

DAFTAR PUSTAKA

- Adnyana, I. M. 2020. *Manajemen Investasi dan Portofolio*. Jakarta: Lembaga Penerbitan Universitas Nasional (LPU-UNAS).
- Affandi, P. 2019. *Buku Ajar Riset Operasi*. Purwokerto: CV IRDH.
- Aggarwal, C. C. dan Reddy, C. K. (Eds.). 2014. *Data Clustering: Algorithms and Applications*. New York: Taylor & Francis Group.
- Amorim, L. B. V., Cavalcanti, G. D. C., dan Cruz R. M. O. 2022. The Choice of Scaling Technique Matters for Classification Performance. *Applied Soft Computing*.
- Anugrahayu, M. R. dan Azmi, U. 2023. Stock Portfolio Optimization Using Mean-Variance and Mean Absolute Deviation Model Based On K-Medoids Clustering by Dynamic Time Warping. *Jurnal Matematika, Statistika dan Komputasi* Vol. 20, No. 1, Hal: 164-183.
- Apriliana, T. dan Widodo, E. 2023. Analisis Cluster Hierarki untuk Pengelompokan Provinsi di Indonesia berdasarkan Jumlah Base Transceiver Station dan Kekuatan Sinyal. *KONSTELASI: Konvergensi Teknologi dan Sistem Informasi* Vol. 3, No. 2, Hal: 286-296.
- Bank Indonesia. 2024. *BI-Rate*. Tersedia: <https://www.bi.go.id/id/statistik/indikator/bi-rate.aspx> (diakses pada tanggal 15 Maret 2025).
- Bursa Efek Indonesia. 2024. *Indeks Saham*. Tersedia: <https://www.idx.co.id/id/data-pasar/data-saham/indeks-saham/> (diakses pada tanggal 27 Januari 2025).
- Bursa Efek Indonesia. 2024. *Panduan Indeks IDXQ30*. Tersedia: <https://www.idx.co.id/media/8849/lampiran-panduan-indeks-idxq30-v10.pdf>. (diakses pada tanggal 5 Februari 2025).
- Bursa Efek Indonesia. 2024. *Indeks*. Tersedia: <https://www.idx.co.id/id/produk/indeks> (diakses pada tanggal 27 Januari 2025).
- Bursa Efek Indonesia. 2024. *Financial Data & Ratio*. Tersedia: <https://www.idx.co.id/id/data-pasar/laporan-statistik/digital-statistic/yearly/listed-company/financial-data-ratio?filter=eyJ5ZWZyIjoyMDI0LCJtb250aCI6MCwicXVhenRlciI6NCwidHlwZSI6InllYXJseSJ9> (diakses pada tanggal 8 Februari 2024).
- Bower, B. dan Wentz, P. 2005. Portfolio Optimization: MAD vs. Markowitz. *Rose-Hulman Undergraduate Mathematics Journal* Vol. 6 : Iss. 2, Article 3.
- Daftar *Closing Price* Saham. <https://finance.yahoo.com/> (diakses pada tanggal 12 Februari 2025).

- Fadhilah, N., Prihandono, B., dan Yudhi. 2023. Modifikasi Metode Big-M dan Analisis Sensitivitasnya untuk Optimasi Produksi Usaha Kecil Menengah. *EULER: Jurnal Ilmiah Matematika, Sains dan Teknologi* Vol. 11, No. 2, Hal: 293-305.
- Gubu, L., Rosadi, D., dan Abdurakhman. 2020. Robust Mean-Variance Portfolio Selection With Ward and Complete Linkage Clustering Algorithm. *Economic Computation and Economic Cybernetics Studies and Research* Vol 54, No. 3, Hal: 111–127.
- Gubu, L., Rosadi, D., dan Abdurakhman. 2021. Pembentukan Portofolio Saham Menggunakan Klastering Time Series K-Medoid dengan Ukuran Jarak Dynamic Time Warping. *Jurnal Aplikasi Statistika & Komputasi Statistik* Vol 13, No. 2, Hal: 2086-4132.
- Gujarati, D. 1978. *Ekonometrika Dasar*. Jakarta: Erlangga.
- Hair, J. F., Jr., Black, W. C., Babin, B. J., dan Anderson, R. E. 2019. *Multivariate Data Analysis*. 8th Edition. Andover: Cengage Learning EMEA.
- Han, J., Kamber, M., dan Pei, J. 2011. *Data Mining: Concepts and Techniques*. 3rd Edition. Waltham: Morgan Kaufmann Publishers.
- Handoyo, R., Rumani, R., dan Nasution, S. M. 2014. Perbandingan Metode Clustering Menggunakan Metode Single Linkage dan K-Means pada Pengelompokan Dokumen. *JSM STMIK Mikroskil* Vol. 15, No. 2, Hal: 73-82.
- Hartono, J. 2022. *Portofolio dan Analisis Investasi Pendekatan Modul*. Edisi Kedua. Yogyakarta: ANDI.
- Johnson, R. A. dan Wichern, D. W. 2007. *Applied Multivariate Statistical Analysis*. 6th Edition. New Jersey: Pearson Prentice Hall.
- Kasmir. 2016. *Analisis Laporan Keuangan*. Jakarta: PT Raja Grafindo Persada.
- Kaufman, L. dan Rousseeuw, P. J. 1989. *Finding Groups in Data: An Introduction to Cluster Analysis*. Canada: John Wiley & Sons, Inc.
- Konno, H. dan Yamazaki, H. 1991. Mean-Absolute Deviation Portfolio Optimization Model and Its Applications to Tokyo Stock Market. *Management Science* Vol. 37, No. 5, Hal: 519-531.
- Leon, D., Aragon, A., Sandoval, J., Hernandez, G., Arevalo, A., dan Nino, J. 2017. Clustering Algorithms for Risk-Adjusted Portfolio Construction. *Procedia Computer Science* 108C, Hal: 1334–1343.
- Markowitz, H. M. 1952. Portfolio Selection. *The Journal of Finance* Vol. 7, No. 1, Hal: 77-91.
- Markowitz, H. M. 1959. *Portfolio Selection: Efficient Diversification of Investments*. New York: John Wiley & Sons, Inc.
- Maruddani, D. A. I. 2019. *Value at Risk Untuk Pengukuran Risiko Investasi Saham: Aplikasi dengan Program R*. Ponorogo: WADE GROUP.

- Mitran, S. 2019. *Hierarchical Clustering Techniques*. University of North Carolina at Chapel Hill. Tersedia: <http://mitran-lab.amath.unc.edu/courses/MATH590/biblio/Clustering.ch7.HierarchicalClustering.pdf> (diakses pada tanggal 22 Maret 2025).
- Murtagh, F. dan Legendre, P. 2014. Ward's Hierarchical Agglomerative Clustering Method: Which Algorithms Implement Ward's Criterion. *Journal of Classification* Vol. 31, Hal: 274-295.
- Ratih, D., Prihatini, A. E., dan Saryadi, S. 2013. Pengaruh EPS, PER, DER, ROE Terhadap Harga Saham pada Perusahaan Sektor Pertambangan yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2010-2012. *Jurnal Ilmu Administrasi Bisnis* Vol. 3, No. 1, Hal: 83-94.
- Razali, N. M. dan Wah, Y. B. 2011. Power Comparisons of Shapiro-Wilk, Kolmogorov-Smirnov, Lilliefors and Anderson-Darling Tests. *Journal of Statistical Modeling and Analytics* Vol. 2, No. 1, Hal: 21–33.
- Rousseeuw, P. J. 1987. Silhouettes: A Graphical Aid to The Interpretation and Validation of Cluster Analysis. *Journal of Computational and Applied Mathematics* Vol. 20, Hal: 53-65.
- Santoso, A., Syahputri, A., Puspita, G., Nurhikmat, M., Dewi, S., Arisandy, M., Nugraha, A., Anggraeni, I. S. K., Azizi, E., Yulaikah, Y., Novyarni, N., Nurliana, N., Zahara, V. M., dan Sasmyati, R. Y. 2023. *Manajemen Investasi dan Portofolio*. Purbalingga: Eureka Media Aksara.
- Sharpe, W. F. 1994. The Sharpe Ratio. *The Journal of Portfolio Management* Vol. 21, No. 1, Hal: 49–58.
- Simorangkir, C. 2019. Pengaruh Kinerja Keuangan Terhadap Return Saham Perusahaan Pertambangan. *Jurnal Bisnis Dan Akuntansi* Vol. 21, No. 2, Des, Hal: 155-164.
- Singh, D. dan Singh, B. 2020. Investigating The Impact of Data Normalization on Classification Performance. *Applied Soft Computing* Vol. 97.
- Siringoringo, H. 2005. *Pemrograman Linear: Seri Teknik Operasi*. Yogyakarta: Graha Ilmu.
- Syaifuddin, D. T. 2011. *Riset Operasi (Aplikasi Quantitative Analysis for Management)*. Malang: Penerbit Percetakan CV Citra Malang.
- Tandelilin, E. 2017. *Pasar Modal: Manajemen Portofolio dan Investasi*. Sleman: Kanisius.
- Trihudyatmanto, M. 2018. *Riset Operasional: (Operations Research) & Penyelesaian menggunakan Software WinQSB*. Pekalongan: PT Nasya Expanding Management.
- Tsay, R. S. 2005. *Analysis of Financial Time Series*. 2nd Edition. Canada: John Wiley & Sons, Inc.

- Untari, E., Astuti, I. P., dan Susanto, D. 2023. Penerapan Metode Simplex Dengan Microsoft Excel (Solver) Untuk Optimalisasi Hasil Penjualan Tempe. *EDUKASIA: Jurnal Pendidikan dan Pembelajaran* Vol. 4, No.1, Hal: 567-574.
- Ward, J. H. 1963. Hierarchical Grouping to Optimize an Objective Function. *Journal of the American Statistical Association* Vol. 58, No. 301, Hal: 236-244.
- Wirdasari, D. 2009. Metode Simpleks dalam Program Linier. *Jurnal SAINTIKOM* Vol. 6, No. 1, Hal: 276-285.
- Zain, Z. A. 2021. Analisis Cluster Metode K-Means dan Ward dalam Pembentukan Portofolio Robust. *Skripsi*. Program Studi Matematika Fakultas Sains dan Teknologi Universitas Islam Negeri Sunan Kalijaga.