

DAFTAR PUSTAKA

- Acharya, v. v. dan Pedersen, L. H. (2005). *Asset Pricing with Liquidity Risk*. *Journal of Financial Economic* 77, 375 – 410. ISBN: 0304-405X. Elseiver.
- Anggaraini, R. (2013). Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Model Indeks Tunggal Untuk Pengambilan Keputusan Investasi. *Jurnal Ilmu & Riset Akutansi* Vol.2 No.6.
- Bi.go.id. (2016). Data Suku Bunga Bank Indonesia [online]. *Retrieved from:* <http://www.bi.go.id/id/moneter/bi-rate/data/Default.aspx> [Diakses tanggal 15 Januari 2017]
- Cahyati, N. (2015). Analisis Portofolio Optimum Saham Syariah Menggunakan *Liquidity Adjusted Capital Asset Pricing Model (LCAPM)*. *Journal Fourier* Vol. 4, No. 1, 80-101 ISSN: 2252-763X.
- Fahmi, I. (2015). *Pengantar Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, Cetakan Kesatu. Bandung: Alfabeta (IKAPI)
- Hadad, M. D. ; Wibowo, S. dan Pertiwi, D. (2004). Indeks Saham Perbankan, Direktorat Penelitian dan Pengaturan Perbankan. Bank Indonesia. *Retrieved from:* www.bi.go.id/id/.../1b075dd302ad477582385b46848c4a48SahamPerbankan.pdf [diakses tanggal 5 Januari 2017]
- Hagstromer, B.; Hansson, B. dan Nilsson, B. (2013). *Illiquidity Friction and Asset Pricing Anomalies*. Sweden: EFMA. *Retrieved from:* http://www.efmaefm.org/0EFMAMEETINGS/EFMA%20ANNUAL%20MEETINGS/2014-Rome/papers/EFMA2014_0481_fullpaper.pdf [diakses tanggal 17 Januari 2017]
- Hartono, J. (2016). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, Edisi Kesepuluh. Yogyakarta: BPFE (IKAPI)
- Idx.co.id. (2017). Daftar Perusahaan yang Menerbitkan Laporan Keuangan dalam 3 triwulan selama tahun 2016 [online]. *Retrieved from:* <http://www.idx.co.id/id-id/beranda/perusahaantercatat/laporankeuangandantahunan.aspx> [diakses tanggal 3 Januari 2017]

- Indrawati (2015). *Metode Penelitian Manajemen dan Bisnis Konvergensi Teknologi Komunikasi dan Informasi*. Cetakan Kesatu. Bandung : PT. Refika Aditama (IKAPI)
- Indriantoro, N. dan Supomo, B. (2013). *Metodologi Penelitian Bisnis*. Edisi pertama cetakan keenam. Yogyakarta: BPF (IKAPI)
- Investopedia.com (2017). Liquidity [online]. Retrieved from: <http://www.investopedia.com/terms/l/liquidity.asp> [diakses tanggal 19 Maret 2017]
- KSEI, *Press Release*. (2015). Peningkatan Jumlah Investor Catat Rekor Tertinggi. Jakarta: PT. Kustodian Sentral Efek Indonesia [online]. Retrieved from: http://www.ksei.co.id/files/uploads/press_releases/press_file/id-id/116_siaran_pers_akhir_tahun_20160211113355.pdf [diakses tanggal 12 September 2016]
- KSEI, *Press Release*. (2016). Raih Rekor Baru, Jumlah Investor Tercatat Naik 26%. Jakarta: PT. Kustodian Sentral Efek Indonesia [online]. Retrieved from: http://www.ksei.co.id/files/uploads/press_releases/press_file/idid/121_berita_pers_raih_rekor_baru_jumlah_investor_tercatat_naik_26_20161011153422.pdf [diakses tanggal 3 Januari 2016]
- Li, B.; Sun, Q. dan Wang, C. (2014). *Liquidity, Liquidity Risk and Stock Returns: Evidence from Japan*. European Financial Management, Vol. 20, No. 1, 126-151. EFMA.
- Liputan6.com, (2016). Kapitalisasi Pasar Modal RI Terbesar di Asia Tenggara [online]. Retrieved from: <http://bisnis.liputan6.com/read/2557488/kapitalisasi-pasar-modal-ri-terbesar-di-asia-tenggara> [diakses tanggal 9 Januari 2017]
- Oktafiani, H. E.; Maruddani D.A.I. dan Suparti (2016) Penerapan Model Indeks Tunggal Untuk Optimalisasi Portofolio dan Pengukuran *Value At Risk* dengan *Variance Covariance*. Jurnal Gaussian volume 6 nomor 1. ISSN : 2339-2541
- Ojk.go.id, (2016). Statistik Pasar Modal (Desember minggu ke-3 2016). [online] Retrieved from: <http://www.ojk.go.id/id/kanal/pasar-modal/data-dan-statistik/statistik-pasar-modal/Default.aspx> [Diakss tanggal 10 Januari 2017]
- Reksadana.danareksaonline.com. (2015). Perbandingan Return Deposito, Saham dan Tingkat Inflasi pada tahun 2004 hingga 2014 [online]. Retrieved from:

<http://reksadana.danareksaonline.com/berita/artikel-dan-tips/back-to-basic-long-term-investing.aspx> [diakses tanggal 5 Januari 2017]

- Saad, M. dan Samet, A. (2014). *Pricing, dynamics, and determinants of illiquidity risks: International evidence*. Emerging Market Review 23. Elsevier : 1566-0141.
- Sugiartawan, P.; Ramantha, I. W. dan Susrusa K. B. (2013). Analisis Portofolio Saham Perusahaan Agribisnis di Bursa Efek Indonesia. Jurnal Manajemen Agribisnis Vol. 1 No.1 ISSN 2355-0759.
- Tandelilin, E. (2010). *Portofolio dan Investasi*. Edisi Pertama. Yogyakarta : Kanisius (IKAPI)
- Tribunnews.com, (2016). Pencapaian Bursa Efek Indonesia Terbaik di Asia Tenggara .Retrieved from: <http://banjarmasin.tribunnews.com/2016/07/14/pencapaian-bursa-efek-indonesia-terbaik-di-asia-tenggara> [diakses tanggal 9 Januari 2017]
- Vu, V., Chai, D. dan Do, V. (2015). *Empirical Tests on The Liquidity adjusted Capital Asset Pricing Model*. Pasific Basin Finance Journal 35. Elsevier : 0927-538X
- Yahoo Finance. (2016). Perbandingan Indeks LQ-45,JII dan IHSG Agustus 2015-Agustus 2016. Retrieved from: <https://finance.yahoo.com/chart/%5EJKSE#> [Diakses tanggal 1 Desember 2016]
- Zubir, Z. (2011). *Manajemen Portofolio : Penerapannya Dalam Investasi Saham*. Jakarta : Salemba Empat

