

## DAFTAR PUSTAKA

- Agus, I. K., Swara, A., & Dana, I. M. (2020). *Study of Optimal Portfolio Performance Comparison: Single Index Model and Markowitz Model on LQ45 Stocks in Indonesia Stock Exchange. American Journal of Humanities and Social Sciences Research (AJHSSR)*, 4(12), 237–244.
- Aliani, D. B. A. *Analisis perbandingan pembentukan portofolio optimal dari saham-saham indeks bisnis 27 dengan menggunakan metode single index model (sim) & capital asset pricing model (capm) periode november 2012–april 2017* (Bachelor's thesis, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah Jakarta).
- Archana, H. N. (2020). *Building An Optimal Portofolio Using Sharpe's Single Index Model: An Empirical Study With Refrence To Indian Capital Markets . Journal of Xi'an University of ARchitecture and Technology*, XII(Viii), 1233–1244.
- Ayuni, N. (2020). *Analisis Optimalisasi Portofolio Saham Syariah Menggunakan Single Index Model* (Doctoral dissertation, UIN Raden Intan Lampung).
- Azizah, L., Topowijono, T., & Sulasmiyati, S. (2017). *Analisis Investasi Portofolio Optimal Saham Syariah dengan Menggunakan Markowitz dan Single Index Model (Studi Pada Saham Perusahaan Yang Terdaftar Di Jakarta Islamic Index (JII) Periode Desember 2012- Mei 2015)*. *Jurnal Administrasi Bisnis S1 Universitas Brawijaya*, 42(1), 11–20.
- Chasanah, S. I. U., Abdullah, S., Valentika, N., Kiftiyani, U., & Nuha, A. R. (2020). *Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Saham-Saham Jakarta Islamic Index (Jii) Pada Masa Pandemi Covid-19*. *Jurnal Saintika Unpam: Jurnal Sains Dan Matematika Unpam*, 3(1), 52.
- Febryan, A. (2019). *Analisis Perbandingan Pembentukan Portofolio Optimal Saham dengan Menggunakan Single Index Model dan Capital Asset Pricing Model Pada Indeks Saham LQ-45 Periode 2016- 2018* (Doctoral dissertation, Universitas Pembangunan Nasional Veteran Jakarta).
- Kurniawan, A.W & Puspitaningtyas, Z. (2016). *Metode Penelitian Kuantitatif*. Yogyakarta: *Pandiva Buku*
- Manurung, A.H. (2015). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Universitas Terbuka: Tangerang Selatan.
- Manurung, H. (2019). *Analisis Kinerja Portofolio Saham dengan Menggunakan Metode*

- Sharpe, Jensen dan Treyno. *Journal of Business Studies*, 4(1), 1-16.
- Markowitz, H. (1991). *Foundations of Portofolio Theory*. *The Journal of Finance*, 469-477
- Markowitz, H. (1999). *The Early History of Portfolio Theory : 1600-1960*. *Financial Analysts Journal*, 55 (4), 5-16.
- Mubarak, F. K., Darmawan, A. R., & Luailiyah, Z. (2017). *Optimalisasi Portofolio Nilai Saham: Studi Komparasi Kinerja Saham Syariah dan Nonsyariah*. *Economica: Jurnal Ekonomi Islam*, 8(2), 309–336.
- Murthy, J. (2018). *The construction of optimal portfolio using sharpe's single index model-an empirical study on nifty metal index*. *JIMS8M: The Journal of Indian Management & Strategy*, 23(4), 4.
- Nurlaeli, S., & Artati, D. (2020). *Analisis Kinerja Portofolio Saham dengan Metode Sharpe, Treynor, dan Jensen*. *Jurnal Ilmiah Mahasiswa Manajemen, Bisnis Dan Akuntansi (JIMMBA)*, 2(6), 972-990.
- Nurmatias, N., & Yetty, F. (2020, January). *Analysis Of Optimum Stock Portfolio Using The Single Index Model (Empirical Study: Bisnis-27 and JII Stocks)*. In *Konferensi Riset Nasional Ekonomi, Manajemen, dan Akuntansi I*.
- Oktaviani, B. N., & Wijayanto, A. (2016). *Aplikasi single index model dalam pembentukan portofolio optimal saham LQ45 dan Jakarta islamic index*. *Management Analysis Journal*, 5(3).
- Reza, M. K., Yuliniar, & Simarmata, P. (2020). *Prosiding biema. Business Management, Economic, and Accounting National Seminar*, 1(1), 1059–1076.
- Ranteallo, A.T., & Herawati, N. (2019) *Analisis Pembentukan Portofolio Optimal dengan Model Indeks Tunggal pada Saham-saham Indeks Kompas 100 di Bursa Efek Indonesia Periode Februari 2016- Januari 2019*. *Aksara Public*, 3(4), 48-64.
- S.SUBASHREE, M. B. (2017). *Construction of Optimal Portfolio Using Sharpe ' S Single Index Model - a Study With Reference To Banking and Automobile Sectors*. *Asia Pacific Journal of Research*, 1(17), 232–237.
- Suteja, J., & Gunardi, A. (2016). *Manajemen Investasi dan Portofolio*. Bandung: PT Refika Aditama.
- Jones, C.P. (2019). *Investasi Prinsip dan Konsep*. Salemba Empat: Jakarta
- Setyowati, E. I., & Husnurrosyidah, H. (2021). *CAPM, Indeks Tunggal dan Treynor*

*Sebagai Analisis Portofolio Pada Saham Syariah. KEUNIS, 9(1), 63-84.*

Shadabfar, M., & Cheng, L. (2020). *Probabilistic approach for optimal portfolio selection using a hybrid Monte Carlo simulation and Markowitz model. Alexandria Engineering Journal, 59(5), 3381–3393.*

Tandelilin, Eduardus. 2010. *Portofolio dan Investasi*. Yogyakarta: Kanisius

Utomo, T. Y., Topowijono, T., & Zahroh Z A, Z. Z. (2016). *Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Dengan Model Indeks Tunggal Dalam Pengambilan Keputusan Investasi (Studi Pada Jakarta Islamic Index Periode Desember 2013-mei 2015)*. *Jurnal Administrasi Bisnis, 39(1), 51-57.*

Yuliansyah, F. (2017). *Perbandingan Pembentukan Portofolio dengan Menggunakan Metode Indeks Tunggal dan Capital Asset Pricing Model (CAPM) (studi pada saham Jakarta Islamic Index (JII) periode 2013-2016)*. 35

**Putri Anastasya, 2022**

***ANALISIS PEMBENTUKAN PORTOFOLIO OPTIMAL MENGGUNAKAN SINGLE INDEX MODEL  
DAN CAPM PADA JAKARTA ISLAMIC INDEX 70 (JII 70)***

UPN Veteran Jakarta, Fakultas Ekonomi dan Bisnis, S1 Manajemen  
[ [www.upnvj.ac.id](http://www.upnvj.ac.id)-[www.library.upnvj.ac.id](http://www.library.upnvj.ac.id)-[www.repository.upnvj.ac.id](http://www.repository.upnvj.ac.id)]