

DAFTAR PUSTAKA

- Ai, J., Brockett, P. L., & Jacobson, A. F. (2015). A New Defined Benefit Pension Risk Measurement Methodology. *Insurance: Mathematics and Economics*, 63, 40–51. <https://doi.org/10.1016/j.insmatheco.2015.03.027>
- Amalia, 2012. Analisis Mean Variance Portofolio Investasi (Studi Kasus Pada Dana Pensiun X) (Tesis). Jakarta : Universitas Indonesia.
- Ambachtsheer, K. R. Capelle dan T.Scheibelhut. 1998. Improving Pension Fund Performance, *Financial Analysts Journal* vol 54: 15-21.
- Amman, M. and A.Zingg. 2010, Performance and governance of Swiss pension funds, *Journal of Pension Economics & Finance* 9.1 (Jan) : 95-128.
- Antolin, Pablo, Shich, Sebastian and Yermo, Juan. 2011. The economic impact of protracted low interest rates on pension funds and insurance companies, *OECD Journal : Financial Market Trends*, Volume 2011 – Issue 1 : 1- 20.
- Anggraeni, Agustina, Kurnia, 2012. Analisis kinerja keuangan dan rasio kecukupan dana pada dana pensiun pemberi kerja manfaat pasti di Indonesia. *Jurnal Ilmu & Riset Akuntansi* Vol. 1 No. 11
- Ardianto Y. 2004, *Analisis Hubungan Investasi dengan Kinerja, Rasio Kecukupan Dana, Produk Domestik Bruto dan Perkembangan Investasi Dana Pensiun di Indonesia (Periode tahun 1996-2001)*, (Tesis). Depok : Universitas Indonesia.
- Arugaslan, O, Edwards, E, dan Samant, A. 2008. Risk-Adjusted Performance of International Mutual Fund. *International Journal of Managerial Finance*. Volume 34 Nomor 1 : 5-22.
- Atahau, A.D.R. dan Supatmi. 2011. Pengaruh persebaran pengurus (*board diversity*) terhadap kinerja keuangan dana pensiun pemberi kerja. *Jurnal Manajemen & Bisnis* Volume 10 Nomor 2.

Bank Dunia. Desember 2006, *Membuka Potensi Sumber Daya Keuangan Dalam Negeri di Indonesia Peran Lembaga Keuangan Non Bank Dokumen Bank Dunia*.

Barnes, P. 1987. *The Analysis and Use of Financial Ratios A Review Article*, *Journal of Business Finance and Accounting*, 14(4) Winter.

Barros, C.P, M.Garcia, M.Teresa. 2006, *Performance Evaluation of Pension Fund Management Companies with Data Envelopment Analysis*, *Risk Management and Insurance Review* 9.2 (Fall : 165).

Best, Philip. 1998. *Implementing Value at Risk*, England : John Willey & Sons Ltd.

Biro Dana Pensiun. 2016, *Laporan Tahunan Dana Pensiun tahun 2015*, Jakarta : Departemen Keuangan Republik Indonesia.

Bodie, Zvi, Kane, Alex & Marcus, Alan J. 2014. *Investments* (9th ed.) New York : MCGraw-Hill.

Brown, Jeffrey R., Nellie Liang, and Scott Weisbenner, 2007, Individual account investment options and portfolio choice: Behavioral lessons from 401(k) plans, *Journal of Public Economics* 91, 1992–2013.

Chen, Y., Sun, X., & Li, J. (2017). Pension Fund Asset Allocation: A Mean-Variance Model with CVaR Constraints. *Procedia Computer Science*, 108 (June), 1302–1307. <https://doi.org/10.1016/j.procs.2017.05.130>

CFA Institute, 2011. *Investments : Principles of Portfolio and Equity Analysis*. New Jersey : John Wiley & Sons, Inc

De la Torre Torres, O. V., Figueroa, E. G., Enciso, M. I. M. T., & Montoya, D. A. (2015). A minimum variance benchmark to measure the performance of pension funds in Mexico. *Contaduria y Administracion*, 60(3), 593–614.

De la Torre Torres, O. V., Galeana Figueroa, E., & Alvarez-García, J. (2018). The cost of homogeneity in life cycle pension funds: An explanation to demand's inelasticity of Mexican pension funds with a performance attribution test. *European Research on Management and Business Economics*, 24(2), 97–103. <https://doi.org/10.1016/j.iemeen.2017.11.002>

Departemen Keuangan Republik Indonesia. 2007, *Studi Tentang Program Pensiun Pesangon dan Tunjangan Hari Tua Lainnya*, Biro Riset dan Teknologi Informasi, Jakarta :Badan PengawasPasar Modal dan Lembaga Keuangan.

Frajtova-Michalikova, K., Spuchl'akova, E., & Misankova, M. (2015). Portfolio Optimization. *Procedia Economics and Finance*, 26(15), 1102–1107.
[https://doi.org/10.1016/S2212-5671\(15\)00936-3](https://doi.org/10.1016/S2212-5671(15)00936-3)

Feibel, Bruce J. 2003. *Investment Performance Measurement*. New Jersey : John Wiley & Sons, Inc.

Gallery, G., Fery, F., Shorter, J., & Univer-, Q. (2011). FINANCIAL LITERACY AND PENSION INVESTMENT DECISIONS, 27(August), 286–307.

Halim, A dan Hanafi. 2007, *Analisis Laporan Keuangan*, Edisi Keempat. Yogyakarta : UPP STIM YKPN

Huberman, G. U. R., & Jiang, W. E. I. (2006). Offering versus Choice in 401 (k) Plans : Equity, LXI(2).

Ikatan Akuntan Indonesia. 2015, *Standar Akuntansi Keuangan*, Jakarta : Salemba Empat.

Iskandarsyah S. 2006, *Analisis Portofolio Dana Pensiun PT Pfizer Indonesia*.

Jogiyanto, Hartono. 2008, *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, Yogyakarta :BPFE.

Kadarisman dan S. Wahyuni. 2010, *Manajemen Dana Pensiun Indonesia*, Jakarta : PT. Mediantara Semesta.

Kamaruddin, A., 2003, *Dasar Manajemen Investasi dan Portofolio*, Edisi Revisi, Jakarta : Rineka Cipta.

Markowitz, H. (1952). Portfolio Selection. *The Journal of Finance*, 7(1), 77–91.
<https://doi.org/10.1111/j.1540-6261.1952.tb01525.x>

Needham, D. 2012. The importance of trade-off between Risk and Return.
Journal of Retail Banking and Private Wealth Management. Volume 126
Nomor 2 : 27-28.

Nirmawati, I. 2005, *Analisis Pengaruh Perubahan Iuran dan Investasi Terhadap Rasio Pendanaan pada Dana Pensiun PT Telkom*.

Noviyandri, 2002, *Evaluasi Kinerja Keuangan dan Investasi Dana Pensiun*,
repository.mb.ipb.ac.id

Osu, B. O., & Egbe, G. A. (2016). Optimization of Pension Asset Portfolio in Nigeria with Contributors' Specified Return Rate, *Mathematical Theory and Modelling* (June 2004), 103–119. <https://doi.org/10.4236/ojop.2016.54012>

Ou, J. A. dan S.H. Penman.1989, Financial Analysis and the Prediction of Stock Return, *Journal of Accounting and Economic* Volume 11 : 295-329.

Ozbek, Asir. 2015. Analysis of Private Pension Companies in Turkey by EATWOS. *European Journal Of Business and Management*, Volume 7
Nomor26 : 31-44.

Penman, S.H. 2003. *Financial Statement Analysis And Security Valuation*, 2nd Edition, New York : Mc Graw Hill.

Philippe, Jorion. 2007. *Value at Risk : New Benchmark for Managing Financial Risk*, 3rd Edition, USA : Mc Graw-Hill.

Pratiwi, P. Efendri dan P. Pramanik. 2008. *Pengaruh Investasi, Likuiditas, Solvabilitas Dana Pensiun terhadap ROA (Studi Kasus pada 40 PPPK-PPMP yang Terdaftar Di Bapepam LK*. lib.stekpi.ac.id

Pratomo, Eko P & Vivian Secakusuma. 2013. *Panduan Praktis Investasi Bagi Dana Pensiun*. Jakarta : PT. BNP Paribas Investment Partners.

Rahardjo, B. 2009, *Peluang dan Tantangan Dana Pensiun*.

Ramadhan, R. D. (2014). Analisis Pemilihan Portofolio Optimal Dengan Model Dan Pengembangan Dari Portofolio Markowitz (Studi Pada Indeks Bisnis - 27 Di Bursa Efek Indonesia Periode 2011 - 2013). *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB)*, Volume 14.

Republik Indonesia, Undang-Undang No.11. Tahun 1992 tentang Dana Pensiun.

_____, Peraturan Pemerintah No 76 Tahun 1992 tentang Dana Pensiun Pemberi Kerja.

_____, Keputusan Menteri Keuangan No 510/KMK.06/2002 tentang Pendanaan dan Solvabilitas Dana Pensiun Pemberi Kerja.

_____, Peraturan Otoritas Jasa Keuangan Nomor 3/POJK.05/ 2015 tanggal 31 Maret 2015 tentang Investasi Dana Pensiun.

Rizki, L. T. 2009. *Optimalisasi Risk-return Portofolio Investasi Instrumen Saham, Obligasi, Emas, Valas, dan Deposito Menggunakan Metode Markowitz dan Value-at-risk* (Tesis). Jakarta : Universitas Indonesia.

Setiadi A, 1995, *Dana Pensiun sebagai Badan Hukum*, Bandung : Citra Aditya Bakti.

Sekaran, Uma, 2017, *Research Methods For Business*, Jakarta : Salemba Empat.

Setiawan, H., Siregar, H., & Anggraeni, L. (2015). Optimalisasi Kinerja Portofolio Investasi (Studi Kasus pada Dana Pensiun Pertamina), *Jurnal Aplikasi Manajemen*, Volume 13 Nomor 4 : 557-565.

Sharpe, William, 2002. Budgeting and Monitoring Pension Fund Risk. *Financial Analysts Journal*, Volume 58 Nomor 5 : 74-86.

Siagian, H. 2003, *Manajemen Dana Pensiun di Indonesia*, Jakarta : BPK Gunung Mulia.

Sialm, C., Starks, L. T., Zhang, H., Halling, M., Harvey, C., Huang, J., ... Pool, V. (2015). Defined Contribution Pension Plans : Sticky or Discerning Money ?, *LXX*(2). <https://doi.org/10.1111/jofi.12232>

Siswosudarmo, Sujat, 2011. *Dana Pensiun Anda Bertanya Kami Menjawab*, Jakarta : Asosiasi Dana Pensiun Indonesia.

Sriwardany.2006, *Pengaruh Pertumbuhan Perusahaan Terhadap Kebijakan Struktur Modal dan Dampaknya Terhadap Perubahan Harga Saham pada Perusahaan Manufaktur*.

Suheri. 2009. *Evaluasi tentang Kemungkinan Penerapan Prinsip Syariah pada Pengelolaan Portofolio Investasi Dana Pensiun XYZ*.

Sunariyah, 2004. *Pengetahuan Pasar Modal, Edisi Keempat*. Yogyakarta : UPP AMP YKPN.

Tandelilin, E. 2011. *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi, Edisi Pertama*. Yogyakarta : Kanisius IKAPI.

Tanner, S. 2007, *Seminar Kajian Peraturan Pendanaan Dana Pensiun*.

Tunggal, A.W. 1996, *Dasar-Dasar Akuntansi Dana Pensiun*, Rineka Cipta Jakarta.

Tonks, I. 2005. *Pension Fund Management and Investment Performance*. Oxford (GB) : Oxford University Press.

Wang, Yong, Mao, Connie X. 2015. Shareholder activism of public pension funds: The political facet. *Journal of Banking & Finance*. Volume 60 : 138-152.

Wahab, Z. 2001, *Dana Pensiun dan Jaminan Sosial Tenaga Kerja di Indonesia*, Bandung : CitraAditya Bakti.

_____, 2005, *Segi Hukum Dana Pensiun*, Bandung : Raja Grafindo Persada.

Wardhana, W. 2006, *Usulan Rancangan Portofolio Investasi Untuk Mengoptimalkan Kekayaan Dana Pensiun Bank Indonesia.*

Wijaya, F. 2001, *Analisis Perbandingan antara Program Pensiun Iuran Pasti (PIIP) dengan Program Pensiun Manfaat Pasti (PPMP) dari Sudut Pandang Pemberi Kerja dan Peserta pada Dana Pensiun Sampoerna Surabaya.*

Laporan Keuangan Tahun 2013 – 2017 Dana Pensiun ABC

Laporan Portofolio Investasi Tahun 2013 – 2017 Dana Pensiun ABC

Annual Report Dana Pensiun ABC Tahun 2013 - 2017

