

## REFERENCES

- Bodie, Z Kane, A. & M. A. J. (2013). *Investment* (10th edition ). McGraw-Hill, Inc.
- D.R. Cooper, C. W. Emory. (1995). *Business Research Methods* (5th edition). McGraw-Hill, Inc.
- Yahoo Finance. Historical price and volume of each stock and JII from 2014 – 2020. <https://finance.yahoo.com>.
- Bank Indonesia. Indonesian Interest rate or BI 7-day (reverse) Repo Rate. <https://www.bi.go.id/id/default.aspx>.
- Fakhurddin, D. &. (2012). *Pasar Modal di Indonesia Pendekatan Tanya Jawab*. Salemba Empat.
- Firdaus, Iwan. Anah, Sri. Nadira, F. (2018). Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Model Indeks Tunggal. *Jurnal Ekonomi*, 23(2), 203–226.
- Bursa Efek Indonesia. IDX Fact Book 2014-2020. <http://www.idx.co.id/id-id/beranda/publikasi/factbook.aspx>.
- Bursa Efek Indonesia. market information of changes in stock composition in the calculation of the Jakarta Islamic Index. <https://www.idx.co.id/id>.
- Bursa Efek Indonesia. The value of the market capitalization of Islamic stocks from 2014 to 2020. <https://www.idx.co.id/id>.
- Hadiyoso, A., Firdaus, M., & Sasongko, H. (2015). Building an Optimal Portfolio on Indonesia Sharia Stock Index (ISSI). *Bisnis & Birokrasi Journal*, 22(2). <https://doi.org/10.20476/jbb.v22i2.5699>.
- Halim, A. (2014). *Analisis Investasi dan Aplikasinya Dalam Aset Keuangan dan Aset Rill*. Salemba Empat.
- Hidayat, T. (2011). *Buku Pintar Investasi Syariah*. Mediakita.
- Husnan, S. (2001). *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. UPP AMP YKPN.
- Irala, Lokanandha Reddy and Patil, P. (2007). *Portfolio Size and Diversification*. 4(1), 1–6.
- Jogiyanto Hartono. (2016). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi* (Edisi Kesebelas). BPFE.
- Mulyadi. (2010). *Sistem Akuntansi* (Vols. Edisi ke-3t). Salemba Empat.
- Partono Thomas, Widiyanto, Y. A. and H. V. (2017). The Analysis of Optimal Portfolio Forming with Single Index Model on Indonesian Most Trusted Companies. *International Research Journal of Finance and Economics*, Issue 163 September, 2017, 50–59. <http://www.internationalresearchjournaloffinanceandconomics.com>
- Permata, D., & Suryawati, R. F. (2020). Analisis Portofolio Optimal Saham Syariah Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2015-2017. *Jurnal Manajemen Dan Organisasi*, 11(1), 8–21. <https://doi.org/10.29244/jmo.v11i1.30492>
- Rarastiti Hanggi, H. R. S. and S. N. (2013). *Pmbentukan Portofolio Optimal Dengan*

*Menggunakan Single Index Model ( Studi Pada Perusahaan Food and Beverages yang Terdaftar di BEI.*

- Septyanto, Dihin and Kertopati, B. (2014). Analisa Pembentukan Portofolio Dengan Menggunakan Model Markowitz dan Single Index Model Pada Saham Yang Masuk Dalam Indeks LQ45 Di Bursa Efek Indonesia Tahun 2009-2013. *Finance and Banking Journal*, 16(2), 140–156.
- Setiawan, S. (2017). Analisis Portofolio Optimal Saham-Saham Lq45 Menggunakan Single Index Model Di Bursa Efek Indonesia Periode 2013-2016. *Journal of Accounting and Business Studies*, 1(2), 1–10.
- Sugiyono. (2011). *Metode Penelitian Kuantitatif Kualitatif dan R&D*. Alfabeta.
- Tandelilin. (2001). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. BPFE.
- Tandelilin. (2003). *Portofolio dan Investasi*. UGM.
- Tandelilin, E. (2012). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. BPFE.
- Wahyuningsih Indah, H. and A. Z. (2019). *Analisis Return and Risk Portofolio Optimal Berdasarkan Single Index Model Pada Jakarta Islamic Index Di Bursa Efek Indonesia Periode 2015-2017*.
- Shaikh, S.A., Ismail, M.A., Ismail, A.G., Shahimi, S. and Mohd. Shafiai, M.H. (2019), "Cross section of stock returns on Shari'ah-compliant stocks: evidence from Pakistan", *International Journal of Islamic and Middle Eastern Finance and Management*, Vol. 12 No. 2, pp. 282-302. <https://doi.org/10.1108/IMEFM-04-2017-0100>
- Wisambudi, M. B. "Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Dengan Menggunakan Model Indeks Tunggal (Studi Pada Saham Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2011-2013)." *Jurnal Administrasi Bisnis S1 Universitas Brawijaya*, vol. 12, no. 1, 14 Jul. 2014.
- Pinasthika and Surya.(2014). Optimal Portfolio Analysis With Risk-Free Assets Using Index-Tracking and Markowitz Mean-Variance Portfolio Optimization Model. *Journal of Business and Management*, Vol.3, No.7, 2014: 737-751.
- Setyoningsih, Agustin Tri., Suhadak., Topowijoyo. 2015."Analisis Portofolio Optimal Dengan Single index model Untuk Meminimumkan Risiko Bagi Investor di Bursa Efek Indonesia (Studi pada saham indeks Kompas100 periode Februari 2010-Juli 2014)". *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB)*. (Vol.23 No.1). Hlm.1-9. Universitas Brawijaya.
- Khotim, Achmad., Darminto., Topowijoyo. 2014."Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Dengan Menggunakan Model Indeks Tunggal dan Stochastic Dominance Dalam Pengambilan Keputusan Investasi (Studi pada saham-saham Indeks Sri-Kehati yang Listing di Bursa Efek Indonesia periode 2010-2013)". *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB)*. (Vol.11 No.1). Hlm. 1-11. Universitas Brawijaya.
- La, le., dan Bin Mei.2014."Portfolio diversification through timber real estate investment trusts: A Cointegration Analysis".*Forest Policy and Economics*". (Vol.50). Hlm.269-274. University of Georgia.