

## Daftar Pustaka

- Ang, Robert. (1997). *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia*. Jakarta: Mediasoft Indonesia.
- Bart, J. (1992). *International Diversification: Part I – Risk Reduction & Return Enhancement, Canadian Shareowner* 5: 10-11
- Brigham, Eugene F & Houston, Joel F. (2006). *Dasar-Dasar Manajemen Keuangan*. Edisi Kesepuluh. Jakarta: Salemba Empat.
- Bella, Annisa Prinatya dan Siti Aisjah. (2017). *Analisis Kinerja Portofolio Saham dengan Metode Sharpe Ratio, Treynor Ratio, Dan Jensen Alpha (Studi Pada Indeks LQ 45 Yang Terdaftar Di BEI Tahun 2014-2016)* Tesis Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Brawijaya.
- Elton, Edwin J., and Grubber. (1995). *Modern Portfolio Theory and Investment Analysis 5<sup>th</sup> ed.* New York: John Wiley & Sons.
- Fabozzi, Frank J. (1999). *Manajemen investasi*, Jakarta: Salemba Empat.
- Fahmi, Irham. (2013). *Pengantar Manajemen Keuangan Teori dan Soal Jawab*. Bandung: Alfabeta.
- Halim, Abdul. (2015). *Analisis Investasi dan Aplikasinya dalam Aset Keuangan dan Aset Riil*. Jakarta: Salemba Empat.
- Hartono, Jogiyanto, (2010). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFE UGM.
- Hartono, Jogiyanto, (2013). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFE UGM.
- Hartono, Jogiyanto. (2017). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Kesebelas. Yogyakarta: BPFE UGM.
- Hidayat, Anwar. (2014). *Penjelasan dan Teori Uji Kruskal Wallis H*. Sumber artikel : <https://www.statistikian.com/2014/07/uji-kruskal-wallis-h/> 4 Agustus 2020.
- Husnan, Suad, (2005). *Dasar-Dasar Teori Portofolio & Analisis Sekuritas*, Edisi Keempat, Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan AMP & YKPN.

- Ismanto, Hadi. (2016). *Analisis Value at Risk dalam Pembentukan Portofolio Optimal (Studi Empiris Pada Saham-Saham yang Terdaftar dalam LQ45)*. The 3<sup>rd</sup> University Research Colloquium.
- Jones, Charles P. (2000). *Investment Analysis and Management 7<sup>th</sup> ed.* USA: John Wiley & Sons, Inc
- Kulali, Hasan. (2016). *Portofolio Optimization Analysis with Markowitz Quadratic Mean-Variance Model*. *European Journal of Business and Management*, Volume 8 No. 7.
- Kusumawardhani, Srihartati. (2001). *Analisis Reaksi Berlebihan, Efek Bid-Ask, Firm Size, dan Likuiditas dalam Fenomena Price Reversal di Bursa Efek Jakarta*. Tesis UNDIP. Semarang.
- Manurung, Adler Haymans. (2002). *Mengukur Kinerja Portofolio*, *Usahawan*, 11, 41-46.
- Manurung, Adler Haymans. (2019). *Analisis Kinerja Portofolio Saham dengan Menggunakan Metode Sharpe, Jensen dan Treynor*. *Journal of Business Studies*, 4(1), 1-16.
- Mangram, Myles E. (2013). *A Simplified Perspective of The Markowitz Portofolio Theory*. *Global Journal of Business Research* Volume 7 No. 1.
- Markowitz, Harry. (1999). *The Early History of Portofolio Theory: 1600-1960*. *Financial Analysis Journal*, July-August p.5-16.
- Nurlaeli, Siti dan Dwi Artati. (2020). *Analisis Kinerja Portofolio Saham dengan Metode Sharpe, Treynor, dan Jensen (Saham IDX30 Tahun 2015 sampai 2019)*. *Jurnal Ilmiah Mahasiswa Manajemen, Bisnis dan Akuntansi* 2(6).
- Pratomo, Eko Priyo. (2004). *Berwisata ke Dunia Reksa Dana*. Jakarta: Gramedia Media Utama.
- Reilly, Frank K. and Brown Keith C. (1997). *Investment Analysis & Portofolio Management*. Edisi Kelima. Orlando Florida: The Dryden.
- Rudiyanto. (2016). *Sharpe Ratio dan Kelemahannya pada Saat Kinerja Negatif*. Sumber artikel : <http://rudiyanto.blog.kontan.co.id/2016/01/18/sharpe-ratio-dan-kelemahannya-pada-saat-kinerja-negatif/>
- Samsul, Mohammad. (2006). *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Erlangga.

- Samsul, Mohammad. (2015). *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Erlangga.
- Sharpe, William F. (1995). *Risk, Market Sensitivity and Diversification*. *Financial Analyst Journal*. Januari-Februari, pp. 84-88
- Sharpe, William F., Alexander, Gordon J and Bailey Jeffrey V. (2005). *Investment*. Edisi 2. Boston: Pearson Custom Publishing.
- Sugiyono. 2013. *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif, dan R&D*. Bandung: CV Alfabeta.
- Sujadi. (2003). *Metodologi Penelitian Pendidikan*. Jakarta: Rineka Cipta.
- Sulistiyorini, Agustin. (2009). Analisis Kinerja Portofolio Saham Dengan Metode *Sharpe, Treynor* dan *Jensen* (Saham LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2003 Sampai 2007). *Jurnal Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro*.
- Supranto, J. (2009). *Statistik: Teori dan Aplikasi*. Edisi Ketujuh. Jakarta: Erlangga.
- Suryani, Arna dan Eva Herianti. (2015). *The Analysis of Risk Adjusted Return Portofolio Performance Share for LQ45 Index in Indonesia Stock Exchange in 2010-2014 Period*. *Jurnal Universitas Batanghari Jambi dan Universitas Muhammadiyah Jakarta*.
- Tandelilin, Eduardus. (2010). *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi*. Edisi Pertama. Yogyakarta: Kanisius.
- Yuniara, Rissa, Nurdin dan Azib. (2017). Analisis Kinerja Portofolio Saham dengan Menggunakan Indeks *Sharpe, Treynor*, dan *Jensen* (Saham LQ45 yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2012-2015 *Jurnal Universitas Islam Bandung*.
- Zakarias, Vernando A. dan Ferdinand Tumewu. (2015). *Evaluating Portofolio Performance of Companies Stock Listed in LQ45 Based on Sharpe, Treynor, and Jensen Method*. *Jurnal Universitas of Sam Ratulangi Manado*.
- Zubir, Zalmi. (2011). *Manajemen Portofolio: Penerapannya dalam Investasi Saham*. Jakarta: Salemba Empat.