

DAFTAR RUJUKAN

- Arifiansyah Saputra. (Desember 2016). Analisis Pengaruh *Earnings Management* Dan Kinerja Operasional Perusahaan Terhadap *Return Saham* Setelah Pengumuman *Tax Amnesty*. Vol. XVIII, No.2. Ngawi: Media Prestasi.
- Bartholomew, Michael-Biggs. (2005). *Nonlinear Optimization with Financial Applications*. London: Kluwer Academic.
- Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A.J. (2006). *Investment and Portfolio Management. Sixth Edition*. New York: The McGraw-Hill Companies, Inc.
- Commonwealth Bank. (Juli 2016). Equity Market Review. Wealth Management Newsletter.
- Chandra, Liliana dan Hapsari, Yudith Dyah. (2013). Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Dengan Menggunakan Model Markowitz Untuk Saham LQ 45 Periode 2008-2012. *Jurnal Manajemen*, Vol. 1, No. 1
- David GL. (1998). *Investment Science*. Inggris: Oxford University Press
- Desak Nyoma Sri Werastuti. (Juni 2014). Pembentukan Portofolio Optimal Melalui Pendekatan Efisiensi *Decision-Making Units* (DMU) Yang Menghasilkan *Relative Efficiency Score* Berdasarkan *Single Index Model*. *Jurnal Ilmiah Akuntansi dan Humanika JINAH*, Volume 3, Nomor 2.
- Eka Kurniawati, Helmi, dan Neva Satyahadewi. (2013). Estimasi Ukuran Sensitivitas Keuangan saham Dalam Portofolio Pada *Single Index Model*, *Bimaster*, Volume 02, Nomor 1, pp 57-62
- Euginia Natalia, Darminto dan M.G. Wi Endang NP. (April 2014). Penentuan Portofolio Saham Yang Optimal Dengan Model Markowitz Sebagai Dasar Penetapan Investasi Saham. *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB)*, Volume 9, No 1.
- Hadinata, Ivan dan Adler H. (2010). Penerapan Data Envelopment Analysis (DEA) Untuk Mengukur Efisiensi Kinerja Reksadana Saham.

- Halim, Abdul. (2005). Analisis Investasi, Edisi kedua, Salemba Empat, Jakarta.
- Harry MM. (Maret 1952). Portfolio Selection, The Journal of Finance, Volume 7, No 1.
- I Gusti Agung A. Densi Wulandari, Made Arie Wahyuni, Edy Sujana. (2017). Reaksi investor dalam pasar modal terhadap Undang-Undang *Tax Amnesty* (*Event Study* Pada Perusahaan yang Terdaftar Dalam LQ45 di Bursa Efek Indonesia). e-journal S1 Ak Universitas Pendidikan Ganesha, Volume 7, No 1.
- Jogiyanto, H. M., (2008). Teori Portofolio dan Analisis Investasi, Edisi 2008, Yogyakarta: BPFE.
- Jenner, Stephen. (2011). *Management of Portfolios, The Stationary Office*
- Kadek Diah Puspareni, I Gusti Ayu Purnamawati, Made Arie Wahyuni. (2017). Pengaruh *Tax Amnesty*, pertumbuhan ekonomi, kepatuhan wajib pajak dan transformasi kelembagaan Direktorat Jendral Pajak terhadap penerimaan pajak tahun 2015 di kantor Pelayanan Pajak Pratama Singaraja. e-journal S1 Ak Universitas Pendidikan Ganesha, Volume 7, No.1.
- Ling, Oang Poay, and Anton Abdulbasah K. (2010). Data Envelopment Analysis (DEA) for Stocks Selection on Bursa Malaysia. School of Distance Education, Universities Sains Malaysia, 11800 USM, Penang, Malaysia.
- Liana. (2011). Pengaruh Perubahan Undang-Undang Pajak Penghasilan Terhadap Volume Perdagangan Saham pada Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar Bursa Efek Indonesia Selama Tahun 2008-2009. Tesis. Fakultas Ekonomi Universitas Pembangunan Nasional Veteran Jakarta
- Nuringsih, Kartika dan Koridama, Michael. (2008). Penerapan Single Index Model dalam mengestimasi beta saham. Jurnal Ekonomi, Volume 02, 179-192
- Permata, Aliffia S dan Sutijo, Brodjol S.U. (2015). Analisis Portofolio Optimum terhadap 50 Emiten dengan Frekuensi Perdagangan Tertinggi di Bursa Efek

Indonesia Menggunakan Metode Value At Risk, Lexicographic Goal Programming dan Artificial Neural Network. *Jurnal Sains dan Seni ITS*, Volume 4, Nomor 2.

Samsul, Mohamad. (September 2005). Kinerja Saham Menggunakan *Mean-Variance Analysis* Dalam Siklus Pemulihan Ekonomi Di Indonesia. *Jurnal Manajemen & Bisnis*, Volume 4, Nomor 2.

Sangat, D., & Ankit, A. (2014). Construction of Optimal Portofolio of Banking Stocks-A Diversification Strategy, *International Journal of Finance Management*.

Santoso, Edwin. (2017). 40 Saham Terbaik Untuk Dibeli di Tahun 2017, PT ELEX MEDIA KOMPUTINDO, Jakarta.

Stucchi, Patrizia. (1991). Some Reflections about a Simplified Algorithm of Portfolio Selection. Volume 2. pp 323-337.

Subanidja, Steph. (2007). Rasio Liquiditas dan Risiko Sistematis Pasar Saham, *Akuntabilitas*, Volume 7, 85-95.

Suharli, Michell. (Nopember 2005). Studi Empiris Terhadap Dua Faktor Yang Mempengaruhi *Return* Saham Pada Industri *Food & Beverages* Di Bursa Efek Jakarta. *Jurnal akuntansi dan keuangan*, Volume 7, Nomor 2.

Wan Chau Li and Yue Wu. (2014). *Using Portfolio Optimisation Models to Enhance Decision Making and Prediction*. *Journal of Modelling in Management*, Volume 9, Nomor 1.

Liputan6.com(2017). BEI Ingin Penghapusan Pajak Dividen untuk Investor Tertentu

Liputan6.com(2017). *Tax Amnesty* Pacu Pertumbuhan Properti Tahun Ini

Liputan6.com(2017). Sri Mulyani Buktikan *Tax Amnesty* RI Tersukses di Dunia

Pengampunanpajak.com(2016). Kebijakan *Tax Amnesty*, Sektor Properti Jadi Incaran

Pengampunanpajak.com(2016). *Tax Amnesty* perkuat saham konstruksi

Rosy, Arif. (2012). Analisis Perbandingan Kinerja Portofolio Saham Markowitz Dan Treynor Black Model Berdasarkan Hasil Seleksi Portofolio Menggunakan *Single Index Model Metode Cut Off Rate*. Tesis. Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia Jakarta

SWAOnline (2015). Survei Schroders: Investor Global Optimis dengan Pasar Asia

SWAOnline (2015). Serial *Tax Amnesty*: Infografis Menengok Keberhasilan *Tax Amnesty* Periode I

SWAOnline (2016). Dana *Tax Amnesty* Masuk Investasi Sektor Riil di Kuartal II 2017

SWAOnline (2017). Saham Apa Yang Menarik 2017

Sindonews.com (2017). Turunnya Harga Komoditas Global Berdampak Kepada Ekspor Indonesia