

## DAFTAR PUSTAKA

- Ahmad, Kamarudin. 2004. *Dasar-Dasar Manajemen Investasi dan Portofolio*. Cetakan Kedua. Jakarta: PT.Rineka Cipta
- Arikunto, Suharsimi. 1997. *Prosedur penelitian Suatu Pendekatan Praktek*. Jakarta: Rineka Cipta.
- Aryanto, Agus. 2013. Perbandingan Portofolio Saham Dengan Model Indeks Tunggal Antara *JII* dengan *FTSE Bursa Malaysia Emas Syariah Index*. *Skripsi* (tidak dipublikasikan). UIN Maulana Malik Ibrahim Malang.
- Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A.J. 2006. *Investments and Portofolio Management*. Sixth Edition, New York : The McGraw-Hill Companies, Inc.
- . 2011. *Investments and Portofolio Management*. Global Edition, New York : The McGraw-Hill Companies, Inc.
- Chaudhry, Ashraf, & Helen L. Johnson. 2008. *The Efficacy of the Sortino Ratio and Other Benchmarked Performance Measures Under Skewed Return Distributions*. *Australian Journal of Management*, Vol. 32, No. 3, Special Issue.
- Darmadji, Tjiptono dan Hendry M. Fakhruddin. 2008. *Pasar Modal di Indonesia Pendekatan Tanya Jawab. Edisi Kedua*, Jakarta : Salemba Empat.
- Elton, E.J., Gruber, M.J., Brown, S.J., & Goetzmann, W.N. 2011. *Modern Portofolio Theory and Investment Analysis*. New York : John Wiley & Sons, Inc.
- Fakhrudin, M Hendy dan Tjiptono Darmadji. 2011. *Pasar Modal di Indonesia*. Jakarta: Salemba Empat
- Halim, Abdul. 2005. *Analisis Investasi* .Edisi Kedua. Jakarta: Salemba Empat.
- <http://budionline.blogdetik.com/>, diakses 2 Oktober 2014
- <http://finance.yahoo.com/>, diakses 2 Oktober 2014
- <http://www.bi.go.id/>, diakses 2 Oktober 2014
- <http://www.idx.co.id/>, diakses 2 Oktober 2014
- Huda, Nurul. 2007. *Investasi Pada Pasar Modal Syariah*. Jakarta: Kencana Prenada Media Group.
- Husnan, Suad. 2001. *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: UPP AMP YKPN.
- . 2003. *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Edisi Ketiga, Yogyakarta: UPP AMP YKPN.
- INDONESIA INVESTMENT COORDINATING BOARD (BKPM). 2014. *Investasi Di Indonesia*. Jakarta. Diperoleh tanggal 2 Oktober 2014 dari <http://www4.bkpm.go.id/>

- Indriantoro, Nur dan Bambang Supomo. 2002. *Metodologi Penelitian Bisnis untuk Akuntansi dan Manajemen*. Yogyakarta: BPFE.
- Jogiyanto. 1998. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta:BPFE.
- . 2003. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Ketiga, Yogyakarta: BPFE.
- . 2013. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Ketujuh. Yogyakarta: BPFE-Yogyakarta
- Jones, Charles P. 1996. *Investment Analysis and Management*. Fifth Edition, New York: John Wiley & Sons, Inc.
- Kasiram. 2008. *Metodologi Penelitian Kualitatif-Kuantitatif*. Yogyakarta: UIN-Maliki Press.
- Markowitz, H. M., 1952. *Portofolio Selection*. *Journal of Finance*. pp. 77-91.
- Rosdiana, Riska. 2012. Analisis Optimalisasi Portofolio Saham Syariah (Pada *Jakarta Islamic Index* Tahun 2006-2010), *Skripsi* (dipublikasikan). Universitas Diponegoro.
- 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* (dipublikasikan). Universitas Indonesia.
- Samsul, M. 2006. *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Erlangga.
- Sekaran, Uma. 2000. *Research Methods for Business*. Third Edition. United States of America: Jhon Wiley & Sons, Inc.
- Sharpe, William F. 1995. *Risk, Market Sensitivity and Diversification*. *Financial Analysts Journal*. Januari-Februari. pp. 84-88.
- Sharpe, William F., Alexander Gordon J., Bailey Jeffery V. 2005. *Investment*. Sixth Edition. Terjemahan. Henry Njooliangtik dan Agustiono. Edisi Bahasa Indonesia. Edisi Kelima. Jakarta: PT Indeks Kelompok Gramedia.
- Solnik, Bruno, H. 1995. *Why not Diversify Internationally rather than Domestically*. *Financial Analysts Journal*. Januari-Februari. pp.89-94.
- Statman, Meir. 1987. *How Many Stocks Make a Diversified Portfolio*. *Journal of Financial and Quantitative Analysis*, Vol.22 no.2. September. pp. 353-363.
- Sugiyono. 2011. *Metode Penelitian Kuantitatif Kualitatif dan R&D*. Bandung: Alfabeta
- Tandelilin, Eduardus. 2001. *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Edisi Pertama, Yogyakarta : Kanisius.
- Tandelilin, Eduardus. 2010. *Portofolio dan Investasi: Teori dan Aplikasi*. Yogyakarta: Kanisius.
- Zuriah, Nurul. 2006. *Metodologi Penelitian Sosial dan Pendidikan Teori-Aplikasi*. Jakarta: PT Bumi Aksara.