

## DAFTAR PUSTAKA

- Tandelilin, E. (2017). Pasar Modal Manajemen Portofolio dan Investasi, Edisi Elektronik. Yogyakarta: Kanisius
- Hartono, J. (2015). Teori Portofolio dan Analisis Investasi, Edisi Kesepuluh. Yogyakarta: BPF – Yogyakarta.
- Hartono, J. (2017). Teori Portofolio dan Analisis Investasi, Edisi Kesebelas. Yogyakarta: BPF – Yogyakarta.
- Samsul, M. (2015). Pasar Modal dan Manajemen Portofolio, Edisi Kedua. Jakarta: Erlangga.
- Fahmi, I. (2015). Manajemen Investasi Teori dan Soal Jawab, Edisi Kedua. Jakarta: Salemba Empat.
- Purwanto, dan Sumarto, A. H. (2017). Manajemen Investasi. Jakarta: Mitra Wacana Media
- Brigham, E. F., dan Houston, F. J. (2013). Dasar-Dasar Manajemen Keuangan. Jakarta: Salemba Empat
- Husnan, S. (2015). Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas. Yogyakarta: UPP STIM YKPN
- Yahoo Finance. (2019). Data Harga Penutupan Saham Jakarta Islamic Index (JII). Diakses 2 Maret 2019, dari <https://finance.yahoo.com/quote/%5EJKII?p=^JKII&.tsrc=fin-srch>.
- Bursa Efek Indonesia (2019). Data Profil Saham Jakarta Islamic Index (JII) Diakses 2 Maret 2019, dari <https://www.idx.co.id/idx-syariah/indeks-saham-syariah/>.
- Oktaviani, B. N., dan Wijayanto, A. (2015). *Aplikasi Single Index Model dalam Pembentukan Portofolio Optimal Saham LQ45 dan Jakarta Islamic Index*. Management Analysis Journal, Volume 4, hlm. 189-202.
- Aldrifisia, C., Yoza, H., dan Devianto, D. (2018). *Penggunaan Capital Asset Pricing Model dalam Menentukan Ekspektasi Return pada Saham LQ45*. Jurnal Matematika UNAND, Volume VII, hlm. 17-24.

- Suhartono, A., Sugito, dan Rahmawati, R. (2015). *Analisi Kinerja Portofolio Optimal Capital Asset Pricing Model (CAPM) dan Model Black Litterman*, Jurnal Gaussian, Volume 4, hlm. 421-429.
- Indra, Afrida Yetti. (2018). *Perbandingan Keakuratan Metode Capital Asset Pricing Model dan Arbitrage Pricing Theory dalam Memprediksi Return Saham (Studi pada Perusahaan Sektor Barang Konsumsi dan Sektor Pertambangan yang Tedaftar di Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI) Periode 2013-2016)*, Journal of Economic Business and Accounting, Volume 1, hlm. 233-240.
- Arimarista, L. (2017). *Expected Return dan Risiko Saham LQ-45 untuk Pengambilan Keputusan Investasi serta Pembentukan Portofolio Optimal (Capital Asset Pricing Model)*, Journal of Accounting Science, Volume 1, hlm. 62-70.
- Pradana, D. C., Maruddani, D. A. I., dan Yasin, H. (2015). *Penggunaan Simulasi Monte Carlo untuk Pengukuran Value at Risk Aset Tunggal dan Portofolio dengan Pendekatan Capital Asset Pricing Model sebagai Penentu Portofolio Optimal (Studi kasus: Index Saham Kelompok Sminfra18)*, Jurnal Gaussian, Volume 4, hlm. 765-774.
- Yunita, I. (2018). *Markowitz Model dalam Pembentukan Portofolio Optimal (Studi Kasus pada Jakarta Islamic Index)*, Jurnal Manajemen Indonesia, Volume 1, hlm. 77-85.
- Wibisono, D. A., dan Handayani, K. (2017). *Pemilihan Saham yang Optimal Menggunakan Capital Asset Pricing Model (CAPM)*, Jurnal Manajemen dan Kewirausahaan, Volume 5, hlm. 32-46.
- Sevanya, A. D. P., dan Abriandi. (2017). *Pembentukan Portofolio Optimal dengan Menggunakan Capital Asset Pricing Model pada Saham yang Tergabung dalam Indeks LQ45 Bursa Efek Indonesia Periode 2011-2015*, Jurnal Bisnis dan Komunikasi, Volume 4, hlm. 93-101.  
hlm. 77-85.