

DAFTAR PUSTAKA

- Albaity, M. S., & Mudor, H. (2012). Return Performance, Cointegration and Short Dynamics of Islamic and Non-Islamic Indices: Evidences from the US and Malaysia during the Subprime Crisis. *Atlantic Review of Economics*, vol.1, 11-22.
- Aryani, Yohanita Dwi. (2011). Analisis Kinerja Portofolio Optimal Saham di Bursa Efek Indonesia tahun 2008-2010: Studi Perbandingan Saham LQ45 dan JII. *Thesis Abstract*. Universitas Diponegoro, Semarang.
- Bawasir, Said dan Jati P Sitanggang. (1994). Memilih Saham untuk Portofolio Saham Optimal. *Usahawan tahun XXIII No 1*, 34-40.
- Bank Indonesia (2019), “Exchange Rates”. Tersedia di <https://www.bi.go.id/en/moneter/informasi-kurs/transaksi-bi/Default.aspx>, diakses pada 30 Juni 2019.
- Bloomberg (2019). “Stock Price”. Tersedia di <https://www.bloomberg.com/asia/>, diakses pada 28 September 2020.
- Fahmi, Johan Tri Marhadi. (2009). Analisis Perbandingan Risk and Return Saham Syariah dengan Saham Konvensional: Studi pada Saham LQ45 dan Jakarta Islamic Index di Bursa Efek Indonesia Periode 2005-2008. *Thesis Abstract*. Universitas Brawijaya, Malang.
- Gitman, Lawrence J., dan Jhoenk (2005), *Fundamental of Investing*. 9th Edition, Pearson International Edition, Pearson.
- Hanafi, Mamduh M. (2012). Perbandingan Kinerja Investasi Syariah dan Konvensional: Studi pada Jakarta Islamic Indeks (JII) dan Indeks LQ45. *Jurnal EKBISI* 7 (1), 16-27.
- Hartono, Jogiyanto (2015), *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, edisi kesepuluh, BPFE, Yogyakarta.
- Husnan (2009), *Dasar-dasar Teori Portofolio & Analisis Sekuritas*, UPP STIM YKPN, Yogyakarta.
- Jones, Charles P., (2004), *Investment*, Prentice-Hall, New York.
- Martono, Su dan Agus D Harjito (2002), *Manajemen Keuangan*, Ekorisia, Yogyakarta.
- Putry, Galishia, Iman Sugema, dan Deni Lubis. (2015). Analisis perbandingan *Excess Return* Jakarta Islamic Index dan Indeks Harga Saham Gabungan. *Jurnal Al-Muzara'ah*, Vol. 2, 121-134.

- Purwati, P., Rinawati, T., dan Santoso, A. (2020), Analisis Perbedaan *Return* Saham Jakarta Islamic Index (JII) dan Indeks LQ45. *Buletin Bisnis & Manajemen*, Vol 6 (1), 65-77.
- Paramitasari, Ratih (2015). Analisis Portofolio Untuk Menentukan Expected Return Optimal dan Risiko Minimal pada Saham Perusahaan Telekomunikasi yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Manajemen dan Organisasi*, Vol. 6 (1), 19-33.
- Reilly, Frank K dan Keith C Brown (2000), *Investment Analysis and Portofolio Management*, Dryden Press, Pennsylvania.
- Samsul, Mohammad (2006), *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*, Erlangga, Jakarta.
- Sharpe, W. F. (1992). Asset allocation: Management Style and Performance Measurement. *Journal of Portofolio Management*, 18 (2), 7-19.
- Singh, Saurabh dan Jajant Gautam. (2014). The Single Index Model & Construction of Optimal Portofolio: A Case of Banks Listed on Nse India. *Risk Governance & Control: Financial Markets & Intitutions*, Vol. 4, 110-115.
- Situs Web Resmi Bursa Efek Indonesia: www.idx.co.id
- Soemitra (2009), *Bank & Lembaga Keuangan Syariah*, Kencana, Jakarta.
- Sukmana, Raditya dan Muhamad Kholid. (2012). Impact of Global Financial Crisis on Islamic and Conventional Stocks in Emerging Market: An Application of ARCH and GARCH Method. *Asian Academy of Management Journal of Accounting & Finance*, 31(2), 357-370.
- Suteja, Jaja dan Ardi Gunardi (2016), *Manajemen Investasi dan Portofolio*, Refika Aditama, Bandung.
- Tandelilin, Eduardus (2017), *Pasar Modal Manajemen Portofolio & Investasi*, Kanisius, Yogyakarta.
- Touiti, Mariem and Jamel E.Henchiri (2017). Risk and Performance of Islamic Indexes during Subprime Crisis. *Available at SSRN 2917060*.