

DAFTAR PUSTAKA

- [1] Tendellin, Eduardus. 2001. *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Yogyakarta: BPFE-Yogyakarta.
- [2] Markowitz, H. 1952. "Portfolio Selection". *The Journal of Finance*, vol. 7, pp.77-91
- [3] Konno, H., Shirakawa, H., dan Yamazaki, H. 1993. "A Mean-Absolute Deviation Skewness Portfolio Optimization Model". *Annals of Operational Research*, 45(1), 205-220.
- [4] Arditti, F. D. dan Levy, H. 1975. "Portfolio Efficiency Analysis in Three Moments: The Multiperiod Case". *The Journal of Finance*, 30(3), 797-809.
- [5] Pemerintah Indonesia. Undang-Undang Republik Indonesia Nomor 8 Tahun 1995 tentang Pasar Modal. Jakarta: Sekretariat Negara.
- [6] Bursa Efek Indonesia. 2020. Exchange Traded Fund (ETF), diakses dari <https://www.idx.co.id/produk/exchange-traded-fund-etf/>, pada 26 Agustus 2020.
- [7] Jogiyanto. 2010. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi Edisi Ketujuh*. Yogyakarta: BPFE Yogyakarta.
- [8] Fedi, Sebastianus. 2018. "Memahami Karakter Data Penelitian dengan Mengamati Koefisien Skewness dan Kurtosis". *Jurnal Pendidikan dan Kebudayaan Missio*. Vol. 10. 2: 219-222.
- [9] Balanda, K. P. Dan MacGillivray, H. L. 1998. "Kurtosis: A Critical Review". *American Statistician*. Vol. 42. 2: 111-119.
- [10] Anton, Howard dan Rorres, Chris. 2004. *Dasar-Dasar Aljabar Linear Versi Aplikasi Edisi Kedelapan*. Jakarta: Erlangga.
- [11] Bain, L. J. dan Engelhardt, M. 1992. *Introduction to Probability and Mathematical Statistics*. California: Duxburry Press.
- [12] Siswanto. 2007. *Operation Reseach Jilid 1*. Jakarta: Erlangga.
- [13] Febriani, Lina. 2015. Penyelesaian Pemrograman Nonlinear dengan Pendekatan Separable Programming untuk Produksi Bakpia ENY, Skripsi, Jurusan Matematika

Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam, Universitas Negeri Yogyakarta.
Yogyakarta.

- [14] Winston, Wayne. 2003. *Operational Research Book Wayne Winston 4th Edition*. Brazil: Federal University of Sao Carlos (UFSCar).
- [15] Bennet, M. J. dan Hugen, D. L. 2016. *Financial Analytics with R Building a Laptop Laboratory for Data Science*. Inggris: Cambridge University Press.
- [16] Aksarayli, Mehmet. dan Pala, Osman. 2017. "A Polynomial Goal Programming Model for Portfolio Optimization Based on Entropy and Higher Moments". *Expert Systems with Applications*. Vol. 94: 185-192
- [17] Miettinen, K., Ruiz, F., dan Wierzbicki, A. P. 2008. Introduction to Multiobjective Optimization: Interactive Approaches. *Multiobjective Optimization, LNCS 5252*. pp. 27-57
- [18] Pratama, R., Saepudin, D., dan Rohmawati, A.A. 2019. "Pemilihan Portofolio dengan Metode Polynomial Goal Programming (PGP) Berdasarkan Momen Tinggi dan Entropi pada Saham JII". *Ind. Journal On Computing*. Vol. 2. 2: 31-42.
- [19] Lai, Kin Keung. K., Yu, Lean, dan Wang, Shouyang. 2006. "Mean-Variance-Skewness-Kurtosis Based on Portfolio Optimization". *First International Multi-Symposiums on Computer and Computational Sciences (IMSCCS'06)*. pp. 292-297, doi: 10.1109/IMSCCS.2006.239.