

Daftar Pustaka

- Aditya, Joshua (2016). *Analisis Perbandingan Kinerja Portfolio saham antara Single index, Markowitz, dan Treynor-Black Model*. Indonesia: Thesis Magister Manajemen PPM Manajemen
- Anoraga, Pandji. 2001. *Pengantar Pasar Modal Indonesia*. Mediasoft Indonesia.
- Bangun, Deddy H, Samuel P. D. Anantadjaja, Laura Lahindah (2012). Portfolio Optimal Menurut Markowitz Model dan *Single index* Model: Studi Kasus pada Indeks LQ45. *Journal of Management Studies*, 1(1): h: 70-93
- BPS (2014) Produk Domestik Bruto Atas Dasar Harga Konstan 2000 Menurut Lapangan Usaha (Miliar Rupiah), 2000-2014
- BPS (2014) Data Ekspor Impor Indonesia dinamis (Miliar Rupiah), 2006-2016
- BPS (2014) Produk Domestik Bruto Atas Dasar Harga Konstan 2010 Menurut Lapangan Usaha (Miliar Rupiah), 2014-2018
- Bodie, Z., Kane, A., dan Marcus, A. J. 2014. *Investments*. New York: Mcgraw-Hill/Irwin.
- Brown, A. D. (2015). *The Power of an Actively Managed Portfolio: an Empirical Example Using the Treynor-Black Model* (Doctoral dissertation, The University of Mississippi).
- Brown, Stephen J.; William N. Goetzmann; and Alok Kumar, 1998, The Dow Theory: William Peter Hamilton's Track Record Reconsidered, *The Journal of Finance*, Vol. LII, No. 4, August 1998
- Chandra, L., & Hapsari, Y. D. (2014). Analisis Pembentukan Portfolio Optimal dengan Menggunakan Model Markowitz untuk Saham LQ 45 Periode 2008-2012. *Jurnal Manajemen*, 11(1), 41-59.
- Clinebell, John M.; Jan R Squires and Jerry L. Stevens, 1993, Investment Performance Over *Bull* and *Bear* Markets: Fabozzi and Francis Revisited, *Quarterly journal of Business and Economics*, Autumn, Vol. 31 No. 4
- DE GRAAF, T. A. (2016). *Robust Mean-Variance Optimization*. Leiden University
- Dewi, Tiara Kania and Sri, Adji Prabawa (2013) Pengaruh Indikator Krisis keuangan Global terhadap IHSG. Undergraduated thesis, Fakultas Ekonomi UNIB. 4
- Elton, Edwin J., Martin J. Gruber, Stephen J. Brown dan Willian N. Goetzmann. 2011. *Modern Portfolio Theory And Investment Analysis*. New York: John Wiley & Sons, Inc.
- Fahmi, Irham, dan Hadi. 2011. *Teori Portfolio dan Analisis Investasi*. Edisi Kedua. Bandung: Alfabeta.
- Fitriyantini, S., Saepudin, D., & Rohmawati, A. A. (2017). *Modifikasi Portfolio Mean-variance Dengan Melibatkan Model Keasimetrian Distribusi*. *eProceedings of Engineering*, 4(2).
- Gitman, Lawrence J. 1990 . *Fundamentals of Investing*. Boston: Pearson Education
- Hadi, Nor, 2013. *Pasar Modal: Acuan Teoritis Dan Praktis Investasi Dan Instrument Keuangan Pasar Modal*.
- Halim, Abdul. 2015. *Analisis Investasi Dan Aplikasinya Dalam Aset Keuangan Dan Aset Riil*. Jakarta: Salemba Empat.
- Harsana, Pande Ketut Susetya. 2010. Pembentukan Kurva Yield Obligasi Pemerintah Berbunga Yield Tetap dengan Menggunakan Permodelan Nelson Siegel Svenssons dan Cubic Spline

- Husnan, Suad. 2001. *Dasar-Dasar Teori Portfolio dan Analisis Sekuritas*. Edisi Ketiga. Yogyakarta: UPP AMP YKPN.
- Husnan, Suad dan Pudjiastuti, Enny. 2004. *Dasar-dasar Teori Portfolio Dan Analisis Sekuritas: Dilengkapi penyelesaian soal cetakan ketiga*. Yogyakarta: UPP AMP YKPN.
- Hutami, Rescyana P. 2012. *Pengaruh Dividend Per Share, Return On Equity Dan Net Profit Margin Terhadap Harga Saham Perusahaan Industri Manufaktur. Yang Tercatat Di Bursa Efek Indonesia Periode 2006-2010*. Fakultas Ekonomi Universitas Negeri Yogyakarta
- Katadata (2018) Inilah Neraca Perdagangan Indonesia Sejak Krisis tahun 1998 Diakses dari: <https://databoks.katadata.co.id/datapublish/2018/01/04/inilah-neraca-perdagangan-indonesia-sejak-krisis-1998>.
- Kewal, S. S. (2013). Pembentukan portfolio optimal saham-saham pada periode *bullish* di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Economia*, 9(1), 81-91.
- Kompas (2012) Indonesia Bisa Bertahan dari Krisis Global. Diakses dari: <https://ekonomi.kompas.com/read/2012/07/08/13274536/indonesia.bisa.bertahan.dari.krisis.global>.
- KRISLIANTO, ISWIDIARMAN ANGGA . (2013). Analisis Strategi Optimalisasi Portfolio Saham LQ 45 (pada Bursa Efek Indonesia Tahun 2009-2011) .*Jurnal Manajemen dan Organisasi* Vol IV, No 2, Agustus 2013.
- Lind, D., Marchal, W. G., & Wathen, S. A. (2015). *Statistical Techniques in Business & Economics*. New York.
- Lubatkin, Michael and Sayan Chatterjee, 1994, Extending Modern Portfolio Theory into The Domain of Corporate Diversification: Does It Apply? ,*Academy of Management Journal*, Vol. 37 No. 1
- Malhotra, N. K., Daniel, N., & David, B. F. (2017). *Marketing Research*. Ediburgh: Pearson Education Limited.
- Manulang, M. P. (2012). Optimalisasi Kinerja Portfolio Investasi di Indonesia. *Thesis Universitas Indonesia*.
- McMillan, Pinto, Pirie, & Van de Venter. (2011). *Investments principles of Potfolio and Equity Analysis*. New Jersey: John Wiley & Sons Inc.
- Meliawati, M., & Djohanputro, B. (2016). Analisis Determinan Yield Obligasi Di Pasar Sekunder Dan Implikasinya Terhadap Portofolio Obligasi Bank Bukopin. *Journal of Management and Business Review*, 13(2).
- Parahita (2008). *Bagaimana Cara Menentukan Harga Wajar Saham*
- PPM Manajemen(2017). *Pedoman Penulisan Thesis Program Studi S2 Sekolah Tinggi Manajemen*.
- PUTRA, EDGAR PANDU and Edy Handoyo, S.E., M.M., Sarwo (2013) OPTIMALISASI PORTFOLIO PADA INDEX LQ-45 DENGAN MEMBANDINGKAN METODE SINGLE INDEX MODEL DAN CONSTANT CORRELATION PERIODE AGUSTUS 2009 - JULI 2012. Undergraduate thesis, BINUS.

- Raharjo, Sapto. 2006. *Kiat Membangun Aset Kekayaan (Panduan Investasi Saham Dari A-Z)*. Cetakan Kedua. Jakarta: Penerbit PT. Alex Media Komputindo.
- Rahmadin, R. (2014). Pembentukan Portfolio Optimal Saham Berdasarkan Model *Single index* (Studi Pada Saham Indeks Lq-45 Di Bei Tahun 2011-2013). *Jurnal Administrasi Bisnis*, 9(2).
- Reilly, Frank K. dan Keith C. Brown. 2006. *Investment Analysis And Portfolio Management*. USA: Thompson South-Western.
- Ridwan, M. B. (2013). *Analisis portfolio optimal dengan metode markowitz metode graham dan Single index model studi kasus pada saham indeks lq45 dan saham indeks bisnis 27 di bursa efek indonesia*.
- Rosy, Arif. 2012. *Analisis Perbandingan Kinerja Portfolio Saham Markowitz Dan Treynor Black Model Berdasarkan Hasil Seleksi Portfolio Menggunakan Single-Index Model Metode Cut-Off Rate*.
- Rusdin. 2008. *Pasar Modal: Teori, Masalah, dan Kebijakan dalam Praktik*. Bandung: Alfabeta.
- Sari, Kartika, Topowijono dan A. Zahroh Z. 2016. Penerapan Analisis Dividend Discount Model Pertumbuhan Konstan Sebagai Dasar Penilaian Harga Saham Dalam Pengambilan Keputusan Investasi Saham (Studi Pada Perusahaan Sub Sektor Food And Beverages Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Tahun 2012-2014). *Jurnal Administrasi Bisnis*. 34(1). 53-58.
- Schweser, K. (2015). *Schweser Notes for 2016 Level I CFA Exam, Book 4: Corporate finance, Portfolio Management, and Equity Investment*. United States: Kaplan Inc.
- Schweser, K. (2017). *Schweser Notes for 2016 Level I CFA Exam, Book 4: Corporate finance, Portfolio Management, and Equity Investment*. United States: Kaplan Inc.
- Septyanto, D., & Kertopati, B. (2014). ANALISA PEMBENTUKAN PORTFOLIO DENGAN MENGGUNAKAN MODEL MARKOWITZ DAN *SINGLE INDEX* MODEL PADA SAHAM LQ45 DI BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2009–2013. *Sustainable Competitive Advantage (SCA)*, 4(1).
- Situmorang, Parluhutan, Jauhari Mahardhika, dan Tri Listiyarini. 2010. *Jurus-Jurus Berinvestasi Saham Untuk Pemula*. Jakarta: Transmedia.
- Sukarno, M. (2013). *Analisis Pembentukan Portfolio Optimal saham menggunakan metode Single index di Bursa Efek Indonesia*.
- Sunariyah. 2000. *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*. Yogyakarta: UPP AMP YKPN.
- Susilo, W. A. Analisis perbandingan kinerja portfolio optimal markowitz model dan *Treynor-Black model* berdasarkan hasil seleksi *Single index* model metode cut-off rate (studi kasus pada saham indeks lq45 dan jakarta *islamic index* Periode 3 januari 2011–30 desember 2015) (Bachelor's thesis, Jakarta: Fakultas Ekonomi dan Bisnis UIN Syarif Hidayatullah Jakarta).

- Tandelilin, Eduardus. 2010. *Portfolio dan Investasi*. Yogyakarta: Percetakan Kanisius.
- Tandelilin, Eduardus, 2001, *Beta* pada Pasar *Bullish* dan *Bearish*: Studi Empiris di Bursa Efek Jakarta, Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia, Vol. 16, No.3
- Trihendradi, Cornelius. 2005. *Statistik Inferen Teori Dasar dan Aplikasinya Menggunakan SPSS 12*. Yogyakarta. Andi.
- Wardjianto (2005) “Perbandingan Kinerja Portfolio Saham Pada Pasar *Bullish* dan *Bearish*: Studi Empiris pada Saham - saham Jakarta Islamic Index (JII) BEJ”. Thesis. Tidak Dipublikasikan. Program Studi Magister Manajemen Program Pascasarjana Universitas Diponegoro, Semarang.
- Wati, Nindi Shinta. 2016. *Analisis Single index Model Untuk Menentukan Komposisi Portfolio Optimal*