

DAFTAR PUSTAKA

- Adnyana, I. M. (2020). *Manajemen Investasi dan Portofolio*. Lembaga Penerbitan Universitas Nasional (LPU-UNAS)
- Afriani, O. I., Rizki, W., & Satyahadewi, N. (2020). Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Pada Indeks Saham LQ-45 Menggunakan Constant Correlation Model (CCM). *Buletin Ilmiah Math. Stat. dan Terapannya (Bimaster)*, 9(3), 371–378.
- Astuti, T. D., & Maruddani, D. A. I. (2024). Integrasi Data Envelopment Analysis dan Analisis Rasio Keuangan Untuk Penilaian Efisiensi Perusahaan IDXBUMN20. *Jurnal Kajian Akuntansi*, 8, 39–54. <https://doi.org/10.33603/jka.v8i2.11037>
- Avianti, J., & Ratnasari, M. (2021). Analisis Pembentukan Portofolio Optimal dengan Single Index Model dan Z-Score pada Emiten IDX BUMN 20. *Journal of Emerging Business Management and Entrepreneurship Studies*, 1(1), 21–38. <https://doi.org/10.34149/jebmes.v1i1.4>
- Darmawan, S., & Kurniawan, S. (2019). Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Metode Data Envelopment Analysis (DEA) dan Indeks Tunggal (Single Index Model). *Proceeding FMI ke 11 Samarinda*, 11(1), 176.
- Devita, F., Wilandari, Y., & Maruddani, D. A. I. (2024). Constant Correlation Model Untuk Pembentukan Portofolio Optimal Dan Risiko Expected Shortfall. *Jurnal Gaussian*, 13(1), 260–269. <https://doi.org/10.14710/j.gauss.13.1.260-269>
- Devita, R., Siagian, S. M., HS, S. C., & Tampubolon, F. R. (2025). Analisis Efisiensi Perusahaan pada Indeks MSCI Menggunakan Metode Data Envelopment Analysis Range Adjusted Measure (DEA-RAM). *Jurnal Fusion*, 5(07).
- Dewi, D. N., Hendri, E., & Salmah, N. N. A. (2023). Pembentukan Portofolio Optimal Saham IDX 80 Menggunakan Single Index Model yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI). *Jurnal Ilmiah Wahana Pendidikan*, 9(24), 257–276.
- Fatimah, S., & Mahmudah, U. (2017). Data Envelopment Analysis (DEA): Pengukuran Efisiensi Kinerja Sekolah Dasar. *Cakrawala Pendidikan*, 36(2), 233–243. <https://doi.org/10.1017/cbo9780511617492.006>
- Hartono, J. (2019). *Teori Portfolio dan Analisis Investasi UT*
- Lestari, A. R., & Sari, D. P. (2024). Optimal Portfolio Risk Estimation Using Expected Shortfall of Jakarta Islamic Index (JII) Shares. *Mathematical Journal of Modelling and Forecasting*, 2(1), 32–39.
- Nainggolan, Y., Juliana, A., & Alantina, C. (2020). Pengukuran Risiko Menggunakan

- Value at Risk dengan Metode Variance Covariance, Simulasi Historis dan Monte Carlo. *Jurnal Manajemen*, 10, 124–136.
- Paningrum, D. (2022). *Buku Referensi Investasi Pasar Modal* (1 ed.). Lembaga Chakra Brahmanda Lentera.
- Prasetyo, F. (2015). Analisis Portofolio Optimal Model Indeks Tunggal Dengan Pendekatan Data Envelopment Analysis (DEA). *Jurnal Fourier*, 4(1), 43. <https://doi.org/10.14421/fourier.2015.41.43-58>
- Pratama, Y. C., Huda, M., Astari, Y., & Salsabila, A. R. (2025). *Metode Penilaian Kondisi Perusahaan dan Harga Saham melalui Analisis Fundamental Berbasis Rasio Keuangan*. 5(2), 627–639.
- Putrie, V. C., Susanti, D., & Sukono. (2025). Investment Portfolio Optimization Using Mean-Variance Model with Data Envelopment Analysis (DEA) Approach on IDX30 Stocks. *International Journal of Quantitative Research and Modeling*, 6(1), 48–59.
- Rimbawan, M. G., Slamet, I., & Susanti, Y. (2023). Analisis Portofolio Optimal Saham BEI Menggunakan Single Index Model dan Stochastic Dominance. *Seminar Nasional Statistika Aktuaria II, Vol. 2*, 10–16.
- Rusmiati, D., Saidi, L. O., Budiman, H., Jufra, & Aswani. (2022). Perbandingan Pembentukan Portofolio Optimal Model Markowitz dan Model Indeks Tunggal (Single Index Model) pada Saham Indeks IDX30. *Jurnal Matematika Komputasi dan Statistika*, 2(3), 165–175.
- Ruzi, F., & Rahman, L. F. (2025). Pembentukan Portofolio Saham Optimal Menggunakan Metode Single Index Model pada Saham Perusahaan IDX30 Periode 2023-2024. *Jurnal Menara Ekonomi: Penelitian dan Kajian Ilmiah Bidang Ekonomi*, 11(1), 301–311.
- Saputra, E., Satyahadewi, N., & Sulistianingsih, E. (2014). Penggunaan Value at Risk dalam Analisis Risiko pada Portofolio Single Index Model (Studi Kasus Data Saham LQ 45). *Buletin Ilmiah Matematika, Statistika dan Terapannya (BIMASTER)*, 3(3), 215–222.
- Sihombing, P. R., Arsani, A. M. A., Purwanti, D., Muchtar, M., Lestari, N., & Nurhidayati. (2024). Data Envelopment Analysis (DEA) dalam Berbagai Software. In *Minhaj Pustaka*.
- Tupan, L. P., Manurung, T., & Prang, J. D. (2013). Pengukuran Value at Risk pada Aset Perusahaan dengan Metode Simulasi Monte Carlo. *Jurnal MIPA*, 2(1), 5–

11. <https://doi.org/10.35799/jm.2.1.2013.737>
- Utama, A., Bahauddin, A., & Ferdinant, P. F. (2013). Pengukuran Efisiensi Produksi Dengan Metode DEA (Data Envelopment Analysis) di Divisi Wire Rod Mill. *Jurnal Teknik Industri Untirta*, 1(3), 233–238.
- Wagafir, Y., Rasjid, H., & Pongoliu, Y. I. (2022). Analisis Penerapan Metode Single Index Model dan Constant Correlation Model dalam Optimalisasi Portofolio Saham Indeks LQ-45 di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2019-2021. *Islamic Economics and Finance Journal*, 1(2), 93–113.
- Werastuti, D. N. S. (2014). Pembentukan Portofolio Optimal melalui Pendekatan Efisiensi Decision Making Units (DMU) yang Menghasilkan Relative Efficiency Score Berdasarkan Single Index Model. *Jurnal Ilmiah Akuntansi dan Humanika*, 3(2).
- Wijaya, E. M. S. G., & Soekarno, S. (2023). The Optimal Portfolio of Stocks for Generation Z retail investors using The Single Index Model and The Constant Correlation Model in The LQ45 Index. *International Journal of Current Science Research and Review*, 06(12), 7492–7508.
- Zaimsyah, A. M., Herianingrum, S., & Najiatun. (2019). Analisis Fundamental Terhadap Harga Saham yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index Tahun 2010-2017. *Jurnal Ilmiah Ekonomi Islam*, 5(2), 113–119.