

DAFTAR PUSTAKA

- Abidin, R. (2010). *Analisis Perbandingan Kinerja Portofolio Saham LQ45 dengan Kinerja Portofolio Saham JII*. FEB UGM, Yogyakarta.
- Akbar, A., Hermawan, A., dan Beik, I. S. (2014). Analisis Stabilitas Kinerja Saham Syariah pada ISSI. *Jurnal Ekonomi Islam Republika*, IPB, 23.
- Azizah, S., Sugito, dan Prahutama, A. (2014). Pengukuran Kinerja Portofolio Saham Menggunakan Model Black-Litterman Berdasarkan Indeks Treynor, Indeks Sharpe, dan Indeks Jensen. *Jurnal Gaussian*, Vol. 3, No. 4, 859—868.
- Cahyadin, M., dan Milandari, D. O. (2009). Analisis Efficient Market Hypothesis (EMH) di Bursa Saham Syariah, 2005:1 - 2008:11. *Jurnal Ekonomi Islam*, Vol. III, No. 2, Desember, 223—236.
- Chandra, L., dan Hapsari, Y. D. (2013). Analisis Pembentukan Portofolio Optimal dengan Menggunakan Model Markowitz untuk Saham LQ45 Periode 2008-2012. *Jurnal Manajemen*, Vol I No. 1 Mei, 41—65.
- Djohan, N. V., Murhadi, W. R., & Ernawati, E. (2012). Kinerja Portofolio Syariah dan Portofolio Nonsyariah di Indonesia.
- Hadinata, I., dan Manurung, A. H. (2008). Penerapan Data Envelopment Analysis (DEA) untuk mengukur Efisiensi Kinerja Reksa Dana Saham. *Jurnal Akuntansi*, Vol. 12, No. 1.
- Hamzah, A. (2005). Analisa Ekonomi Makro, Industri dan Karakteristik Perusahaan terhadap Beta Saham Syariah. *SNA VIII*, 367-278.
- Hartono, J. (2014). *Teori dan Praktik Portofolio dengan Excel*. Salemba Empat, Jakarta.
- . (2014). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi: Edisi Kesembilan*. BPFE, Yogyakarta.
- Kompas. (2016, Maret 28). *Ekonomi: Keuangan*. Retrieved from Kompas Web Site: <http://bisniskeuangan.kompas.com/read/2016/03/28/160343826/Kini.Pertumbuhan.Pangsa.Pasar.Investasi.Syariah.Lebih.Dominan>.
- Noviastuty, A. (2011). Evaluasi Kinerja Portofolio antara Saham Syariah dengan Saham Konvensional di Bursa Efek Indonesia. *Performance*, Vol.14, No.2, September, 1—12.
- Otoritas Jasa Keuangan. (2014). *Pasar Modal*. Retrieved from Otoritas Jasa Keuangan: <http://www.ojk.go.id/id/kanal/pasar-modal/Pages/Syariah.aspx>
- Patari, E. J., Leivo, T. H., dan Honkapuro, J. S. (2010). Enhancement of Value Portfolio Performance using Data Envelopment Analysis. *Studies in Economics and Finance*, Vol. 27 Iss 3, 223—246.

- Puspitaningtyas, Z. (2012). Relevansi Nilai Informasi Akuntansi dan Manfaatnya bagi Investor. *Jurnal Ekonomi dan Keuangan*, Vol. 16, No. 2, Juni, 164—183.
- Rita, M. R. (2009). Investasi Berbasis Syariah di Pasar Modal Indonesia. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis*, Vol.XV, No. 1, Maret, 47—54.
- Santoso, S. (2010). *Statistik Nonparametrik, Konsep dan Aplikasi dengan SPSS*. PT Elex Media Komputindo, Jakarta.
- Sudarsana, I. B., Sedana, I. P., dan Artini, L. S. (2014). Pembentukan Portofolio Optimal Pada Saham-Saham Indeks IDX30 Di PT Bursa Efek Indonesia. *E-Jurnal Ekonomi dan Bisnis Universitas Udayana*, Vol. 03, No. 02.
- Sukapti, P. (2006). *Evaluasi Kinerja Portofolio Saham Non Syariah dengan Saham Syariah*. FEB UGM, Yogyakarta.
- Tandelilin, E. (2010). *Portofolio dan Investasi: Teori dan Aplikasi*. Kanisius, Yogyakarta.
- Utami, R., dan Nugraha, M. P. (2011). Analisis Kinerja Saham Syariah dan Pengaruhnya Terhadap Respon Pasar pada Perusahaan yang tercatat di Jakarta Islamic Index. *Jurnal Review Akuntansi dan Keuangan*, ISSN: 2088-0685, Vol. 1 No. 2, Oktober, 161—172.
- Werastuti, D. N. (2014). Pembentukan Portofolio Optimal melalui Pendekatan Efisiensi Decision-Making Units (DMU) yang menghasilkan Realitve Efficiency Score berdasarkan Single Index Model. *Jurnal Ilmiah Akuntansi dan Humanika*, Vol. 3, No. 2, 1262—1289.
- Witrayana, P. D. (2013). *Evaluasi Kinerja Portofolio Data envelopment Analysis (DEA): Perbandingan dengan Indeks Kompas 100 dan IHSG*. FEB UGM, Yogyakarta.
- Wulandari, R. S., Gunarta, K., dan Pratiwi, S. G. (2013). Perancangan Portofolio Saham Perusahaan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia dengan Metode DEA dan Single Index Model. *Prosiding Seminar Nasional Manajemen Teknologi XVIII*, A-34:1—9.