

DAFTAR PUSTAKA

- Bursa Efek Indonesia. (2021). *IDX Stock Index Handbook (12 ed.)*. Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Fahmi, I. (2015). *Pengantar Manajemen Keuangan Teori dan Soal Jawab*. Bandung: Alfabeta.
- Finance.yahoo.com. (2022, 5 Januari). *Data Historis Saham*. Diakses pada 5 Januari 2022: <https://finance.yahoo.com/quote/%5EJKSE/history>.
- Ghozali, I. (2007). *Manajemen Risiko Perbankan*. Semarang: Universitas Diponegoro.
- Hanafi, M. (2006). *Manajemen Risiko*. Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan STIM YKPN.
- Hartono, J. (2016). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPEE.
- Husnan, S. (2001). *Dasar-dasar Teori dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: AMP YKPN.
- Ihsan, I. F. (2012). *Value at Risk Menggunakan Variance-Covariance*. Surakarta: Universitas Sebelas Maret.
- Ikhsan, A., Dwi, I., dan Rita, R. (2014). Penggunaan Pendekatan Capital Asset Pricing Model dan Variance-Covariance dalam Proses Manajemen Portofolio Saham. *Jurnal Gaussian* 3(1), 21-30.
- Jorion, P. (2007). *Value At Risk-The New Benchmark For Managing Financial Risk*. New York: McGram-Hill Education.
- Kustodian Sentral Efek Indonesia. (2021). *Peran Strategis KSEI Dalam Meningkatkan Stabilitas Pasar Modal*. Jakarta: Kustodian Sentral Efek Indonesia.
- Mardison, P., Sudarno, dan Mukid, M. A. (2014). Optimalisasi Portofolio Menggunakan Capital Asset Pricing Model (CAPM) Dan Mean Variance Effecient Portfolio (MVEP). *Jurnal Gaussian* 3(3), 481-490.
- Martalena dan Melinda. (2011). *Pengantar Pasar Modal*. Yogyakarta: Andi.
- Martono dan Harjito, A. D. (2002). *Manajemen Keuangan*. Yogyakarta: Ekonosia.
- Mulyono, S. (2004). *Riset Operasi*. Jakarta: Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia.

- Rasmussen, M. (2003). *Quantitative Portfolio Optimisation Asset Allocation and Risk*. New York: Palgrave Macmillan.
- Sapto, R. (2006). *Kiat Membangun Aset Kekayaan (Panduan Investasi Saham)*. Jakarta: Elex Media Komputindo.
- Siregar, S. (2017). *Statistika Parametrik Untuk Penelitian Kuantitatif*. Jakarta: Bumi Askara.
- Situmorang, P. (2008). *Pengantar Pasar Modal (1ed)*. Jakarta: Mitra.
- Sudirman. (2015). *Pasar Modal Dan Manajemen Portofolio*. Gorontalo: Sultan Amai Press.
- Suhartono, A., Sugito., dan Rahmawati, R. (2015). Analisis Kinerja Portofolio Optimal Capital Asset Pricing Model (CAPM) dan Model Black Litterman. *Jurnal Gaussian* 4(3), 421-429.
- Sunariyah. (2014). Perhitungan Nilai Ekspektasi Return Dan Risiko Dari Portofolio Dengan Menggunakan Mean-Variance Effecient Portofolio. *Buletin Ilmiah Math Stat dan Terapannya (Bimaster)* 3(1), 51-56.
- Tandelilin, E. (2001). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Yogyakarta: BPFE.
- www.bi.go.id. (2021, 30 Desember). *BI 7-day (Reverse) Repo Rate*. Diakses pada 5 Januari 2022: <https://www.bi.go.id/id/statistik/indikator/bi-7day-rr.aspx>.
- www.idx.co.id. (2021, 1 Oktober). *Evaluasi Minor Indeks Pefindo I-Grade dan Indeks Infobank15*. Diakses pada 12 Januari 2022: <https://www.idx.co.id/data-pasar/data-saham/indeks-saham/>.