

DAFTAR PUSTAKA

- Berg, M. (2024). Predictive Maintenance of Power Grids: Clustering Analysis with KMeans and Hierarchical Methods. *Master's Thesis, Norwegian University of Life Sciences*.
- Estrada, J. (2002). Mean-Semivariance Behavior (II): The D-CAPM. *IESE Research Paper*, 493.
- Estrada, J. (2008). Mean-Semivariance Optimization: A Heuristic Approach. *Journal of Applied Finance*, 57–72.
- Everitt, B., & Hothorn, T. (2011). *An Introduction to Applied Multivariate Analysis with R (Use R)*. Springer Science & Business Media.
- Ghozali, I. (2018). *Aplikasi Analisis Multivariate Dengan Program IBM SPSS 25* (9th ed.). Universitas Diponegoro.
- Gubu, L., & Rosadi, D. (2021). Pembentukan Portofolio Saham Menggunakan Klastering Time Series K-Medoid dengan Ukuran Jarak Dynamic Time Warping. *Urnal Aplikasi Statistika & Komputasi Statistik*, 13(2), 35–46.
- Hair, J. F., Black, W. C., Babin, B. J., & Anderson, R. E. (2010). *Multivariate Data Analysis Seventh Edition*. Prentice Hall International.
- Han, J., Kamber, M., & Pei, J. (2012). *Data Mining Concepts and Techniques* (3rd ed.). Morgan Kaufmann Publishers.
- Handini, S., & Astawinetu, E. D. (2020). *Teori Portofolio dan Pasar Modal Indonesia*. Scopindo Media Pustaka.
- Hartono, J. (2013). *Teori dan Praktik Portofolio dengan Excel*. Penerbit Salemba Empat.
- Hartono, J. (2022). *Portofolio dan Analisis Investasi: Pendekatan Modul* (J. Hartono, Ed.). Penerbit ANDI.
- Hisbullah, M. R. (2021). PENGARUH PROFITABILITAS TERHADAP HARGA SAHAM PERUSAHAAN SEKTOR INDUSTRI BARANG DAN KONSUMSI DI BEI TAHUN 2017-2020. *Jurnal Ilmu Manajemen*, 9, 794–803.
- Hudin, M. S., Fauzi, M. A., & Adinugroho, S. (2018). Implementasi Metode Text Mining dan K-Means Clustering untuk Pengelompokan Dokumen Skripsi (Studi Kasus: Universitas Brawijaya). *Jurnal Pengembangan Teknologi Informasi Dan Komputer*, 2(11), 5518–5524.
- Johnson, R. A., & Wichern, D. W. (2007). *Applied Multivariate Statistical Analysis: Sixth Edition* (6th ed.). Pearson Education, Inc.
- Kasmir. (2010). *Analisis Laporan Keuangan*. PT RajaGrafindo Persada.
- Kaufman, L., & Rousseeuw, P. J. (1987). Clustering by Means of Medoids. In Y. Dodge (Ed.), *Data Analysis based on the L1-Norm and Related Methods*. North-Holland.

- Kaufman, L., & Rousseeuw, P. J. (1990). *Finding Groups in Data: An Introduction to Cluster Analysis*. John Wiley & Sons, Inc.
- Markowitz, H. M. (1952). Pemilihan Portofolio. *The Journal of Finance*, 7(1), 77–91.
- Markowitz, H. M. (1959). *Portfolio Selection: Efficient Diversification of Investments*. John Wiley & Sons, Inc.
- Markowitz, H. M. (1991). Foundations of Portfolio Theory. *Source: The Journal of Finance*, 46(2), 469–477.
- Markowitz, H. M., Todd, P., Xu, G., & Yamane, Y. (1993). Computation of mean-semivariance efficient sets by the Critical Line Algorithm. *Annals of Operations Research*, 45(1), 307–317.
- Martalena, & Malinda, M. (2019). *Pengantar Pasar Modal* (Th. A. Prabowati, Ed.). Penerbit Andi.
- Maruddani, D. A. I. (2019). *Value at Risk untuk Pengukuran Risiko Investasi Saham: Aplikasi dengan Program R*. WADE Group.
- Maruddani, D. A. I., & Purbowati, A. (2009). Pengukuran Value at Risk pada Aset Tunggal dan Portofolio dengan Simulasi Monte Carlo. *Media Statistika*, 2(2), 93–104.
- Nisa, B. K., Rohaeni, O., & Harahap, E. (2023). Perbandingan Metode Mean-Semivariance dan Mean Absolute Deviation Untuk Menentukan Portfolio Optimal Menggunakan Python. *Bandung Conference Series: Mathematics*, 3(2), 129–140.
- Nyoman, D., & Werastuti, S. (2014). Pembentukan Portofolio Optimal Melalui Pendekatan Efisiensi Decision-Making Units (DMU) yang Menghasilkan Relative Efficiency Score Berdasarkan Single Index Model. *Jurnal Ilmiah Akuntansi Dan Humanika*, 3(2), 1262–1289.
- Prasasti, K. B., & Slamet, E. J. (2020). Pengaruh Jumlah Uang Beredar Terhadap Inflasi dan Suku Bunga, serta Terhadap Investasi dan Pertumbuhan Ekonomi di Indonesia. *Jurnal Ekonomi Dan Bisnis Airlangga*, 30(1), 39–48.
- Rousseeuw, P. J. (1987). Silhouettes: a graphical aid to the interpretation and validation of cluster analysis. *Journal of Computational and Applied Mathematics*, 20, 53–65.
- Salah, H. Ben, De Gooijer, J. G., Gannoun, A., & Ribatet, M. (2018). Mean–variance and mean–semivariance portfolio selection: a multivariate nonparametric approach. *Financial Markets and Portfolio Management*, 32(4), 419–436.
- Sharpe, W. F. (1966). Mutual Fund Performance. *The Journal of Business*, 39(1), 119–138.
- Singh, D., & Singh, B. (2020). Investigating the impact of data normalization on classification performance. *Applied Soft Computing*, 97, 105524.

- Siswanto, E. (2021). *Buku Ajar Manajemen Keuangan Dasar*. Universitas Negeri Malang.
- Struyf, A., Hubert, M., & Rousseeuw, P. J. (1997). Clustering in an Object-Oriented Environment. *Journal of Statistical Software*, 1, 1–30.
- Suroto. (2021). *Buku Monograf Portofolio Optimal dan Evaluasi Kinerja Portofolio*. Pustaka Magister.
- Tandelilin, E. (2010). *Manajemen Investasi*. Penerbit Universitas Terbuka.
- Tandelilin, E. (2017). *Pasar Modal: Manajemen Portofolio dan Investasi* (G. Sudibyo, Ed.). PT Kanisius.
- Yunika, V., & Rahmizal, M. (2022). Analisis Rasio Keuangan Untuk Memprediksi Financial Distress Pada Perusahaan Manufaktur Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Tahun 2017-2019. *Jurnal Pundi*, 6(1), 129–146.