



DAFTAR PUSTAKA

- Abdurakhman. 2014. Materi Kuliah Pengantar Statistika Keuangan, Program Studi Statistika FMIPA UGM, Yogyakarta.
- Anton, H. dan Rorres. C. 2004. *Aljabar Linear Elementer (Versi Aplikasi)*. Edisi Kedelapan. (Terjemahan oleh Refina Indriasari & Irzam Harmein). Erlangga: Jakarta.
- Arisma, E. 2014. Perbandingan Optimisasi Portofolio Metode Mean-Variance dengan Metode Tail Mean-Variance. *Skripsi*. FMIPA UGM: Yogyakarta.
- Aryanto, R. R. 2015. *Penentuan Harga Aset pada Liquidity Adjusted CAPM*. *Skripsi*. FMIPA UGM: Yogyakarta.
- Bogle, J. C. (1998). *The implications of style analysis for mutual fund performance*. *Journal of Portfolio Management*, 24(4), 34–42.
- Bain, L dan Engelhardt, M. 1992. *Introduction to Probability and Mathematics Statistics*. Duxbury Press: California.
- Desiani, A dan Arhami, M. 2005. *Konsep Kecerdasan Buatan*. Yogyakarta: Andi.
- Goldberg, D. E. 1989. *Genetic algorithms in search, optimization and machine learning*. New York: Addison-Wesley.
- Hedar, A. 2006. Sistem Pendukung Keputusan Seleksi Pemain Sepak Bola dengan Algoritma Genetika. *Skripsi*. FMIPA UGM: Yogyakarta.
- Holland, J. H. (1975). *Adaptation in natural and artificial systems: an introductory analysis with applications to biology, control and artificial intelligence*. University of Michigan Press.
- Kusumadewi, S. 2003. *Artificial Intelligence: Teknik dan Aplikasinya*. Graha Ilmu: Yogyakarta
- Markowitz, H. 1952. *Portfolio selection*. *Journal of Finance*, 7, 77–91. New York: Wiley.
- Markowitz, H. 1959. *Portfolio selection: efficient diversification of investments*. New York: Wiley.



- Muslim. 2016. Pemodelan Kurva Imbal Hasil Model Kelas Nelson-Siegel dan Estimasinya Menggunakan Metode Algoritma Genetika. *Disertasi*. FMIPA UGM: Yogyakarta.
- Obitko, M. 1998. An Introduction to Genetic Algorithm. [Online]. Tersedia: <http://www.obitko.com/tutorials/genetic-algorithms/>. [2 Mei 2016]
- Oh, J. K., Kim, T. Y., & Min, S. 2005. *Using Genetic Algorithm to support portfolio optimization for index fund management*. *Expert Systems with Applications*, 28, 371-379,
- Prasetyo, E. B. 2014. Penerapan Algoritma Genetika dan Jaringan Syaraf Tiruan dalam Penjadwalan Mata Kuliah di Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam Universitas Gadjah Mada. *Skripsi*. FMIPA UGM: Yogyakarta.
- Putra, G. W. 2011. Perbandingan Portofolio Metode Mean-Variance dengan Metode Minimax. *Skripsi*. FMIPA UGM: Yogyakarta.
- Rahmawati, F. D. 2013. Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Metode Mean-Extended Gini. *Skripsi*. FMIPA UGM: Yogyakarta.
- Rosadi, D., 2012, Diktat Kuliah Manajemen Resiko Kuantitatif, Program Studi Statistika FMIPA UGM, Yogyakarta.
- Wiweka, G. B. P. 2010. Optimisasi Portofolio dengan Metode Mean-CVaR. *Skripsi*. FMIPA UGM: Yogyakarta.
- Wong, F., & Tan, C. (1994). *Hybrid neural, genetic, and fuzzy systems*. In G. J. Deboeck (Ed.), *Trading on the edge* (pp. 243–261). New York: Wiley.

<https://finance.yahoo.com/>

<http://www.idx.co.id/>