

DAFTAR PUSTAKA

- Adnyana, I.M. (2020) “Buku: Manajemen Investasi dan Portofolio.”
- Atmaja, H.J. (2011) *Analisis Pemilihan Portofolio Optimal pada 27 Saham Indeks LQ45 Bursa Efek Indonesia 2006–2008*. Skripsi/Tesis. Jakarta: Universitas Terbuka.
- Anwar, A., Hasbiah, S. dan Bado, B. (2022) “Model Markowitz Dalam Keputusan Investasi Saham Pada Index Lq45 di Bursa Efek Indonesia,” *Jekpend Jurnal Ekonomi dan Pendidikan*, 5(1), hlm. 69–77.
- Bodie, Z., Kane, A. dan Marcus, A.J. (2014) “Investments 10th ed.” McGraw Hill.
- Connor, G., Goldberg, L.R. dan Korajczyk, R.A. (2010) *Portfolio risk analysis*. Princeton University Press.
- Darmayuda, I.B.A., Dharmawan, K. dan Sari, K. (2023) “Estimasi Expected Shortfall dalam Optimalisasi Portofolio dengan Metode Downside Deviation pada Saham IDXHEALTH,” *E-Jurnal Matematika*, 12(2), hlm. 114–120.
- Dewi, E.K., Ispriyanti, D. dan Rusgiyono, A. (2021) “Expected Shortfall Pada Portofolio Optimal Dengan Metode Single Index Model (Studi Kasus pada Saham IDX30),” *Jurnal Gaussian*, 10(2), hlm. 269–278.
- Hanum, A.F. dan Rohaeni, O. (2021) “Optimasi Return Saham Perusahaan Makanan dan Minuman pada Saat Pandemi Covid-19 dengan Menggunakan Pendekatan Multiobjektif,” dalam *Bandung Conference Series: Mathematics*, hlm. 7–14.
- Hidayat, W.W. (2019) *Konsep dasar investasi dan pasar modal*. Uwais Inspirasi Indonesia.
- Krisnawan, O.O.B. (2019) “Optimalisasi portofolio investasi program tunjangan hari tua (THT) pada PT Taspen (persero),” *Indonesian Treasury Review: Jurnal Perbendaharaan, Keuangan Negara dan Kebijakan Publik*, 4(1), hlm. 59–69.
- Nisa, B.K., Rohaeni, O. dan Harahap, E. (2023) “Perbandingan Metode Mean-Semivariance Dan Mean Absolute Deviation Untuk Menentukan Portfolio

- Optimal Menggunakan Python,” dalam *Bandung Conference Series Mathematics*, hlm. 129–140.
- Nugrahaeni, I., Perdana, H. dan Satyahadewi, N. (2024) “Perbandingan Value at Risk dan Expected Shortfall pada Portofolio Optimal menggunakan Metode Downside Deviation,” *Jambura Journal of Mathematics*, 6(2), hlm. 176–181.
- Prasetya, L.B., Ispriyanti, D. dan Prahutama, A. (2018) “Estimasi Value at Risk Portofolio Saham Menggunakan Metode GARCH-Copula (Studi Kasus: Harga Penutupan Saham Harian Unilever Indonesia dan Kimia Farma Periode 1 Januari 2013-31 Desember 2016),” *Jurnal Gaussian*, 7(4), hlm. 397–407.
- Pratama, I.P.Y., DHARMAWAN, K. dan Sari, K. (2022) “Estimasi Risiko Pasar Dengan Lvar Dan Expected Shortfall Menggunakan Simulasi Monte Carlo,” *E-Jurnal Matematika*, 11(2), hlm. 87.
- Primajati, G. dan Amrullah, A.Z. (2019) “Analisis Portofolio Investasi dengan Metode Multi Objektif,” *Jurnal Varian*, 3(1), hlm. 6–12.
- Putra, A.P. (2016) “Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio.” Yogyakarta: Pustaka Pelajar.
- Ramadhan, R.D., Handayani, S.R. dan Endang, M.G.W. (2014) “Analisis pemilihan portofolio optimal dengan model dan pengembangan dari portofolio Markowitz (studi pada indeks BISNIS-27 di Bursa Efek Indonesia periode 2011-2013),” *Jurnal Administrasi Bisnis*, 14(1).
- Ridha, M.N.N. dan Khoiruddin, M. (2018) “Konsistensi Pengukuran Value at Risk pada Saham Syariah dengan Metode Historis,” *Management Analysis Journal*, 7(1), hlm. 1–11.
- Rockafellar, R.T. dan Uryasev, S. (2000) “Optimization of conditional value-at-risk,” *Journal of risk*, 2, hlm. 21–42.
- Rodoni, A. dan Ali, H. (2014) *Manajemen Keuangan Modern*. Jakarta: Mitra Wacana Media.
- Saepudin, Y., Yasin, H. dan Santoso, R. (2017) “Analisis risiko investasi saham tunggal syariah dengan Value at Risk (VaR) dan Expected Shortfall (ES),” *Jurnal Gaussian*, 6(2), hlm. 271–280.

- Sri Handini, M.M. dan Erwin Dyah Astawinetu, M.M. (2020) *Teori portofolio dan pasar modal Indonesia*. Scopindo Media Pustaka.
- Sudirman, S.M. (2015) “Pasar Modal dan Manajemen Portofolio.” Gorontalo: Sultan Amai Press.
- Sultra, I.W.E., Katili, M.R. dan Payu, M.R.F. (2021) “Metode Simulasi Historis Untuk Perhitungan Nilai Value At Risk Pada Portofolio Dengan Model Markowitz,” *Euler: Jurnal Ilmiah Matematika, Sains dan Teknologi*, 9(2), hlm. 94–102.
- Widyaningrum, E.N., Hariyanto, H. dan Wahyudi, S. (2022) “Model Optimasi Portofolio Saham dengan Aset Bebas Risiko dan Estimasi Risiko dengan Menggunakan Expected Shortfall,” *Jurnal Sains dan Seni ITS*, 11(2), hlm. A70–A76.
- Zahid, M. (2015) *Menentukan Portofolio Optimal Treynor-Black Model dengan Evaluasi Kinerja Portofolio Metode Jensen, Sharpe, Treynor, Sortino, Information Ratio, T2 dan M2*. Disertasi Doktoral. Malang: Universitas Islam Negeri Maulana Malik Ibrahim.



Halaman ini sengaja dikosongkan

INSTITUT TEKNOLOGI
KALIMANTAN