@gmail.com.
- Wira (2017). Menghitung rata-rata: Aritmatik vs geometrik. <https://wsjay.wordpress.com/2017/03/08/menghitungratarataaritmatikvsgeometrik/>.
- Wulandari, L. P. F. & Sedana, P. & Purbawangsa, A. (2016). Kinerja portofolio saham optimal di Bursa Efek Indonesia (Berdasarkan single index model dan stochastic dominance). *EJurnal Ekonomi dan Bisnis Universitas Udayana* 5 (9), 28372862
- Yanawati, N. W. P., & Abundanti, N. (2014). Kinerja portofolio saham pada perusahaan Manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Unud. putriimuthea@yahoo.com.
- Yusuf, A.M. (2014). *Metode penelitian kuantitatif, kualitatif & penelitian gabungan*. Jakarta: Prenadamedia Group.
- Zubir, Z. (2011). *Manajemen portofolio: Penerapannya dalam investasi saham*. Jakarta: Salemba Empat.
- Zulfiani, R. (2018). Analisis pembentukan portofolio optimal dengan menggunakan single index model pada investasi saham. Makassar: UIN.
- <https://www.idx.co.id>
- <https://finance.yahoo.com>
- <https://www.bi.go.id>
- <https://www.microsoft.com>