

DAFTAR PUSTAKA

- Brown, K. C., & Reilly, Frank K. (2009). *Analysis of Investment and Management of Portfolios* (9th ed.). Canada: South Western Cengage Learning.
- Byrne, Peter & Lee, Stephen (2004). Different Risk Measures: Different Portfolio Compositions?. *Emerald Journal of Property Investment & Finance*, 22(6), 501-511.
- Eko, Umanto (2008). Analisis dan Penilaian Kinerja Portofolio Optimal Saham – Saham LQ45. *Jurnal Ilmu Administrasi dan Organisasi*, 15(3), 178-187.
- Elton, J. Edwin and Martin J. Gruber. 2003. *Modern Portofolio Theory and Investment Analysis* . USA: John Wiley & Sons
- Fahmi, Irham (2012). *Manajemen Investasi: Teori dan Soal Tanya Jawab*. Bandung: Salemba Empat.
- Gitman, Lawrence J. 2009. *Principles of Managerial Finance*, 12th Edition. Prentice Hall., Boston
- Hartono, J. (2003). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Tiga. Yogyakarta: BPFE Yogyakarta
- Hartono, Jogiyo (2010). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFE.
- Husnan, Suad (2003). *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFE.
- Jorion, Philippe (2007). *Value at Risk: The New Benchmark for Managing Financial Risk* (3rd ed.). Singapore: McGraw-Hill Professional.
- Kam, Kathy (2006). *Portfolio Selection Method: An Empirical Investigation*. Thesis Master of Science in Statistics University of California Los Angeles: tidak diterbitkan.
- Keown, Arthur J., John D. Martin, J. William Petty, David F. Scott, Jr. 2008. *Manajemen Keuangan : Prinsip dan Penerapan, Edisi Kesepuluh Jilid 1*. Jakarta : Indeks
- Kurnia, Yusman. 2008. Analisis Perbandingan Kinerja Portofolio yang Diperoleh Melalui Model Excess Return To Beta, Roy's Criterion, Kataoka , dan Telser.
- Nico Singer. (2010). *Safety-first portfolio optimization: Fixed versus random target*: tidak diterbitkan
- Niranjan Mandal. (2013). *Sharpe's Single Index Model And Its Application To Construct Optimal Portofolio: An Empirical Study* Vol 7, March 2013

- Nurdin, Ade Ali. 2009. Perbandingan Kinerja Portofolio Optimal Saham-Saham Unggulan Berbasis Syariah dengan Saham-Saham Unggulan Berbasis Konvensional Di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Ekonomi, Keuangan, Perbankan dan Akuntansi* Vol. 1, No. 2, November. pp 173-188
- Prof. Dr. Engin KÜÇÜKSİLLE and Prof. Dr. Durmuş ACAR. (2011). *The Evaluation Of Portofolio Performance By Using Data Mining Process And An Application ISE Stock Market* Vol. 1 No. 2, September.
- Rezadiansah, M. T. (2010). *Analisis Perbandingan Kinerja Portofolio Optimum Emiten Jakarta Islamic Index (JII) Dengan Emiten Bisnis Menggunakan Single Index Model*. Thesis pada Pascasarjana FE Universitas Padjadjaran Bandung: tidak diterbitkan.
- Riessa, S. F. (2006). *Kajian Perbandingan Risk and Return Pada Saham LQ45 dan Jakarta Islamic Index Dengan Pendekatan CAPM*. Thesis Magister Manajemen pada FE Universitas Indonesia Jakarta: tidak diterbitkan.
- Simamora, Lontung (2007). *Analisis Portofolio Optimal Pada Saham-Saham Yang Bertahan Dalam Indeks LQ45 Selama Lima Tahun*. Thesis Magister Manajemen pada FE Universitas Indonesia Jakarta: tidak diterbitkan.
- Sekaran, Uma (2007). *Research Methods for Business: Metodologi Penelitian Untuk Bisnis* (Buku 1, ed. 4). Jakarta: Salemba Empat.
- Sekaran, Uma (2007). *Research Methods for Business: Metodologi Penelitian Untuk Bisnis* (Buku 2, ed. 4). Jakarta: Salemba Empat.
- Sekaran, Uma & Bougie, Roger (2010). *Research Methods for Business: A Skill Building Approach* (5th ed.). Chicester: John Wiley & Sons.
- Sunarto, Dewi Kuntari (1995). *Penentuan Portofolio Optimal Dengan Menggunakan Single Index Model dan Constant Correlation Model: Suatu Analisa Saham-Saham di Bursa Efek Jakarta*. Thesis Magister Manajemen pada FE Universitas Indonesia Jakarta: tidak diterbitkan.
- Sugiyono. 2009. *Metode Penelitian Kuantitatif Kualitatif dan R&D*. Bandung: Alfabeta
- Suryabrata, Sumadi. 2008. *Metode Penelitian*. Jakarta: Rajawali Pers.
- Tandelilin, Eduardus (2010). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Yogyakarta: BPFE.

Van Horne, J. C. & Wachowicz J. M. (2005). *Fundamentals of Financial Management: Prinsip-Prinsip Manajemen Keuangan* (Buku 1, ed. 12). Jakarta: Salemba Empat.

Widiatmodjo, Sawidji (2009). *Pasar Modal Indonesia: Pengantar dan Studi Kasus*. Bogor: Ghalia Indonesia.

Wulansari, Putri. Dan Herwany, Aldrin. 2008. Kinerja Portofolio Optimal Saham *Blue Chips* Menggunakan *Sharpe Measure*, *Jurnal Bisnis dan Manajemen*, Vol VIII, No.2, Maret. pp 60-74.

Zubir, Zalmi. 2011. *Manajemen Portofolio: Penerapannya dalam Investasi Saham*. Jakarta: Salemba Empat.

www.bapepam.go.id

www.bi.go.id

www.duniainvestasi.com

www.idx.co.id

www.kompas.com

id.berita.yahoo.com/bei-jumlah-investor-pasar-modal-masih-sedikit-95120514.html

[27 Februari 2013]

finance.yahoo.com/q/hp?s=^JKLQ45&a=11&b=28&c=2006&d=09&e=27&f=2011&g=d [27 Februari 2013]