

DAFTAR PUSTAKA

- Ahmad, Kamaruddin. 2004. *Dasar-dasar manajemen Investasi dan Portofolio*. Jakarta: Rineka Cipta.
- Anton, H., Rorres, C. 2005. *Elementary Linear Algebra, Application Version, Ninth Edition*. John Wiley and Sons, New Jersey.
- Bain, L. J. dan Engelhardt, M. 1992. *Introduction to Probability and Mathematical Statistics*. Duxbury Press, California.
- Bazaraa, M. S., Jarvis, J. J. dan Sherali, H. D. 1990. *Linear Programming and Network Flows (2nd Edition)*, John Wiley Sons, Inc., New York.
- Ben-Tal, A., El Ghaoui, L., Nemirovski, A. 2009. *Robust Optimization* (Vol. 28). Princeton University Press.
- Ben-Tal, A., Nemirovski, A. 2002. *Robust Optimization—Methodology and Applications*. Mathematical programming, 92, 453-480.
- Best, Michael J. dan Grauer, Robert R. 1991. *On the Sensitivity of Mean-Variance Efficient Portfolios to Changes in Asset Means: Some Analytical and Computational Results*. Review of Financial Studies, Vol. 4(2), 315–342.
- Bursa Efek Indonesia. 2022. *IDX30 Index Fact Sheet*. Bursa Efek Indonesia.
- Caçador, S., Dias, J.M. dan Godinho, P. 2020. *Global Minimum Variance Portfolios Under Uncertainty: A Robust Optimization Approach*. Journal of Global Optimization, 76, 267-293.
- Cahyaningrum, Y.W. dan Antikasari, T.W. 2017. *Pengaruh Earning per Share, Price to Book Value, Return on Asset, dan Return on Equity terhadap Harga Saham*

Sektor Keuangan Tahun 2010-2014. Prosiding Seminar Pendidikan Ekonomi dan Bisnis. Vol. 3, No. 1.

Chopra, Vijay K. dan Ziemba, William T. 1993. *The Effect of Errors in Means, Variances, and Covariances on Optimal Portfolio Choice*. Journal of Portfolio Management, 365-373.

Darmawi, H. 2006. *Pasar Finansial dan Lembaga-Lembaga Finansial*. Jakarta: Bumi Aksara.

Engels, M. 2004. *Portfolio Optimization: Beyond Markowitz*. Thesis, Universiteit Leiden, Leiden.

Fabozzi, F. J., Focardi, S. M., Kolm, P. N., Pachamanova, D. A. 2007. *Robust Portfolio Optimization and Management*. John Wiley Sons.

Fidhayatin, S.K. dan Dewi, N.H.U.. 2012. *Analisis Nilai Perusahaan, Kinerja Perusahaan dan Kesempatan Bertumbuh Perusahaan terhadap Return Saham pada Perusahaan Manufaktur yang Listing di BEI*. The Indonesian Accounting Review, 2(2), 203-214.

Goldfarb, D. dan Iyengar, G. 2003. *Robust portfolio selection problems*. Mathematics of operations research, 28(1), 1-38.

Härdle, Wolfgang dan Leopold Simar. 2015. *Applied Multivariate Statistical Analysis*. New York: Springer.

Hermawan, M. 2021. *Pengaruh Return On Asset, Current Ratio, Debt to Equity Ratio dan Debt to Total Asset Ratio Terhadap Indeks Harga Saham Perusahaan (Studi Kasus pada Indeks IDX30 yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2016-2020)*. Doctoral dissertation. Sekolah Tinggi Ilmu Ekonomi Indonesia. Jakarta.

Isnaini, Nor., Nunung, Ghoniyah. 2013. *Analisis Risiko Investasi Saham Pada Perusahaan Yang Go Publik Di Jakarta Islamic Index (JII)*. Media Ekonomi Dan Manajemen, 28(2).

- Jagannathan, R. dan Ma, T. 2003. *Risk reduction in large portfolios: Why imposing the wrong constraints helps*. The Journal of Finance, 58(4), 1651-1683.
- Jessop, N. 2018. *Permitted approaches for constructing IFRS 17 Discount Rates*. Moody's Analytics.
- Lestari, H.S. 2017. *Pengaruh Intellectual Capital terhadap Kinerja Perusahaan Asuransi di Indonesia*. Jurnal Manajemen, 21(3), 491-509.
- Lobo, M.S. dan Boyd, S. 2000. *The worst-case risk of a portfolio*.
- Lu, Z. 2011. *Robust portfolio selection based on a joint ellipsoidal uncertainty set*. Optimization Methods Software, 26(1), 89-104.
- Markowitz, Harry. 1952. *Portfolio Selection*. The Journal of Finance, vol.7 no.1, 77-91.
- Michaud, R.O. dan Michaud, R.O. 2008. *Efficient asset management: a practical guide to stock portfolio optimization and asset allocation*. Oxford University Press.
- Paramita, Dessy. 2013. *Optimisasi Portofolio Robust Menggunakan Second-Order Cone Programming (SOCP)*. Skripsi. Departemen Matematika UGM. Yogyakarta.
- Pardosi, B. dan Wijayanto, A. 2015. *Analisis Perbedaan Return dan Risiko Saham Portofolio Optimal dengan Bukan Portofolio Optimal*. Management Analysis Journal, 4(1).
- Rahyuda, K. dan Ardita, P. 2003. *Validitas Saham-Saham Unggulan dan Pembentukan Portofolio Optimal pada LQ 45 di PT.BEJ Pendekatan Model Markowitz*. Jurnal Finance, 7(3), 227-297.
- Rodoni, Ahmad dan Othman Yong. 2001. *Analisis Investasi dan Teori Portofolio*. PT. RajaGrafindo Persada, Jakarta.

- Rosadi, D. 2012. *Diktat Kuliah Manajemen Risiko Kuantitatif*. Yogyakarta: Program Studi Statistika, FMIPA UGM.
- Subanar. 2013. *Statistika Matematika: Probabilitas, Distribusi, dan Asimtotis dalam Statistika*. Yogyakarta: Graha Ilmu.
- Tandelilin, E. 2010 *Dasar-dasar Manajemen Investasi*. Manajemen Investasi, 34.
- Tutuncu, R. H. dan Koenig, M. 2003. *Robust Asset Allocation*. Department of Mathematical Sciences Carnegie Mellon University, Pennsylvania.
- Winarso, W. 2014. *Analisa Biaya Klaim Nasabah terhadap Laba Perusahaan Asuransi (Studi Kasus pada PT. Prudential Life Assurance)*. Moneter-Jurnal Akuntansi dan Keuangan, 1(1).
- Zymler, S., Rustem, B. dan Kuhn, D. 2011. *Robust portfolio optimization with derivative insurance guarantees*. European Journal of Operational Research, 210(2), 410-424.