

## DAFTAR PUSTAKA

- Amin Gholam R dan Hajjami Mohaddeseh (2020). Improving DEA Cross-Efficiency Optimization in Portfolio Selection, Expert Systems With Applications, Vol 168 114280.
- Bodie, Kane, Marcus. 2018. Investments Elevent Edition. New York: McGraw-Hill Education.
- Brigham Eugene, Houston Joel, Ming Hsu Jun, Kong Yoon dan Ariffin Bany. 2018. Essentials of Financial Management Fourth Edition. Singapore: Cengage Learning Asia Pte Ltd.
- Brigham & Eugene F. 2018. Dasar-Dasar Manajemen Keuangan Edisi 12 Buku 1. Jakarta: Salemba Empat
- Chen, H. H. (2008). Stock selection using data envelopment analysis. *Industrial Management & Data Systems*. Vol. 108 No. 9.
- Coper R Donald & Schindler S Pamela. 2017. Metode Penelitian Bisnis Edisi 12 Buku 1. Jakarta: Salemba Empat.
- Coper R Donald & Schindler S Pamela. 2017. Metode Penelitian Bisnis Edisi 12 Buku 2. Jakarta: Salemba Empat
- Hanafi Mamduh. 2013. Manajemen Keuangan Edisi 1. Yogyakarta: BPFE-Yogyakarta.
- Hartono Jogiyanto. 2014. Teori Portofolio dan Analisis Investasi. Yogyakarta: BPFE-Yogyakarta.
- Hartono Jogiyanto. 2014. Teori dan praktik Portofolio dengan Excel. Jakarta: Salemba Empat.
- Koh Annie, Keng Ang Ser, Brigham Eugene dan Ehrhardt Michael. 2014. Financial Management Theory and Prattice in Asia Edition. Singapore: Cengage Learning Asia Pte Ltd .
- Lestari, F., & Yunita, I. (2019). Analisis Investasi Portofolio Saham Optimal Pada Sektor Perbankan Menggunakan Metode Model Indeks Tunggal Dan Capital Asset Pricing Model (CAPM). *eProceedings of Management*, Vol 6 No 1.
- Mahayani, N. P. M., & Suarjaya, A. G. (2019). Penentuan Portofolio Optimal Berdasarkan Model Markowitz Pada Perusahaan Infrastruktur Di Bursa Efek Indonesia. *E-Jurnal Manajemen*, Vol 8 No 5, 3057-3085.



- Nugroho, T., & Rusydiana, A. S. (2020). Pemilihan Saham Syariah Yang Efisien Untuk Pembentukan Portofolio Optimal. *Jurnal Ekonomi Syariah Teori dan Terapan*, Vol 7 No 5, 985-1001.
- Nurani, L., & Qudratullah, M. F. (2016). Analisis Portofolio Syariah Optimal Menggunakan Model Mean Variance Efficient Portofolio (MVEP) Dengan Pendekatan Data Envelopment Analysis (DEA). *Jurnal Fourier*, Vol 5 No (1), Hal 41-47.
- Paskawati, L. M. A. (2017, July). Kinerja Portofolio Saham Infrastruktur, Keuangan dan Konsumsi berdasarkan Strategi Investasi Sektoral di Pasar Modal Indonesia. *Forum Manajemen STIMI Handayani Denpasar*. (Vol. 11, No. 2, pp. 55-67).
- Patari, Eero.J., Leivo Timo. H dan Honkapuro Samuli J.V. (2010). Enhancement of Value Portfolio Performance Using Data Envelopment Analysis, *Studies in Economics and Finance*, Vol. 27 No. 3, 223-246.
- Powers, J., & McMullen, P. (2000). Using data envelopment analysis to select efficient large market cap securities. *Journal of Business and Management*, Vol 7 No 2, 31-42.
- Prasetyo, F. (2015). Analisis Portofolio Optimal Model Indeks Tunggal dengan Pendekatan Data Envelopment Analysis (DEA) (Studi Kasus: Saham Jakarta Islamic Index (JII) Periode 01 Januari 2012-30 Juni 2014). *Jurnal Fourier*, Vol. 4, No. 1, 43-58.
- Prawatiningsih, D. (2021). Efektivitas Rebalancing Portofolio Saham Sektoral Di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Akuntansi Kompetif*, Vol 4 No 1, 17-29.
- Prawesti Wahmi Laksita (2016). Analisis Perbandingan Kinerja Portofolio Optimal Saham Syariah dan Non Syariah di Bursa Efek Indonesia. Tesis, FEB UGM. Yogyakarta.
- Robiyanto, R. (2018). Performance evaluation of stock price indexes in the Indonesia Stock Exchange. *International Research Journal of Business Studies*, Vol 10 No 3, 173-182.
- Saputra Trianita Era (2019). Analisis Perbandingan Kinerja Portofolio Optimal Saham Syariah dan Non Syariah Periode Bullish dan Bearish Tahun 2010-2017. Tesis, FEB UGM. Yogyakarta.



Schindler S Pamela. Business Research Methods Thirteen edition. New York: McGraw-Hill/Irwin.

Sriwidadi, T. (2011). Penggunaan uji mann-whitney pada analisis pengaruh pelatihan wiraniaga dalam penjualan produk baru. *Binus Business Review*, Vol 2 No 2, 751-762.

Tandeliin Eduardus. 2010. Portofolio dan Investasi (Teori dan Aplikasi) Edisi Pertama. Yogyakarta: KANISIUS.

Tudora Cristiana, Tudorb Maria dan Anghelc Andrei. (2014). Performance of SMEs Stocks Portfolios at Bucharest Stock Exchange, *Social and Behavioral Sciences*, Vol 150 772 – 777.

Verkino, B., Sinaga, B. M., & Andati, T. (2020). Portofolio Optimal Investasi Saham dari 6 Sektor pada Indeks LQ45 Periode 2015-2018. *Jurnal Aplikasi Bisnis dan Manajemen (JABM)*, Vol 6 No 2, 389-389.

Wisambudi, M. Bagus, Nengah Sudjana dan Topowijono. (2014). Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Dengan Menggunakan Model Indeks Tunggal (Studi Pada Saham Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2011-2013)." *Jurnal Administrasi Bisnis* 12.1.

Wulandari, R. S., Gunarta, K., & Pratiwi, S. G (2013). Perencana Portofolio Saham Perusahaan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia dengan Metode DEA dan Singel Index Model. Prosiding Seminar Nasional Manajemen Teknologi XVIII. Program Studi MMT-ITS.

Werastuti, Desak Nyoman Sri (2014). "Pembentukan Portofolio Optimal Melalui Pendekatan Efisiensi Decision-Making Units (DMU) yang menghasilkan Realitve Efficiency Score berdasarkan Single Index Model. *Jurnal Ilmiah Akuntansi dan Humanika*, Vol. 3, No. 2, 1262—1289.

Yudiaatmaja, F. (2014). Analisis Komparatif Kinerja Saham Sektor Keuangan, Manufaktur dan Pertambangan di Bursa Eefek Indonesia tahun 2013. SEMINAR NASIONAL RISET INOVATIF II.



Yuniarti, S. (2010). Pembentukan Portofolio Optimal Saham–Saham Perbankan dengan Menggunakan Model Indeks Tunggal. *Jurnal Keuangan dan Perbankan*, Vol 14 No (3), Hal 459-466.

Zarman, N. (2017). Kinerja Portofolio Saham pada Perusahaan Makanan, Property dan Pertambangan di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Bisnis dan Manajemen*, Vol 7 No 2, Hal 247-260.

[www.idx.co.id](http://www.idx.co.id).

[www.finance.yahoo.com](http://www.finance.yahoo.com).

[www.bi.go.id](http://www.bi.go.id).

<https://www.minerba.esdm.go.id>

<https://www.ojk.go.id>

<https://www.kemenkeu.go.id>