

DAFTAR PUSTAKA

- Anggara, A. W., & Yulianto, A. (2017). Analisis Kinerja Reksadana Saham dengan Metode Sharpe, Treynor dan Jensen. *Management Analysis Journal*, 6(1), 2-3.
- Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. J. (2021). *Investment*. New York: Mcgraw-Hill Education.
- Dewi, A. T. (2019). *Analisis Perbandingan Hasil Pembentukan Portofolio Optimal antara Model Markowitz dan Single Index Model*. Yogyakarta: Universitas Negeri Yogyakarta.
- Fahling, E. J., Ghiani, M., & Simmert, D. (2020). Small versus Large Caps—Empirical Performance Analyses of Stock Market Indices in Germany, EU & US since Global Financial Crisis. *Journal of Financial Risk Management*, 9, 434-453.
- Hartono, J. (2015). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi, Edisi Kesepuluh*. Yogyakarta: BPFE.
- Hulth, E., & Carlsson, A. (2018). *Performance Evaluation of Small- and Large-cap stocks*. Goteborg: University of Gothenburg.
- Keng, T. Y. (2000). Unit Trust Performance Measurement : the Snail Trail Approach. *Pertanika J. Soc. Sci. & Hum*, 103-114.
- Lassance, N. (2022). Reconciling mean-variance portfolio theory with non-Gaussian returns. *European Journal of Operational Research*, 297, 729–740.
- Mafula, Z. (2015). *Portofolio Optimal dengan Penerapan Model Markowitz sebagai Dasar Keputusan Investasi*. Malang: Universitas Brawijaya.

- Mahayani, N. P., & Suarjaya, A. G. (2019). Penentuan Portofolio Optimal Berdasarkan Model Markowitz pada Perusahaan Infrastruktur di Bursa Efek Indonesia. *E-Jurnal Manajemen*, 8(5), 3057-3085.
- Mardhiyah, A. (2017). Peranan Analisis Return dan Risiko dalam Investasi. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Islam*, 2(1), 1-17.
- Rahmawati, R. (2021). *Analisis Kinerja Portofolio Saham LQ45 dan Saham Jakarta Islamic Index Periode 2016-2019*. Yogyakarta: Universitas Gadjah Mada.
- Rizki, N. D. (2021). *Analisis Pengaruh Five Factor Models Fama And French terhadap Excess Return Saham Sebelum dan Saat Terjadinya Covid-19 di Bursa Efek Indonesia Periode Maret 2019 - Maret 2021* . Yogyakarta: Universitas Gadjah Mada.
- Sandhi, N. L., Sedana, I. B., & Artini, L. G. (2017). Studi Komparatif Kinerja Portofolio Saham Small Medium Enterprise (SME) di Pasar Modal Indonesia, Cina dan India. *E-Jurnal Ekonomi dan Bisnis*, 6(8), 3133-3162.
- Suryani, A., & Herianti, E. (2015). The Analysis of Risk Adjusted Return Portfolio Performance Share for LQ45 Index in Indonesia Stock Exchange in 2010-2014 Periods. *Procedia - Social and Behavioral Sciences*, 211, 634 - 643.
- Tandelilin, E. (2017). *Pasar Modal Manajemen Portofolio & Investasi*. Yogyakarta: Kanisius.
- Thomas. (2013). *Kinerja Reksadana Saham Periode 2007-2012 Menggunakan Metode Snail Trail*. Yogyakarta: Universitas Gadjah Mada.