

DAFTAR PUSTAKA

- Andriyani, L., Farida, & Machfiroh, D. L. (2016). Analisis Komparatif Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Capital Asset Pricing Model Dan Stochastic Dominance. *Jurnal Analisis Bisnis & Ekonomi*, 19-33.
- Aningtya, R., & Jubaedah. (2015). Pengaruh EPS, Proceeds, Serta Reputasi Underwriter Terhadap Underpricing. *Ekonomi dan Bisnis*, 105-118.
- Apriyanti, V., & Supandi, E. D. (2019). Perbandingan Model Capital Asset Pricing Model (CAPM) dan Liquidity Adjusted Capital Asset Pricing Model (LCAPM) Dalam Pembentukan Portofolio Optimal Saham Syariah. *Media Statistika*, 86-99.
- Arifin, N. R., Nugroho, T., & Sukmana, R. (2019). Pemilihan Saham Syariah yang Efisien untuk Pembentukan Portofolio Optimal. *Jurnal Ilmiah Ekonomi Islam*, 307-316.
- Arimarista, L. (2017). Expected Return Dan Risiko Saham LQ45 Untuk Pengambilan Keputusan Investasi Serta Pembentukan Portofolio Optimal (Capital Asset Pricing Model). *Journal of Accounting Science*, 62-70.
- Astuti, S. P., & Aziz, A. (2015). Pengaruh Profitabilitas, Investment Opportunity Set, Dan Cash Ratio Terhadap Dividen Kas. *Ekonomi dan Bisnis*, 137-142.
- Aziah, L. R., Tandika, D., & Nurdin. (2017). Analisis Perbandingan Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Single Index Model dan Markowitz Model Saham-Saham JII di Bursa Efek Indonesia. *Prosiding Manajemen*, 435-440.
- Azizah, L. H., Topowijono, & Sulasmiyati, S. (2017). Analisis Investasi Portofolio Optimal Saham Syariah Dengan Menggunakan Model Markowitz Dan Single Index Model (Periode Desember 2012 - Mei 2015). *Jurnal Administrasi Bisnis*, 11-20.
- Azmi, A. C., Ab Aziz, N., Non, N., & Muhammad, R. (2016). Sharia Disclosures: An Exploratory Study from The Perspective of Sharia-Compliant Companies and Professional Users. *Journal of Islamic Accounting and Business Research*, 1-19.
- Breeden, D. T., Gibbons, M. R., & Litzenberger, R. H. (1989). Empirical Test of The Consumption-Oriented CAPM. *The Journal of Finance*, 231-262.
- Carhart, M. M. (1997). On Persistence in Mutual Fund Performance. *The Journal of Finance*, 57-82.
- Chevallier, J., & Vo, D. T. (2018). Portfolio Allocation Across Variance Risk Premia. *The Journal of Risk Finance*, 556-593.

- Darmawan, D. (2014). *Metode Penelitian Kuantitatif*. Bandung: PT Remaja Rosdakarya.
- Desiana, L. (2017). Pengaruh PER, EPS, DYR, DPR, BVS, dan PBV Terhadap Harga Saham Perusahaan Subsektor Makanan dan Minuman yang Terdaftar Pada Jakarta Islamic Index (JII). *I-Finance*, 199-212.
- Evirrio, S., Azizah, D. F., & Nurlaily, F. (2018). Pengaruh Risiko Sistematis Dan Risiko Tidak Sistematis Terhadap Expected Return Portofolio Optimal. *Jurnal Administrasi Bisnis*, 210-216.
- Fama, E. F., & French, K. R. (1992). The Cross-Section of Expected Stock Returns. *The Journal of Finance*, 427-465.
- Fama, E. F., & French, K. R. (2015). A Five-Factor Asset Pricing Model. *Journal of Financial Economics*, 1-22.
- Fauzi, A., & Nurmatias. (2015). Pengaruh Profitabilitas Dan Leverage Terhadap Nilai Perusahaan Dengan Kebijakan Dividen Sebagai Variabel Intervening Pada Perusahaan yang Terdaftar Di BEI Tahun 2013. *Ekonomi dan Bisnis*, 177-202.
- Ibnas, R., Irwan, M., & Marif, M. A. (2017). Implementasi Metode Markowitz Dalam Pemilihan Portofolio Saham Optimal. *Jurnal Matematika dan Statistika*, 34-42.
- Kartika, A. P., Jubaedah, & Yetti, F. (2017). Analisis Efficient Market Hypothesis Pada Bursa Efek Indonesia Terhadap Pasar Saham ASEAN. *SAR (Soedirman Accounting Review)*, 128-145.
- Kim, H., Sohn, T., & Youn, H. (2018). The Portfolio Management With Islam Equity In Korea Stock Market. *Journal of Management and Economics Research*, 1-16.
- Landsman, Z., Makov, U., & Shushi, T. (2018). A Generalized Measure for The Optimal Portfolio Selection Problem and Its Explicit Solution. *Risks*, 1-15.
- Markowitz, H. M. (1952). Portfolio Selection. *The Journal of Finance*, 77-91.
- Markowitz, H. M. (1991). Foundations of Portfolio Theory. *The Journal of Finance*, 469-477.
- Marsono, A. D. (2016). Nilai Bisnis Saham Syariah dan Portofolio Optimal. *Jurnal Syarikah: Jurnal Ekonomi Islam*, 168-179.
- Merton, R. C. (1973). An Intertemporal Capital Asset Pricing Model. *Econometrica*, 867-887.
- Mubarok, F. K., Darmawan, A. R., & Luailiyah, Z. (2017). Optimalisasi Portofolio Nilai Saham (Studi Komparasi Kinerja Saham Syariah dan Nonsyariah). *Economica: Jurnal Ekonomi Islam*, 309-336.

- Nurria, R., & Jubaedah. (2017). Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi Struktur Modal Pada Perusahaan Manufaktur Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia. *Sustainable Competitive Advantage (SCA)*, 519-530.
- Oktaviani, B. N., & Wijayanto, A. (2016). Aplikasi Single Index Model Dalam Pembentukan Portofolio Optimal Saham LQ45 dan Jakarta Islamic Index. *Management Analysis Journal*, 189-202.
- Pangestuti, D. C., & Hamidi, A. (2016). Pengaruh Faktor Fundamental Perusahaan Terhadap Harga Saham Di Bursa Efek Indonesia. *Ekonomi dan Bisnis*, 1-14.
- Prasetyo, Y. (2018). Perbandingan Risiko dan Return Investasi Pada Indeks LQ45 Dengan Indeks Jakarta Islamic Index (JII). *el-Jizya; Jurnal Ekonomi Islam*, 311-334.
- Prastika, T., & Pinem, D. B. (2015). Pengaruh Return On Equity, Leverage Dan Sales Growth Terhadap Kebijakan Dividen Perusahaan Pada Perusahaan Go Public Di Bursa Efek Indonesia Tahun 2013. *Ekonomi dan Bisnis*, 155-166.
- Putra, S. D., & Jubaedah. (2016). Pengaruh Likuiditas Dan Kualitas Aset Terhadap Pertumbuhan Laba Pada Bank Umum yang Terdaftar Di BEI Tahun 2013-2015. *Ekonomi dan Bisnis*, 83-96.
- Quranasari, Hidayat, R. R., & Sulasmiyati, S. (2016). Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Dalam Meminimalkan Tingkat Risiko Investasi Dengan Menggunakan Model Indeks Tunggal. *Jurnal Administrasi Bisnis*, 140-149.
- Resti, A. A., Purwanto, B., & Ermawati, W. J. (2018). Pengaruh Kebijakan Dividen Dan Investment Opportunity Set (IOS) Terhadap Kinerja Perusahaan Pada Perusahaan BUMN Go Public. *Ekonomi dan Bisnis*, 40-54.
- Rifqiawan, R. A. (2015). Pengaruh Profitabilitas dan Kapitalisasi Pasar Terhadap Nilai Emiten Jakarta Islamic Index. *Economica*, 21-36.
- Ross, S. A. (1976). The Arbitrage Theory of Capital Asset Pricing. *Journal of Economic Theory*, 341-360.
- Ross, S. A. (1977). The Capital Asset Pricing Model (CAPM), Short-Sale Restrictions and Related Issues. *The Journal of Finance*, 177-183.
- Saebani, B. A. (2017). *Pedoman Aplikatif Metode Penelitian Dalam Penyusunan Karya Tulis Ilmiah, Skripsi, Tesis, dan Disertasi*. Bandung: CV Pustaka Setia.
- Sari, N. P., & Samin. (2016). Pengaruh Profitabilitas, Struktur Aset, Dan Likuiditas Terhadap Struktur Modal. *Ekonomi dan Bisnis*, 15-26.

- Sharpe, W. F. (1963). A Simplified Model for Portfolio Analysis. *Management Science*, 277-293.
- Sharpe, W. F. (1964). Capital Asset Prices: A Theory of Market Equilibrium Under Conditions of Risk. *The Journal of Finance*, 425-442.
- Sugiyono. (2013). *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif, dan R&D*. Bandung: Alfabeta.
- Supandi, E. D., Rosadi, D., & Abdurahman. (2016). Karakteristik Kurva Efisien Frontier dalam Menentukan Portofolio Optimal. *Jurnal Teknik Industri*, 43-49.
- Supriyanto, & Mulyantini, S. (2016). Faktor yang Berpengaruh Indeks Harga Saham Pada Bursa Efek Indonesia Tahun 2009-2012. *Ekonomi dan Bisnis*, 115-132.
- Suteja, J., & Gunardi, A. (2016). *Manajemen Investasi dan Portofolio*. Bandung: PT Refika Aditama.
- Syahputri, R., & Herlambang, L. (2015). Pengaruh ROA, NPM, dan EPS Terhadap Return Saham Pada Emiten Jakarta Islamic Index Tahun 2010-2013. *Jurnal Ekonomi Syariah Teori dan Terapan*, 340-355.
- Tandelilin, E. (2017). *Pasar Modal Manajemen Portofolio & Investasi*. Yogyakarta: PT Kanisius.
- Tania, A. L., Al-Hazmi, M. F., & Hotman. (2018). Analisis Kinerja Saham Syariah Melalui Pembentukan Portofolio Optimal Metoda Markowitz. *FINANSIA: Jurnal Akuntansi dan Perbankan Syariah*, 1-24.
- Tanjung, H., & Siregar, T. A. (2018). Analisis Volatilitas Saham di Jakarta Islamic Index (JII) periode Januari 2015-Januari 2018. *Ihtifaz; Journal of Islamic Economics, Finance and Banking*, 147-157.
- Utami, A. T., & Herlambang, L. (2016). Pengaruh Variabel Makro Ekonomi Terhadap Indeks Jakarta Islamic Index (JII) Periode Januari 2010 Hingga November 2015. *Jurnal Ekonomi Syariah Teori dan Terapan*, 70-84.
- Utomo, T. Y., Topowijono, & A, Z. Z. (2016). Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Dengan Menggunakan Model Indeks Tunggal Dalam Pengambilan Keputusan Investasi. *Jurnal Administrasi Bisnis*, 51-57.
- Widiyanti, N. W., & Hasanah, N. T. (2017). Analisis Determinan Pengungkapan Islamic Social Reporting (ISR). *Jurnal Bisnis dan Manajemen Islam*, 239-264.
- Widodo, A., & Laila, N. (2016). Reaksi Pasar Atas Pengumuman Dividen (Studi Pada Emiten yang Terdaftar Di Jakarta Islamic Index). *Jurnal Ekonomi Syariah Teori dan Terapan*, 85-98.

- Yuana, I., Topowijono, & Azizah, D. F. (2016). Analisis Pembentukan Portofolio Saham Optimal Dengan Model Markowitz Sebagai Dasar Penetapan Investasi. *Jurnal Administrasi Bisnis*, 90-98.
- Yunita, I. (2018). Markowitz Model Dalam Pembentukan Portofolio Optimal (Studi Kasus Pada Jakarta Islamic Index). *Jurnal Manajemen Indonesia*, 77-85.
- Yuwono, T., & Ramadhani, D. (2017). Comparison Analysis of Portfolio Using Markowitz Model and Single Index Model: Case in Jakarta Islamic Index. *Journal of Multidisciplinary Academic*, 25-31.