

## DAFTAR PUSTAKA

- Abdul Halim. (2005). *Analisis Investasi Edisi 2*. Jakarta: Salemba Empat.
- Agnes Dwi Wulandari. (2015). Pengaruh Ukuran Data *Return* Terhadap Kinerja Portofolio Black Litterman pada Saham Syariah Jakarta Islamic Indeks. *Skripsi*. Yogyakarta: UNY.
- Anton, Howard. (2010). *Elementary Linear Algebra*. New York: Anton Textbook.
- Bain, L. J., & Engelhardt, M. (1992). *Introduction to Probability and Mathematical Statistic*. California: Duxbury Press.
- Benartzi and Thaler. (2001). Naive Diversification Strategies in Defined Contribution Saving Plans. *The American Economic Review*, Vol 91, Maret ; 79-98.
- Bessler Wolfgang., Heiko Offer., & Dominik Wolf. (2014). Multi-Asset Portofolio Optimization and Out-of-Sample Performance: An Evaluation of Black-Litterman, Mean Variance, and Naive Diversification Approaches. *European Journal of Finance, Forthcoming*, 1-38.
- Black., Fischer and Litterman, Robert. (1992). Global Portfolio Optimization. *Financial Analysts Journal*, Sep/Oct; 48.
- Clarke Roger., Harindra de Silva., and Steven Thorley. (2011). Minimum Variance Portfolio Composition. *The Journal of Portfolio Management*, Juli, 1-27.
- Eduardus Tandelilin. (2001). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Yogyakarta: BPPE-Yogyakarta.
- He, G., and Litterman, R. (1999). The Intuition Behind Black Litterman Model Portofolio. *Investment Management Research*. Goldman, Sachs & Company
- Idzorek, Thomas. (2005). A Step by Step to The Black Litterman Model. 1-34.
- Jogiyanto Hartono. (2014). *Teori dan Praktik Portofolio dengsn Excel*. Jakarta: Salemba Empat.
- Jogiyanto Hartono. (2003). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi Edisi Kesembilan*. Yogyakarta: BPFE-Yogyakarta.

- Johnson, R. A., & Wichern, D. W. (2007). *Applied Multivariate Statistical Analysis*. New Jersey: Pearson Education, Inc.
- Kempf Alexander. (2006). Estimating The Global Minimum Variance Portfolio. *Schmalenbach Business Review*, Vol. 58, Oktober, 332-348 .
- Kertonegoro Senatnoe. (2000). *Analisa dan Manajemen Investasi, Edisi Pertama*. Jakarta: PT Widya Press.
- Markowitz, Harry. (1952). Portofolio Selection. *Jurnal of Finance*, Vol. 7, No. 1, 77-91.
- Murray R. Spiegel, J. S. (2004). *Probabilitas dan Statistik Edisi Kedua*. Jakarta: Erlangga.
- Nurhidayah & Adrianto, O. (2014). Penerapan Capital Asset Pricing Model Untuk Menilai Kinerja Saham. *Jurnal JIBEKA*, Vol 8, No 2, Agustus, 45-54.
- Pudjiastuti. (2006). *Matriks Teori dan Aplikasi*. Yogyakarta: Graha Ilmu.
- Retno Subekti. (2008). Model Black Litterman Untuk Optimasi Portofolio. *Tesis*. Yogyakarta: UGM.
- Salomons, Annisa. (2007). The Black Litterman Model Hype or Improvement. *Groningen*.
- Satchell, S., and Scowcroft, A. (2000). A Demystification of The Black Litterman: Managing Quantitive and Traditional Construction. *Journal of Asset Management* , 138-150.
- Sharpe, W. F. (2001). Mutual Fund Performance. *The Journal of Business*, Vol 39, Jan ; 119-138.
- Suad Husnan. (2005). *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan AMP YKPN.
- Sunariyah. (2011). *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*. Yogyakarta: UPP-AMP YKPN.
- Varberg & Purcell. (1987). *Calculus With Analytic Geometry, 5th Edition*. Prentice Hall, Inc.
- Vita Susilo Dewi. (2014). Aplikasi *Neural Network* Algoritma *Backpropagation* pada *Views* untuk Portofolio Model Black Litterman. *Skripsi*. Yogyakarta: UNY.

[www.bi.go.id](http://www.bi.go.id), diakses pada Rabu, 3 Februari 2016 pukul 13.14 WIB.

[www.evestment.com](http://www.evestment.com), diakses pada Selasa, 26 Januari 2016 pukul 11.35 WIB.

[www.finance.yahoo.com](http://www.finance.yahoo.com), diakses pada Sabtu, 6 Februari 2016 pukul 19.35 WIB.

[www.investopedia.com](http://www.investopedia.com), diakses pada Selasa, 26 Januari 2016 pukul 11.40 WIB.

[www.parahita.wordpress.com](http://www.parahita.wordpress.com), 24 Januari 2016 pada pukul 12.10 WIB.

[www.portalreksadana.com](http://www.portalreksadana.com), diakses pada Selasa, 26 Januari 2016 pukul 11.28 WIB.

[www.sahamok.com](http://www.sahamok.com), diakses pada Sabtu, 6 Februari 2016 pukul 19.55 WIB.