

## DAFTAR PUSTAKA

- Ahmad, K. (2013). *Dasar-Dasar Manajemen Investasi dan Portofolio*, Edisi Revisi, Jakarta: Rineka Cipta.
- Bank Indonesia. (2017). Sertifikat Bank Indonesia. Diakses 3 Juni 2017, dari <http://www.bi.go.id/id/moneter/bi-rate/data/Default.aspx>.
- Bodie, Z., Kane, A., dan Marcus, A. J. (2016). *Manajemen Portofolio Analisis dan Investasi*, (Romi Bhakti Hartarto dan Zuliani Dalimunthe, Penerjemah), Jakarta : Salemba Empat.
- Burganova, R.A., Novak, V.V., and Salahieva, M.F. (2014). *Analysis of Using Capital Asset Pricing Model for Assessing Companies Return, Mediterranean. Journal of Social Sciences, MCSER Publishing, Rome-Italy*, November 2014, Vol. 5, No. 24, ISSN 2039-2117, ISSN 2039-9340.
- Bursa Efek Indonesia. (2017). Performa Indeks Saham. Diakses 18 Mei 2017, dari <http://www.idx.co.id/id-id/beranda/publikasi/lq45.aspx>.
- Dunia Investasi. (2017). Daftar Harga Penutupan Saham. Diakses 3 Juni 2017, dari [www.duniainvestasi.com](http://www.duniainvestasi.com).
- Fahmi, I. (2012). *Manajemen Risiko*, Edisi ke-1, Bandung: Alfabeta.
- Fahmi, I. (2014). *Manajemen Keuangan Perusahaan dan Pasar Modal*, Edisi ke-1, Jakarta : Mitra Wacana Media.
- Fahmi, I. (2015). *Pengantar Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, Edisi ke-1, Jakarta : Alfabeta.
- Husnan, S. (2015). *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*, Edisi ke-5, Yogyakarta : UPP STIM YKPN.
- Ikhsan, A., Ispriyanti, D., dan Rahmawati, R. (2014). Penggunaan Pendekatan *Capital Asset Pricing Model* dan *Metode Variance-Covariance* Dalam Proses Manajemen Portofolio Saham (Studi Kasus: Saham-Saham Kelompok Jakarta Islamic Index), *Jurnal Gaussian*, Volume 3, Nomor 1, hlm. 21-30, ISSN 2339-2541.

- Jogiyanto, I. (2015). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, Edisi ke-10, Yogyakarta : BPEE.
- Kasmir. (2011). *Bank dan Lembaga Keuangan Lainnya*, Jakarta: Raja Grafindo Persada.
- Lee, H.S., Cheng F.F., and Chong S.C. (2016). *Markowitz Portfolio Theory and Capital Asset Pricing Model for Kuala Lumpur Stock Exchange: A Case Revisite*, International Journal of Economics and Financial Issues, hlm. 59-65, ISSN: 2146-4138.
- Maitah, M., Khudoykulov, K., Amonov, K., and Burkhanov, U. (2015). *Verifying Capital Asset Pricing Model in Greek Capital Market Asian Social Science*, Vol. 11, No. 16, ISSN 1911-2017.
- Pradana, D.C., Maruddani D.A., dan Yasin, H. (2015). Penggunaan Simulasi *Monte Carlo* untuk Pengukuran *Value at Risk* aset tunggal dan portofolio dengan pendekatan *Capital Asset Pricing Model* (Studi Kasus: Index Saham Kelompok SMinfra18), Volume VI, No. 1-2, Jurnal Gaussian, Volume 4, Nomor 4, hlm 765-774, ISSN 2339-2541.
- Purba, Sudarno, M., dan Mukid, M.A. (2014). Optimalisasi Portofolio Menggunakan *Capital Asset Pricing Model (CAPM)* dan *Mean Variance Efficient Portfolio (MVEP)* (Studi Kasus: Saham-Saham LQ45), Jurnal Gaussian, Volume 3, Nomor 3, hlm 481 – 490 ISSN: 2339-2541.
- Saham OK. (2017). Daftar Harga Penutupan Saham. Diakses 3 Juni 2017, dari [www.sahamok.com](http://www.sahamok.com).
- Samsul, M. (2015). *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*, Jakarta : Erlangga.
- Shah, C.A. (2015). *Construction of Optimal Portfolio Using Sharpe Index Model & Camp for BSE Top 15 Securities*, Volume 2, ISSN 2349-5138.
- Setiawan, H. (2010). *Analisis Investasi dalam Menentukan Portofolio Optimal di BEJ*, Jurnal Wacana, Vol. 13, No. 4, Oktober 2010, ISSN 1411-0199.
- Sitanggang, J.P. (2014). *Manajemen Keuangan Perusahaan (Dilengkapi Soal dan Penyelesaiannya)*, Jakarta: Mitra Wacana Media.
- Sugiartawan, P., Ramantha, dan Susrusa. (2013). *Analisis Portofolio Saham Perusahaan Agribisnis di Bursa Efek Indonesia*, Jurnal Manajemen Agribisnis, Vol. 1, No.1, Mei 2013, ISSN 2355-0759.

Suhartono, A., Sugito, dan Rahmawati, R. (2015). Analisis Kinerja Portofolio Oprimial *Capital Asset Pricing Model* (CAPM) dan Model *Black Litterman*, Jurnal Gaussian, Volume 4, Nomor 3, hlm. 421-429, ISSN: 2339-2541.

Sunariyah. (2010). Pengantar Pengetahuan Pasar Modal, edisi ke-6, Yogyakarta: UPP-AMP YKPN.

Tandelilin, I. (2010). *Teori Portofolio dan Pasar Modal*, Edisi ke-1, Jakarta : Mitra Wacana Media.

Zubir, Z. (2013). *Manajemen Portofolio Penerapannya dalam Investasi Saham*, Jakarta : Salemba Empat.

