

DAFTAR PUSTAKA

- Adnyana, I. M. 2020. Manajemen Investasi dan Portofolio. Jakarta: Lembaga Penerbitan Universitas Nasional.
- Amenda, J., Putri, C.C., dan Sihotang, L. 2022. Analisis Portofolio Sebagai Dasar Pengambilan Keputusan Investasi Saham Yang Terdaftar Pada Bursa Efek Indonesia. *Journal of Social Research* 1 (6), 532 -542.
- Aslam, A.P., Nisa, N.A., Wilda, dan Putra, M.A.F.A. 2022. Analysis of the Single Index Model in the Banking Sector in LQ 45 Period 2020-2022. *Jurnal Bisnis, Manajemen, dan Informatika (JBMI)*. Vol. 19 No. 2.
- Bank Indonesia. 2024. BI Rate. <https://www.bi.go.id/id/statistik/indikator/BI-Rate.aspx> (diakses pada 17 April 2024).
- Bartholdy, J., dan P. Peare. 2001. *The relative efficiency of beta estimates. Social Science Research Network. (March):* 1-20.
- Bursa Efek Indonesia. 2021. Indeks Saham ISSI. <https://www.idx.co.id/id/data-pasar/data-saham/indeks-saham/>(diakses pada 21 Mei 2024).
- Chasanah, *et al.* 2020. Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Saham-Saham *Jakarta Islamic Index* (JII) pada Masa Pandemi Covid-19. *Jurnal Saintika Unpam*. Vol 3, No. 1, Hal: 52-67.
- Chloe, P.M.A., dan Hascaryani, T.D. 2023. Pemetaan Risiko Sistematis & Pembentukan Portofolio Optimal Saham Indeks LQ45 Dengan Model Indeks Tunggal. *Contemporary Studies in Economic, Finance, and Banking*. Vol. 02, No. 4, Hal: 577 - 592. Universitas Brawijaya.
- Elton, E. J., dan Grubber. 1995. *Modern Portfolio Theory and Investment Analysis 5th ed, John Wiley & Sons, New York*.
- Evirrio, Stevan. 2018. Pengaruh Risiko Sistematis dan Risiko Tidak Sistematis terhadap *Expected Return* Portofolio Optimal (Studi pada Perusahaan yang Terdaftar di *Jakarta Islamic Index* Tahun 2013-2017). *Skripsi*. Program Studi Ilmu Administrasi Bisnis, Fakultas Ilmu Administrasi, Universitas Brawijaya.
- Febrianti, S. 2018. Analisis Perbandingan Kinerja Indeks Saham Syariah dengan Indeks Saham Konvensional periode 2015-2017 (Studi Kasus pada JII dan LQ45). *Proceeding Sendi_U*, 2017, 546–551.
- Febrianti, S., Marjono, dan Apriani, T. 2021. Pembentukan Portofolio Optimal Saham Syariah yang Terdaftar di JII dengan Metode Single Index Model. *Jurnal Ilmiah Ekonomi Islam*, 7(03), 1895–1904.
- Firdaus, I., Anah, S., dan Nadira, F. 2018. Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Model Indeks Tunggal (Studi Kasus: Saham LQ 45 Yang Terdaftar Di BEI Tahun 2012-2016). *Jurnal Ekonomi* Vol. XXIII, No. 02, Hal: 203-225.

- Firdausi, M.I. 2023. Analisis Portofolio Optimal Syariah Pasca Covid-19 Melalui Model Indeks Tunggal (Studi Kasus Terhadap Saham Jakarta Islamic Index Periode Januari 2019-November 2023). *Jurnal Manajemen, Bisnis dan Kewirausahaan (JUMBIKU)* Vol. 3, No. 3, Hal: 107-123.
- Gafur, A. 2024. Pembentukan Portofolio Optimal Investasi Menggunakan Model Markowitz Dan Model Indeks Tunggal Pada Aset Bebas Risiko Dan Aset Berisiko (Saham LQ 45 di Bursa Efek Indonesia). *Journal of Management and Innovation Entrepreneurship (JMIE)* Vol. 1, No. 2.
- Gujarati, D. 2006. *Ekonometrika Dasar*. Jakarta: PT Gelora Aksara Pratama.
- Hanafi, M. M., & Hanafi, S. M. 2012. Perbandingan Kinerja Investasi Syariah dan Konvensional: Studi pada Jakarta Islamic Indeks (JII) Dan Indeks LQ45. *Eksibisi*, 7(1), 16–27.
- Harianto, F., dan Sudomo, S. 1998. *Perangkat dan Teknik Analisis Investasi di Pasar Modal di Indonesia*. Jakarta: Bursa Efek Jakarta.
- Hartono, J. 2019. *Teori dan Praktik Portofolio dengan Excel*. Jakarta: Salemba Empat.
- Insana, A. 2022. *Does Systematic Risk Change When Markets Close? An Analysis Using Stocks' Beta. Economic Modelling*, 109. <https://www.sciencedirect.com/science/article/abs/pii/S0264999322000281> (diakses pada 17 Juni 2024).
- Investing.com. 2024. Komponen Saham ISSI. <https://id.investing.com/indices/idx-shariah-components> (diakses pada 25 Mei 2024).
- Janisa, E., Abidin, N.M., Abidin, N.M., dan Djuanda, G. Analisis Fundamental Saham-Saham Industri Manufaktur Di Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI) Pada Masa Pandemi Covid-19. Sukabumi: Tahta Media Grup.
- Jorion, P., 2002. *Value at Risk: The New Benchmark for Managing Financial Risk. Second Edition. The McGraw-Hill Companies, Inc. New York*.
- Jusuf, A. A. A. 2014. Prediksi Risiko Sistematis Saham-Saham LQ45 Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Ekonomi Dan Bisnis*, 17(3), 99–118.
- Mardhiyah, A. 2017. Peranan Analisis *Return* Dan Risiko Dalam Investasi. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Islam* Vol. 2, No. 1, Hal : 1-17.
- Marhawati, et al. 2022. *Statistika Terapan*. Sukoharjo: Tahta Media Group.
- Marketeers. 2023. Pengertian Sektor dan Perannya dalam Perekonomian. [Pengertian Sektor dan Perannya dalam Perekonomian](#) (diakses pada 12 November 2024).
- Markowitz, H. M. 1952. *Portfolio Selection. Journal of Finance*, (7): 77-91.
- Mie, M., dan Agustina. 2014. Analisis Pengaruh Indeks Harga Saham Gabungan Asing Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan Indonesia. *Jurnal Wira Ekonomi Mikroskil* Vol. 4, No. 02.

- Nugroho, H.S., dan Aji, S.S.B. 2019. Pembentukan Portofolio Optimal Saham-Saham Di Bursa Efek Indonesia (BEI). *Jurnal Solusi* Vol. 14, No. 2.
- Oktafiani, H.E., Maruddani, D.A.I., dan Suparti. 2017. Penerapan Model Indeks Tunggal untuk Optimalisasi Portofolio dan Pengukuran *Value At Risk* dengan *Variance Covariance* (Studi Kasus: Saham yang Stabil dalam LQ 45 Selama Periode Februari 2011 – Juli 2016). *Jurnal Gaussian*. Vol. 6, No. 1, Hal: 41-50.
- Oktaviani, B. N., & Wijayanto, A. (2016). Aplikasi Single Index Model dalam Pembentukan Portofolio Optimal Saham LQ45 dan Jakarta Islamic Index. *Management Analysis Journal*, 5(3), Hal: 189–202.
- Prabowo, S.H., Hardyaningwati, dan Saputra, A. 2021. Efektifitas Penerapan *Software R* pada Penentuan Beta Saham Syariah Berbasis Regresi Linear. *Kocenin Serial Konferensi*, No. 1.
- Pratama, L.A. 2019. Analisis Pembentukan Portofolio Saham Optimal menggunakan Metode Single Index Model (Studi Empiris pada Saham Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia). *Jurnal Ilmu Manajemen*, Vol. 16, No. 1, Hal: 48–60.
- Priyantono, V.R.A., Maruddani, D.A.I., dan Utami, I.T. 2023. Analisis Portofolio Optimal Menggunakan Model Indeks Tunggal Dan Pengukuran Value At Risk Dengan Simulasi Monte Carlo (Studi Kasus: Exchange Traded Fund di Bursa Efek Indonesia Periode Januari 2021 – Juni 2022). *Jurnal Gaussian*, Vol. 12, No. 2, Hal: 158 – 165.
- Puspitaningtyas, Z. 2017. *Estimating systematic risk for the best investment decisions on manufacturing company in Indonesia*. *Investment Management and Financial Innovations*, 14(1), 46–54.
- Reilly, F.K., dan Brown, K.C. 2012. *Investment Analysis and Portfolio Management, Tenth Edition*. USA: South Western Cengage Learning.
- Silalahi, I. V., Nugraha, Sari, M., dan Ningrum, H. F. 2022. Analisis Single Index Model dalam Membentuk Portofolio Optimal pada Saham Perusahaan Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2016 - 2020. *SAINS: Jurnal Manajemen dan Bisnis*, 14(2), Hal: 203-221.
- Simorangkir, L. 2021. Analisis Perbandingan Kinerja antara Portofolio Optimal Model Markowitz dan Model Indeks Tunggal (*Comparative Analysis Of Performance Between Optimal Portofolio Markowtiz Model And Single Index Model*). *Jurnal Akuntansi dan Bisnis Krisnadwipayana*, Volume 8, Nomor 3, 384-401.
- Sulistiani, N. 2006. Analisa Perbandingan Lima Model Indeks Kinerja Portofolio. *Skripsi*. Program Studi Manajemen, Fakultas Ekonomi, Universitas Islam Indonesia.
- Taliawo, N., dan Atahau, A. 2007. Beta dan Implikasinya terhadap Hasil Diversifikasi Saham di Bursa Efek Jakarta. *Jurnal Bisnis Dan Ekonomi*, 14(2007), 161–171.

- Tandelilin, Eduardus, 2010. Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi, Edisi Pertama, Yogyakarta : Kanisius.
- The Nest. 2019. *What Happens at the Maturity Date of My IRA CD?* <https://budgeting.thenest.com/interest-work-cd-account-22651.html> (diakses pada 11 Oktober 2024).
- Wardah, B. 2020. Kebijakan Portofolio Optimal Saham Syariah pada Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI) Menggunakan Indeks Tunggal pada Masa Pandemi Covid-19. Schemata: *Jurnal Pasca Sarjana* IAIN Vol. 9, No. 2, Hal: 233-246.
- Yahoo Finance. 2021. Data Historis Saham dan IHSG. [Yahoo Finance - Stock Market Live, Quotes, Business & Finance News](#) (diakses pada 26 Mei 2024).
- Yasa, D.A. 2020. Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Model Indeks Tunggal (Studi Pada Perusahaan BUMN yang Terdaftar dalam Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia). Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Brawijaya.