

DAFTAR PUSTAKA

- Adnyana, I. M. (2020). *Manajemen Investasi dan Portofolio*. Jakarta. Lembaga Penerbitan Universitas Nasional (LPU-UNAS).
- Aminy, M. M. (2018). Praktek Short Selling, Margin Trading, dan Insider Trading di Pasar Saham dalam Perspektif Islam. *Iqtishaduna: Jurnal Ekonomi & Keuangan Islam*, 9(1), 47–63.
- Apriyanti, V., & Supandi, E. D. (2019). Perbandingan Model Capital Asset Pricing Model (CAPM) dan Liquidity Adjusted Capital Asset Pricing Model (LCAPM) dalam Pembentukan Portofolio Optimal Saham Syariah. *Media Statistika*. <https://doi.org/10.14710/medstat.12.1.86-99>
- Arfat, I. (2021). Transaksi Jual Beli Online Perspektif Hukum Islam. *Al-Syakhsiyya Jurnal Hukum Keluarga Islam dan Kemanusiaan*.
- Askher, A.A.F. (1987). *The Islamic Business Enterprise*. Croom Helm.
- Aziz, A. (2010). *Manajemen Investasi Syariah*. <https://openlibrary.telkomuniversity.ac.id/pustaka/9902/manajemen-investasi-syariah.html>
- Batarius, P. (2018). Perbandingan Metode Newton-Raphson Modifikasi dan Metode Secant Modifikasi dalam Penentuan Akar Persamaan. *Seminar Nasional Riset Dan Teknologi Terapan 8 (RITEKTRA 8)*, April 2018, IK53–IK63.
- Blau, B. M., Van Ness, B. F., & Van Ness, R. A. (2009). Short Selling and the Weekend Effect for NYSE Securities. *Financial Management*. <https://doi.org/10.1111/j.1755-053X.2009.01049.x>
- Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. J. (2014). *Investments 10th ed.* New York.

McGraw Hill Higher Education.

Cheng, P., Sulaiman, J., Ghazali, K., Ali, M. K. M., & Xu, M. M. (2025). Newton-SOR Iterative Method with Lagrangian Function for Large-Scale Nonlinear Constrained Optimization Problems. *Journal of Advanced Research in Applied Sciences and Engineering Technology*, 46(2), 251–262. <https://doi.org/10.37934/araset.46.2.251262>

Colley, S. J. (2012). *Vector Calculus*. The United States of America. Pearson. <http://scioteca.caf.com/bitstream/handle/123456789/1091/RED2017-Eng-8ene.pdf?sequence=12&isAllowed=y%0Ahttp://dx.doi.org/10.1016/j.regsciurbeco.2008.06.005%0A>

Dusuki, A., & Abozaid, A. (2008). Fiqh Issues in Short Selling as Implemented in the Islamic Capital Market in Malaysia. *Journal of King Abdulaziz University-Islamic Economics*. <https://doi.org/10.4197/islec.21-2.3>

Elton, E. J., Gruber, M. J., Brown, S. J., & Goetzmann, W. N. (2014). *Modern Portfolio Theory and Investments Analysis 9th ed.* The United States of America. Wiley.

Husain, M. Y., Siva, F., Al, H., Rizal, M., Habibi, Z., Brahmana, R., Achmad, M., Halidaziya, N., & Althof, M. D. (2024). Investasi Syariah: Kontribusi Terhadap Ketahanan Sosial dan Ekonomi Umat di Indonesia. *Jurnal Ekonomi dan Kajian Keislaman* 4, 41-52.

Hanif, M. (2019). Risk and Return Under Shari'a Framework: An Attempt to Develop Shari'a Compliant Asset Pricing Model-SCAPM. *Pakistan Journal of Commerce and Social Sciences*, 5(6), 283-292. <https://ssrn.com/abstract=1716821>

- Husnan, S. (2015). *Dasar-dasar Teori Portofolio & Analisis Sekuritas Edisi Kelima*. Yogyakarta. UPP STIM YKPN.
- Jonathan, S. (2006). *Metode Penelitian Kuantitatif dan Kualitatif*. Yogyakarta. Penerbit Graha Ilmu.
- Machfiroh, I. S. (2016). Pengukuran Risiko Portofolio Investasi dengan Value at Risk (VaR) Melalui Pendekatan Metode Variansi-Kovariansi dan Simulasi Historis. *Jurnal Sains Dan Informatika* 2(2).
- Mappadang, A. (2021). *Buku Ajar Manajemen Investasi & Portofolio (Edisi Pertama)*. Jakarta. Pena Persada.
- Maruddani, D. A. I. (2019). *Value at Risk untuk Pengukuran Risiko Investasi Saham: Aplikasi dengan Program R*. Ponorogo. WADE Group.
- Maruddani, D. A. I., & Purbowati, A. (2012). Pengukuran Value At Risk Pada Aset Tunggal dan Portofolio dengan Simulasi Monte Carlo. *Media Statistika*. <https://doi.org/10.14710/medstat.2.2.93-104>
- Maruddani, D. A. I., & Trimono. (2020). *Microsoft Excel untuk Pengukuran Value at Risk : Aplikasi pada Risiko Investasi Saham*. Semarang. UNDIP Press.
- Mustafid. (2003). *Statistika Elementer: Metode dan Aplikasi dengan SPSS*. Semarang. Universitas Diponegoro.
- Najma, S. (2020). *Perkembangan dan Potensi Investasi Syariah di Indonesia*. Yogyakarta. Deepublish.
- Oktavia, R. D., Supandi, E. D., & Chasanah, S. I. (2022). Analisis Portofolio Optimal Saham Syariah Menggunakan Shari'a Compliant Asset Pricing Model (SCAPM). *Prosiding Konferensi Integrasi Interkoneksi Islam Dan Sainsprosiding Konferensi Integrasi Interkoneksi Islam Dan Sains*.

- Papageorgiou, S. N. (2022). On Correlation Coefficients and Their Interpretation. *Journal of Orthodontics*, 49(3), 359–361. <https://doi.org/10.1177/14653125221076142>
- Purwanto, B., Respati, P., & Amanah, N. K. (2024). Optimal Portfolio and The Integrated Dynamic Strategy. *Management Analysis Journal*, 13(2), 130–139.
- Ramadhani, R. T. (2022). Investasi Saham Syariah Saat Pandemi Covid-19. *Jurnal Economina*. <https://doi.org/10.55681/economina.v1i3.157>
- Rochmad. (2013). Aplikasi Metode Newton-Raphson untuk Menghampiri Solusi Persamaan Non Linear. *Jurnal MIPA*, 36(2), 193-200.
- Safitri, E., Basriati, S., & Zahara, A. (2019). Optimalisasi Hasil Produksi Menggunakan Metode Kuhn-Tucker (Studi Kasus : Toko Baju MitraPekanbaru). *Jurnal Sains Matematika Dan Statistika: Jurnal Hasil Penelitian Matematika, Statistika, Dan Aplikasinya*, 5(1), 30–39.
- Safitri, K., Tarno, T., & Hoyyi, A. (2021). Pengukuran Kinerja Portofolio Optimal Saham LQ45 Menggunakan Metode Capital Asset Pricing Model (CAPM) dan Liquidity Adjusted Capital Asset Pricing Model (LCAPM). *Jurnal Gaussian*. <https://doi.org/10.14710/j.gauss.v10i2.29414>
- Shaikh, S. A. A. (2010). Corporate Finance in an Interest Free Economy: An Alternate Approach to Practiced Islamic Corporate Finance. *Journal of Islamic Banking & Finance*, *Internasional Association of Islamic Books*. <https://ssrn.com/abstract=1527310>
- Sodikin, A. (2020). Kinerja Portofolio Dengan Metode Sharp, Jensen dan Treynor Pada Saham Industri Tekstil di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Manajemen Bisnis Krisnadwipayana*.

- Syafii. (2014). *Metode Numerik Algoritma dan Pemrograman Visual C++*. Semarang. Andalas University Press.
<https://doi.org/10.2991/assehr.k.210202.081>
- Tam, A. (2022). *Lagrange Multiplier Approach with Inequality Constraints*. Machine Learning Mastery. <https://machinelearningmastery.com/lagrange-multiplier-approach-with-inequality-constraints/>
- Tandelilin, E. (2010). *Manajemen Portofolio dan Investasi*. Yogyakarta. PT Kanisius.
- Tomkins, C., & Karim, R.A. (1987). The Shariah and its Implications for Islamic Financial Analysis: An Opportunity to Study Interactions among Society, Organization, and Accounting. *The American Journal of Islamic Social Sciences*, 4(10), 101-114.
- Winston, W. L. (2004). *Operations Research Applications and Algorithms* (4th Edition). Duxbury Press.
- Wozniak, P. J., & Daniel, W. W. (1991). Applied Nonparametric Statistics. *Technometrics*. <https://doi.org/10.2307/1268795>
- Yustisiadi, H., & Witasari, A. (2024). Tinjauan Yuridis Investasi Praktik Short Selling dalam Pasar Modal Menurut Perspektif Ekonomi Syariah. *Jurnal Ilmiah Sultan Agung*, 316–325.