

DAFTAR PUSTAKA

- Adnyana, I. M. (2020). *Manajemen Investasi dan Portofolio*. Lembaga Penerbit Universitas Nasional (LPU-UNAS)
- Aliani, D. B. A. (2018). Analisis perbandingan pembentukan portofolio optimal dari saham-saham indeks bisnis 27 dengan menggunakan metode *single index model* (sim) & *capital asset pricing model* (CAPM) periode november 2012–april 2017 (Bachelor's thesis, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah Jakarta).
- Darmawi, H. (2016). *Manajemen Risiko Edisi 2*. Jakarta: Bumi Aksara.
- Dewi, K. I. T., & Yudiaatmaja, F. (2023). Pengaruh net profit margin, debt to equity ratio dan earning per share terhadap return saham pada perusahaan sub sektor otomotif dan komponen yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *Prospek: Jurnal Manajemen dan Bisnis*, 5(2).
- Dhananjaya, I. M. N., & Yudiaatmaja, F. (2025). Analisis perbandingan keakuratan *single index model* (SIM) dan *capital asset pricing model* (CAPM) dalam memprediksi return saham IDX INFOBANK 15 di Bursa Efek Indonesia (periode 2022–2024). *BJM*, 11(2).
- Fahmi, I. (2012). *Manajemen investasi: Teori dan soal jawab*. Bandung: Alfabeta.
- Fauziah, F. (2017). *Kesehatan bak, kebijakan dividen, dan nilai perusahaan: Teori dan kajian empiris*. Samarinda: RV Pustaka Horizon.
- Ghozali, I. (2016). *Aplikasi analisis multivariate dengan program IBM SPSS 23*. Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Halim, A. (2018). *Analisis investasi dan aplikasinya dalam aset keuangan dan aset riil* (Edisi ke-2). Jakarta: Salemba Empat.
- Hanafi, M. M. (2010). *Manajemen risiko*. Yogyakarta: UPP STIM YKPN.
- Harefa, Aryetty Yulia Sari. "Perbandingan Kinerja Portofolio Saham LQ-45 Menggunakan Single Index Model dan Capital Asset Pricing Model pada Periode Agustus 2010-Januari 2011, Universitas Telkom, 2011.
- Hartono, J. (2017). *Teori portofolio dan analisis investasi* (Edisi ke-11). Yogyakarta: BPFE.
- Jones, C. P., Sigit, H. P., & Endri. (2009). *Investments analysis and management (An Indonesian adaptation)*. Salemba Empat.
- Mappadang, A. (2021). *Manajemen Investasi dan Risiko*, Cetakan Pertama. CV. Pena Persada. Banyumas, Jawa Tengah.

- Mayo, H. B. (2014). *Investments: An introduction*. USA: Cengage Learning.
- Ningrum, E. R., Waskita, J., & Utami, Y. (2018). *Analisis pembentukan portofolio optimal dengan metode stochastic dominance dan single index model pada saham industri real estate and property di Bursa Efek Indonesia*. PERMANA, 10(1).
- Nur Iskandar, M. (2019). *Studi Komparatif Keakuratan Dengan Menggunakan Metode Capital Asset Pricing Model (CAPM) Dan Single Index Model (Sim) Pada Indeks Idx30* (Doctoral dissertation, Universitas Pancasakti Tegal).
- Purnayasa, I. (2024). *Analisis Perbandingan Keakuratan CAPM) dan APT dalam memprediksi Actual Return Saham pada Perusahaan Sektor Perbankan yang terdaftar di BEI periode 2022-2023* (Doctoral dissertation, Politeknik Negeri Bali).
- Putra, Y. P., Setiorini, H., & Suhendra, C. (2023). *Analisis Keakuratan Capital Asset Pricing Model Dan Arbitrage Pricing Theory Dalam Memprediksi Return Saham (Studi Pada Perusahaan LQ 45 Di Bursa Efek Indonesia Periode 2016-2020)*. *Ekombis Review: Jurnal Ilmiah Ekonomi Dan Bisnis*, 11(1), 839-848.
- Rahmadi, R. (2023). *Analisis metode Capital Asset Pricing Model (CAPM) dan Single Index Model (SIM) untuk menentukan pilihan berinvestasi pada saham LQ45 Di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2018-2022* (Doctoral dissertation, Fakultas Ekonomi Dan Bisnis Universitas Pakuan).
- Rantemada, C. J., Pelleng, F. A., & Mangindaan, J. V. (2021). *Analisis perbandingan keakuratan metode Capital Asset Pricing Model (CAPM) dan Arbitrage Pricing Theory (APT) dalam memprediksi return saham*. *Productivity*, 2(7), 567-570.
- Rifkiansyah, D. (2025). *Analisis Perbandingan Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Metode Single Index Model dan Capital Asset Pricing Model pada Saham Syariah yang Terdaftar Dalam IDX-MES BUMN 17 2021-2024* (Doctoral dissertation, UIN KH Abdurrahman Wahid Pekalongan).
- Riwu, Y. F., Natonis, S. A., Kamuri, K. J., Faah, Y. S., & Manongga, I. R. (2024). *Analisis perbandingan kinerja dan risiko portofolio optimal saham Kompas 100 menggunakan single index model dan capital asset pricing model periode 2020-2023*. *Bisman (Bisnis dan Manajemen): Jurnal Bisnis dan Manajemen*, 7(1), 112–123.
- Sugiyono. (2023). *Metode Penelitian kuantitatif, kualitatif, dan R&D (C ke-5)*. Bandung: Penerbit Alfabeta.
- Tandelilin, E. (2010). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio* (Edisi

pertama). Yogyakarta: BPFE.

Tandelilin, E. (2017). *Pasar Modal, Manajemen Portofolio & Investasi*. Yogyakarta: PT Kanisius.

Tannadi, B. (2020). *Ilmu saham: Pengenalan saham*. Elex Media Komputindo.

Tanudjaja, D. E. A. (2014). Analisis akurasi ekspektasi return pada saham pembentuk ilq'45 di bursa efek indonesia.

Tanudjaja, D. E. A., Gumanti, T. A., & Singgih, M. (2014). Analisis Akurasi Return Ekspektasi pada Saham Pembentuk Ilq'45 di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Universitas Paramadina*. Vol, 11(3).

Zahroh, F., Irmadariyani, R., & Wardhaningrum, O. A. (2024). Komparasi Capital Asset Pricing Model dan Arbitrage Pricing Theory dalam memprediksi return saham. *Diversification: Journal of Economics and Management Studies*, 1(1), 1–13.

