

DAFTAR PUSTAKA

- Badan Penyelenggara Jaminan Sosial Ketenagakerjaan. (2020). *Annual Report 2020*. Tersedia di <http://www.bpjsketenagakerjaan.go.id/> diakses tanggal 19 Agustus 2025.
- Badan Penyelenggara Jaminan Sosial Ketenagakerjaan. (2021). *Annual Report 2021*. Tersedia di <http://www.bpjsketenagakerjaan.go.id/> diakses tanggal 19 Agustus 2025.
- Badan Penyelenggara Jaminan Sosial Ketenagakerjaan. (2022). *Annual Report 2022*. Tersedia di <http://www.bpjsketenagakerjaan.go.id/> diakses tanggal 19 Agustus 2025.
- Badan Penyelenggara Jaminan Sosial Ketenagakerjaan. (2023). *Annual Report 2023*. Tersedia di <http://www.bpjsketenagakerjaan.go.id/> diakses tanggal 19 Agustus 2025.
- Basuki, Sukono, & Carnia, E. (2016). Model Optimisasi Portofolio Investasi MeanVariance Tanpa dan dengan Aset Bebas Risiko Pada Saham IDX30. *Jurnal Matematika Integratif*, Vol. 12, No. 2, 107-116.
- Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. J. (2021). *Investment: Twelfth edition*. United States of America: McGraw-Hill Education.
- Brigham, E.F. dan Ehrhardt, M.C. (2005). *Financial Management: Theory and Practice*. Eleventh Edition. South-Western.
- Brinson, Gary, P, Brian D. Singer dan Gilbert L. Beebower. (1991). *Determinants of Portfolio Determinants of Portfolio Performance II: An Update*.
- Cooper, D.R. dan Schindler, P.S. (2015). *Business Research Methods*. Eleventh Edition. The McGraw-Hill/ Irwin. New York.
- Dickson, D. C. M., Hardy, M. R., & Waters, H. R. (2013). *Actuarial Mathematics for Life* isks (2nd ed.). Cambridge: Cambridge University.
- (2015). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Kesepuluh. karta.



Peraturan Pemerintah Nomor 55 Tahun 2015 tentang Perubahan atas Peraturan Pemerintah Nomor 99 Tahun 2013 tentang Pengelolaan Aset Jaminan Sosial Ketenagakerjaan.

Robbani, M. G., & Jain, A. (2016). Is S&P100 Index a Mean-Variance Efficient Portfolio? *International Journal of Financial Research*, Vol. 7, No. 5.

Sartono, Agus. (2001). *Manajemen Keuangan Teori dan Aplikasi*. Edisi Keempat. BPFE. Yogyakarta.

Setijawan, Benny. (2012). *Optimalisasi Portofolio Investasi Program Jaminan Hari Tua (JHT) Pada PT Jamsostek (Persero)*. Tesis Magister Manajemen Universitas Gadjah Mada. Yogyakarta.

Tandelilin, E. (2010). *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi*. Yogyakarta: Kanisius.

Ubom, B. Uduak. (2014). *Investment Portfolio of Insurance Firms and Economic Development in Nigeria*. International Journal of Finance and Accounting Department of Banking and Finance, University of Uyo, Uyo, Nigeria.

Uchiyama, Y., Kadoya, T., & Nakagawa, K. (2019). *Complex Valued Risk Diversification*. *entropy*, 21, 119.

Undang-Undang Nomor: 24 Tahun 2011 tentang Badan Penyelenggara Jaminan Sosial.

Yu, J. R., Chiou, W. J. P., Hsin, Y. T., & Sheu, H. J. (2022). Omega portfolio models with floating return threshold. *International Review of Economics & Finance*, 82, 743-758.

Wang, S., Wang, P., & Zhang, S. (2023). Portfolio optimization and intergenerational risk sharing for a collective defined contribution pension plan. *IMA Journal of Management Mathematics*, 34(2), 383-414.

