

DAFTAR PUSTAKA

- [1] Firdaus, I., Anah, S., & Nadira, F. (2018). "Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Model Indeks Tunggal (Studi Kasus: Saham LQ 45 Yang Terdaftar Di BEI Tahun 2012-2016)". Jurnal Jurnal Ekonomi, Volume XXIII, No. 02, 203-225.
- [2] Hoyyi, A., Ispriyanti, D. (2015). "Optimisasi Multiobjektif untuk Pembentukan Portofolio." Media Statistika, Vol. 8 No. 1, 31-39.
- [3] Saputra, M. R., Saepudin, D. (2023). "Optimasi Portofolio Berbasis Prediksi *Return* Saham Menggunakan Hybrid XGBoost dan Improved Firefly Algorithm untuk Saham – Saham dalam Indeks LQ45." e-Proceeding of Engineering, Vol.10, No.3, 3507-3514.
- [4] Septiano, D. R., Syafriadi, & Rosha, M. (2019). "Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Metode Optimasi Multiobjektif pada Saham di Bursa Efek Indonesia." Journal of Mathematics UNP, vol 4 No 2.
- [5] Septyano, E. D., Rosha, M. (2019). "Analisis Portofolio Optimal Menggunakan Metode Multi Objektif pada Saham Jakarta Islamic Index." Journal of Mathematics UNP, Vol 4 No 1.
- [6] Markowitz, H. M. (1952). "Portfolio Selection". The Journal of Finance, 7(1), 77–91.
- [7] Setyawati, N. P. E. C., & Sudiarta, G. M. (2019). "Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan Model Markowitz". E-Jurnal Manajemen Universitas Udayana, Vol. 8, No. 7, 4213-4238.
- [8] Rahmi, A., Helma. (2023). "Portofolio Optimal Dengan Mempertimbangkan Prediksi *Return* Menggunakan Metode *Support Vector Regression* (SVR)." Jurnal Pendidikan Tambus, volume 7 Nomor 3, 23745-23753.

- [9] Faiza, L. N., Agustina, D. (2023). "Aplikasi Machine Learning dalam Prediksi Harga Saham Jakarta Islamic Index (JII) Menggunakan Metode *Support Vector Regression*." *Journal Of Mathematics UNP* Vol. 8, No. 3, pp. 79~88.
- [10] Damartya, V. P., Saepudin, D., & Gunawan, P. H. (2021). "Optimasi Portofolio Saham LQ45 dengan Mempertimbangkan Prediksi *Return* Menggunakan Metode *Support Vector Regression* (SVR)." *e-Proceeding of Engineering*, Vol.8, No.5, 10786-10796.
- [11] Jatnika, N. S., Nababan, E. S. M. (2022). "Optimisasi Multiobjektif dalam Pembentukan Portofolio Optimal Saham dengan Pengukuran Value At Risk (VAR)." *Journal of Fundamental Mathematics and Applications (JFMA)*. Vol. 5 No. 1.
- [12] Saputro, T. A., Qudratullah, M. F. (2017). "Optimasi Multi Objektif Pada Pemilihan Portofolio Saham Syariah Menggunakan Compromise Programming (CP) dan Nadir Compromise Programming (NCP)." *Jurnal Fourier*, Vol. 6, No. 2, 91-104.
- [13] Putra, N. A., Setiawan, B. D., & Adikara, P. P. (2018). "Peramalan Harga Saham Menggunakan *Support Vector Regression* Dengan Algoritme Genetika." *Jurnal Pengembangan Teknologi Informasi dan Ilmu Komputer*, Vol. 2, No. 1, 209-216.
- [14] Vapnik, V. N. (1995). *The Nature of Statistical Learning Theory*. Springer.
- [15] Damartya, V. P., Saepudin, D., & Gunawan, P. H. (2021). "Optimasi Portofolio Saham LQ45 dengan Mempertimbangkan Prediksi *Return* Menggunakan Metode *Support Vector Regression* (SVR)". *e-Proceeding of Engineering*, Vol.8, No.5, 10786.
- [16] Smola, A. J., & Schölkopf, B. (2004). "A Tutorial on *Support Vector Regression*". *Statistics and Computing*, 14(3), 199–222.
- [17] Elton, E. J., & Gruber, M. J. (1995). *Modern Portfolio Theory and Investment Analysis*. John Wiley & Sons.

- [18] Sharpe, W. F. (1966). "Mutual Fund Performance". *Journal of Business*, 39(1), 119-138.
- [19] Deb, K. (2001). "Multi-Objective Optimization Using Evolutionary Algorithms". John Wiley & Sons.
- [20] Jorion, P. (2007). *Value at Risk: The New Benchmark for Managing Financial Risk*. McGraw-Hill.
- [21] Hull, J. C. (2012). *Risk Management and Financial Institutions*. John Wiley & Sons.
- [22] Grinold, R. C., & Kahn, R. N. (2000). *Active Portfolio Management: A Quantitative Approach for Producing Superior Returns and Controlling Risk*. McGraw-Hill.
- [23] Lo, A. W. (2004). "The Adaptive Markets Hypothesis". *Journal of Portfolio Management*, 30(5), 15–29.
- [24] Agarwal, V., Daniel, N., & Naik, N. Y. (2009). "Role of Managerial Incentives and Discretion in Hedge Fund Performance". *Journal of Finance*, 64(5), 2221–2256.
- [25] Faiza, L. N. (2023). "Aplikasi Machine Learning Dalam Portofolio Saham Jakarta Islamic Index (JII) Menggunakan Metode *Support Vector Regression* (SVR)." Universitas Negeri Padang, 25 Agustus 2023.
- [26] Fadhila, S. N. (2022). "Optimisasi Portofolio Multiobjektif Berdasarkan Prediksi Harga Saham dengan Model Arima." Universitas Islam Negeri Sunan Kalijaga Yogyakarta, 15 Juli 2022.
- [27] Septianingrum, L., Yasin, H., & Sugito. (2015). "Prediksi Indeks Harga Saham Gabungan Menggunakan *Support Vector Regression* (SVR) dengan Algoritma Grid Search." *Jurnal Gaussian*, Volume 4, Nomor 2, 315 - 321.