

DAFTAR PUSTAKA

- Afiana, T., Tarno, dan Sugito. 2017. *Analisis Pembentukan Portofolio Pada Perusahaan Yang Terdaftar di LQ45 Dengan Pendekatan Metode Markowitz Menggunakan Gui Matlab*. Jurnal Gaussian, Vol. 6, No. 2, Hal. 251 – 260.
- Aini, F. N. 2014. *Clustering Business Process Model Petri Net Dengan Complete Linkage*. Jurnal Itsmart, Vol. 3, No. 2, Hal. 47 – 51.
- Astuti, T., dan Maruddani, D.A.I. 2009. *Analisis Data Panel Untuk Menguji Pengaruh Risiko Terhadap Return Saham Sektor Farmasi Dengan Least Square Dummy Variable*. Media Statistika, Vol. 2, No. 2, Hal. 71 – 80.
- [BAPEPAM] Badan Pengawas Pasar Modal. 2003. *Panduan Investasi Di Pasar Modal Indonesia*. Jakarta: BAPEPAM.
- [BEI] Bursa Efek Indonesia. 2023. *Indeks Saham*. <https://www.idx.co.id/id/produk/indeks/>. (diakses pada tanggal 18 Juni 2023).
- Cont, R. 2001. *Empirical Properties Of Asset Returns : Stylized Facts And Statistical Issues*. Quantitative Finance, Vol. 1, No. 2, Hal. 223 – 236.
- Estrada, J. 2008. *Mean–Semivariance Optimization : A Heuristic Approach*. Journal Of Applied Finance, Hal. 57 – 72.
- Gujarati, D. N. 1979. *Ekonometrika Dasar*. Jakarta: Erlangga.
- Gunawan, I., Anggraeni, G., Rini, E. S., dan Mustofa, Y. 2020. *Kelompokisasi provinsi di Indonesia berbasis perkembangan kasus Covid–19 menggunakan metode K–Medoids*. Seminar Nasional Matematika Dan Pendidikan Matematika (5thSENATIK), Vol. 5, Hal. 301 – 306.
- Hair, J. F., Black, W. C., Babin, B. J., dan Anderson, R. E. 2010. *Multivariate Data Analysis*. Edisi Ketujuh. New Jersey: Pearson Education Inc.
- Halkidi, M., Batistakis, Y., dan Vazirgiannis, M. 2001. *On Clustering Validation Techniques*. Journal Of Intelligent Information Systems. Vol. 17, No. 2, Hal. 107 – 145.
- Johnson, R. A., dan Wichern, D. W. 2007. *Applied Multivariate Statistical Analysis*. Edisi Keenam. New Jersey: Prentice Hall International Inc.

- Markowitz, H. M. 1959. *Portfolio Selection: Efficient Diversification Of Investment*. Edisi Pertama. New York: John Wiley & Sons, Inc.
- Markowitz, H.M. 1991. *Foundations of Portfolio Theory*. Journal of Finance Vol. 46, No. 2, Hal. 469 – 477.
- Maruddani, D. A. I., dan Trimono. 2020. *Microsoft Excel Untuk Pengukuran Value At Risk Aplikasi Pada Risiko Investasi Saham*. Semarang: Undip Press.
- Montero, P., dan Vilar J. A. 2014. *TSclust: An R Package For Time series Clustering*. Journal Of Statistical Software, Vol. 62, No. 1, Hal. 1 – 43.
- Muhammad, A. 2014. *Penggunaan Jarak Dynamic Time Warping (DTW) Pada Analisis Cluster Data Deret Waktu (Studi Kasus Pada Dana Pihak Ketiga Provinsi Se-Indonesia)*. Skripsi. Malang: Universitas Brawijaya.
- Ningrat, D.R., Maruddani, D.A.I. dan Wuryandari, T. 2016. *Analisis Cluster dengan Algoritma K-Means dan Fuzzy C-Means Clustering untuk Pengelompokan Data Obligasi Korporasi*. Jurnal Gaussian, Vol. 5, No. 4, Hal. 641 – 650.
- [PEFINDO] PT Pemeringkat Efek Indonesia. 2023. *Company Profile*. <https://pefindo.com/pageman/page/about-us.php>. (diakses pada tanggal 18 Juni 2023).
- Rambe, A. A., dan Riski, T. R. 2022. *Pembentukan Portofolio Saham Yang Optimal Dengan Menggunakan Model Markowitz Sebagai Dasar Penetapan Investasi Saham Pada Jakarta Islamic Index*. Jurnal Penelitian dan Pengkajian Ilmiah Sosial Budaya, Vol. 1, No. 2, Hal. 352 – 363.
- Senin, P. 2008. *Dynamic Time Warping Algoritma Review*. Information And Computer Science Departement University Of Hawaii At Manoa.
- Stuyf, A., Hubert, M., dan Rousseeuw, P. J. 1997. *Integrating Robust Clustering Technique In S-PLUS*. Computational Statistics And Data Analysis, Vol. 26, No. 1, Hal. 17 – 37.
- Suyasa, N. K., Dharmawan, K., Dan Sari, K. 2021. *Perhitungan Portofolio Optimal Dengan Metode Mean-Semivariance Dan Mean Absolute Deviation (Studi Kasus: Indeks Harga Saham Lq45 Periode Februari 2017–Juli 2019)*. E-Jurnal Matematika, Vol. 10, No. 2, Hal. 65 – 69.

- Tandelilin, E. 2010. *Portofolio dan Investasi*. Edisi Pertama. Yogyakarta: Kanisius.
- Tsay, R. S. 2010. *Analysis of Financial Time Series*. Third Edition. New Jersey: John Wiley & Sons Inc.