

DAFTAR PUSTAKA

- Agusthine, A. P., & Puspitasari, D. M. (2023). Analisis Perbandingan Kinerja Portofolio Optimal pada Strategi Aktif Dengan Metode *Sharpe*, *Treynor*, dan *Jensen* Sebelum dan selama Pandemi Covid-19. *JlIP: Jurnal Ilmiah Ilmu Pendidikan*, 6(2), 1283–1289. <https://doi.org/https://doi.org/10.54371/jljp.v6i2.1684>
- Aprilianti, A., Suharti, T., & Azis, A. D. (2022). Analisis Kinerja Portofolio Saham Dengan Metode *Sharpe*, *Treynor*, *Jensen* (Saham IDX 30 Tahun 2017 Sampai 2021). *MANAGER: Jurnal Ilmu Manajemen*, 5(3), 329–338. <https://doi.org/10.21608/pshj.2022.250026>
- Artini, L. G. S., Darmayanti, N. P. A., & Sudiartha, G. M. (2020). Pengujian Anomali Size Effect Di Pasar Modal Indonesia. *Matrik: Jurnal Manajemen, Strategi Bisnis Dan Kewirausahaan*, 158. <https://doi.org/10.24843/matrik:jmbk.2020.v14.i02.p03>
- Bukit, P., Surono, Y., & Astriana, N. (2019). Analisis Perbedaan Kinerja Saham Perusahaan Berdasarkan Model *Sharpe*, *Treynor*, *Jensen* dan *Sortino* Pada Kelompok Saham LQ 45 Di Bursa Efek Indonesia Periode 2010 – 2018. *J-MAS (Jurnal Manajemen Dan Sains)*, 4(2), 307–317. <https://doi.org/10.33087/jmas.v4i2.112>
- Damayanti, M., Suharti, T., & Yudhawati, D. (2021). Penilaian Kinerja Portofolio Saham Syariah dengan Metode *Sharpe*. *Manager: Jurnal Ilmu Manajemen*, 4(1). Retrieved from <http://ejournal.uika-bogor.ac.id/index.php/Manager/article/view/4353>
- Darmayanti, N. P. A., Suryantini, N. P. S., Rahyuda, H., & Dewi, S. K. S. (2018). Perbandingan Kinerja Reksa Dana Saham Dengan Metode *Sharpe*, *Treynor*, dan *Jensen*. *Jurnal Riset Ekonomi Dan Bisnis*, 11(2), 93–107. <https://journals.usm.ac.id/index.php/jreb/article/view/1079>
- Devianto, D., Maiyastri., Randy., Hamidi, S. M. & A. W., & Ahmad. (2018). Efficiency Analysis of Optimal Portfolio Selection for Stocks in LQ45 Index. *International Conference on Applied Information Technology and Innovation (ICAITI)*, 78–83. <https://doi.org/10.1109/ICAITI.2018.8686713>
- Dian, Pandu., & Aria Zabdi. 2017. Pusat Edukasi dan Informasi Pasar Modal. Yogyakarta
- Ghozali, I. 2018. Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS. Yogyakarta: Universitas Diponegoro
- Halim, Abdul. (2005). *Analisis Investasi (Edisi Kedua)*. Jakarta: Salemba Empat
- Hariyani, I., & Serfianto, R. 2010. *Bebas Jeratan Utang Piutang*. Yogyakarta: Pustaka Yustisia
- Hartono, J. (2017). *Teori Porrtfolio dan Analisis Investasi*, Edisi sebelas. Yogyakarta: BPFE
- Hidayat, Anwar. (2014). *Penjelasan dan Teori Uji Kruskal Wallis H*. Diakses pada

10 Desember 2023, dari <https://www.statistikian.com/2014/07/uji-kruskall-wallis-h.html?amp>

- Indonesia. 1995. *Undang-Undang Nomor 8 Tahun 1995 tentang Pasar Modal*. Lembaran Negara RI Tahun 1995, No. 8. Sekretariat Negara. Jakarta
- Iskandar, D., Martalena, M., & Julianto, N. D. (2020). Perbandingan Kinerja Portofolio yang Dibentuk dengan Single Index Model pada Saham-Saham yang Terdaftar dalam Indeks LQ45 dan Kompas 100 Tahun 2018. *Jurnal Akuntansi Maranatha*, 12(1), 73–83. <https://doi.org/10.28932/jam.v12i1.2041>
- Kamaludin, & Indriani, R. (2012). *Manajemen Keuangan “Konsep Dasar dan Penerapannya”*, Edisi Revisi. In CV. Mandar Maju
- Kasmir. (2012). *Analisis Laporan Keuangan*. Jakarta: PT. Raja Grafindo Persada.
- KSEI. (2022). Statistik Pasar Modal Indonesia. *Publikasi PT Kustodian Sentral Efek Indonesia*, 1–6. https://www.ksei.co.id/publications/demografi_investor
- Ma’ula, Z., Rahayu, S. R., & Zahroh ZA, Z. Z. (2018). Portofolio Optimal Dengan Penerapan Model Markowitz Sebagai Dasar Keputusan Investasi (Studi Pada Perusahaan yang Tergabung Dalam Indeks LQ-45 Tahun 2014). *Jurnal Administrasi Bisnis*, 63(1), 17-23
- Manurung, H. (2019). Analisis Kinerja Portofolio Saham Dengan Menggunakan Metode Sharpe, Jensen, dan Treynor. *Journal Of Business Studies*, 4(1), 1-16. <http://journal.uta45jakarta.ac.id/index.php/jbsuta>
- Markowitz, H. (1952). Portfolio Selection. *The Journal Of The American Finance Association*. <https://doi.org/https://doi.org/10.1111/j.1540-6261.1952.tb01525.x>
- Martalena, & Malinda. (2011). *Pengantar Pasar Modal*. Edisi Pertama. Yogyakarta: Andi
- Masluqiyah, D. (2019). *Pentingnya Investasi Di Usia Muda*. Unair News. <https://news.unair.ac.id/2019/11/19/penringnya-investasi-di--usia-muda/?lang=id>
- Nadeak, F., Indriati, T., & Riskarini, D. (2022). Perbandingan Kinerja Portofolio Saham Bumn Yang Terdaftar Di Indeks Bisnis-27 Menggunakan Model Sharpe, Treynor, dan Jensen. *Jurnal Universitas Pancasila*, 2(2), 104–118. <https://journal.univpancasila.ac.id/index.php/JIMP/article/view/3332>
- Nurlaeli, S., & Artati, D. (2020). Analisis Kinerja Portofolio Saham Dengan Metode Sharpe, Treynor, dan Jensen (Saham IDX30 Tahun 2015 Sampai 2019). *JIMMBA: Jurnal Ilmiah Mahasiswa Manajemen, Bisnis Dan Akuntansi*, 2(6), 972–990. <https://doi.org/https://doi.org/10.32639/jimmba.v2i6.690>
- Pandu, D., & Zabdi, A. (2017). *Pusat Edukasi dan Informasi Pasar Modal*. Yogyakarta
- Pradnyaparamita, N. M. W., & Rahyuda, H. (2017). Pengujian Anomali Pasar January Effect Pada Perusahaan LQ45 Di Bursa Efek Indonesia. *E-Jurnal Manajemen Unud*, 6(7), 3513–3539. <https://ojs.unud.ac.id/index.php/manajemen/article/view/30155>

- Prinatya, A. B., & Aisjah, S. (2017). Analisis Kinerja Portofolio Saham Dengan Metode *Sharpe Ratio*, *Treynor Ratio*, dan *Jansen Alpha* (Studi Pada Indeks Lq 45 Yang Terdaftar Di Bei Tahun 2014-2016). *Jurnal Ilmiah Mahasiswa Feb Universitas Brawijaya*, 5(2), 1–15. <https://jimfeb.ub.ac.id/index.php/jimfeb/article/view/4051/0>
- Puspita, N. L. P. M. D., & Purnawati, N. K. (2019). Kinerja Portofolio Saham Berdasarkan Ukuran Perusahaan. *E-Jurnal Manajemen*, 8(12), 7196–7215. <https://doi.org/10.24843/ejmunud.2019.v08.i12.p15>
- Samsul, Mohamad. (2015). *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*, Edisi 2. Jakarta: Erlangga
- Scott, Gordon. (2021). *Outperform: Definition and Examples in Finance and Investing*. Diakses pada 10 Desember 2023, dari https://www.investopedia.com.translate.google/terms/o/outperform.asp?_x_tr_sl=en&_x_tr_tl=id&_x_tr_hl=id&_x_tr_pto=tc
- Silaban, P., & Jumiadi. (2014). Pengaruh Variabel-variabel Keuangan dan Non Keuangan Terhadap Initial Return. *Jurnal Akuntansi, Keuangan, dan Perpajakan Indonesia*, 05(01), 123-147. DOI: <https://doi.org/10.24114/jakpi.v5i01.7610>
- Sinaga, M. H., Tarigan, W. J., & Saragih, M. (2022). Pengukuran Kinerja Portofolio Investasi Dengan Menggunakan Indeks *Sharpe* Pada Emiten Sektor Transportasi Dan Logistik Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Sebelum Dan Selama Masa Pandemic Covid - 19. *Owner: Riset & Jurnal Akuntansi*, 6(4). 3541-3552. <https://doi.org/10.33395/owner.v6i4.1200>
- Sintia, I., Pasarella, M. D., & Nohe, D. H. (2022). Perbandingan Tingkat konsistensi Uji Distribusi Normalitas Pada Kasus Tingkat Pengangguran di Jawa. Prosiding Seminar Nasional Matematika, Statistika, dan Aplikasinya. 322-333. <https://jurnal.fmipa.unmul.ac.id/index.php/SNMSA/article/view/844>
- Sodikin, A. (2020). Kinerja Portofolio Dengan Metode Sharp, Jensen Dan Treynor Pada Saham Industri Tekstil Di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Manajemen Bisnis Krishnadwipayana*, 8(1), 1–9. <https://doi.org/10.35137/jmbk.v8i1.382>
- Sugiyono. (2018). *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif, dan R & D*. Bandung: Alfabeta
- Sukamulja, Sukmawati. (2017). *Pengantar Permodelan Keuangan dan Analisis Pasar Modal (Edisi 1)*. Yogyakarta: Andi Offset
- Susilowati, D., Juwari, J., & Noviadinda, C. (2020). Analisis Kinerja Portofolio Saham Dengan Menggunakan Metode Indeks *Sharpe*, *Treynor* Dan *Jensen* Pada Kelompok Saham Indeks Sri-Kehati Di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal GeoEkonomi*, 11(1), 122–139. <https://doi.org/10.36277/geoekonomi.v11i1.117>
- Tandelilin, E. (2010). *Portofolio dan Investasi: Teori dan Aplikasi* (Edisi Pert). Kanisius
- Widaresti, A. L. (2019). Analisis Pengukuran Kinerja Reksa Dana Saham Sebagai Suatu Evaluasi Portofolio Investor Di Pasar Modal Dengan Metode Pengukuran *Sharpe*, *Treynor*, Dan *Jensen* (Studi Kasus Pada Bursa Efek Indonesia Tahun 2013 – 2017). *Jurnal Perilaku Dan Strategi Bisnis*, 7(2).

<https://doi.org/10.26486/jpsb.v7i2.637>

- Winarto, W. W. A. (2021). Analisis Komparasi Kinerja Saham Yang Terdaftar Di Jakarta Islamic Indeks Sebelum dan Selama Pandemi COVID 19. *Jurnal Manajemen Dayasaing*, 23(2), 146-156. <https://journals.ums.ac.id/index.php/dayasaing/article/view/16015/7269>
- Wiyono, G. & Kusuma, H. (2017). *Manajemen Keuangan Lanjutan (Berbasis Corporate Value Creation)*. Yogyakarta: UPP STIM YKPN
- Yani, A. R., Sudarma, M., & Prihatiningtias, Y. W. (2014). January Effect Dan Size Effect Pada Perusahaan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia. *E/ Muhasaba: Jurnal Akuntansi*, 4(2). <https://doi.org/10.18860/em.v4i2.2452>
- Yunita, Irni. (2018). Markowitz Model Dalam Pembentukan Portofolio Optimal (Studi Kasus Pada Jakarta Islamic Index). *Jurnal Manajemen Indonesia*, 18(1). <https://doi.org/10.25124/jmi.v18i1.1262>
- Yuri, I. A., Lisadi, N. O., & Sari, M. R. (2021). Analisis Kinerja Portofolio Saham Perusahaan Pada Sektor Jasa Penerbangan di Beberapa Negara ASEAN. *JIAKES: Jurnal Ilmiah Akuntansi Kesatuan*, 9(3). 563-574. <https://doi.org/10.37641/jiakes.v9i3.905>
- Zubir, Zalmi. (2011). *Manajemen Portofolio: Penerapannya Dalam Investasi Saham (Cetakan ke-1)*. Jakarta: Salemba Empat

