

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. *E – Journal Universitas Negeri Yogyakarta*. Volume 5 No 1.
- 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.
- Arum Virgina Dewi Kusuma Ratri. (2015). Analisis Portofolio Optimum Saham Syariah Dengan Model Black Litterman. *Jurnal Fourier*. Volume 4 No 1.
- B. Susanta. (1994). *Program Linear*. Yogyakarta.
- Bellman, R. E., & Zadeh, L. A. (1970). *Decision Making in a fuzzy environment*. *Management Sciences*. 17.
- Black., Fischer and Litterman, Robert. (1992). Global Portfolio Optimization. *Financial Analysts Journal*, Sep/Oct; 48.
- Edi Cahyono. (2013). *Pemodelan Matematika Edisi Pertama*. Yogyakarta : Graha Ilmu.
- Dhoriva Urwatul Wutsqa, Retno Subekti dan Rosita Kusumawati. (2014). Radial Basis Function Neural Network for Views Prediction on Black-Litterman Model. *Journal of Innovative Technology and Education*, Vol. 3, 2016, no. 1, 71 - 78.
- Eduardus Tandelilin. (2001). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Yogyakarta: BPPE-Yogyakarta.
- Gerhard Bohm, Gunter Zech. (2010). *Introduction to Statistics and Data Analysis for Physicist*. Hamburg : Deutssches Electronen-Synchrotron.
- He, G., and Litterman, R. (1999). The Intuition Behind Black Litterman Model Portofolio. *Investment Management Research*. Goldman, Sachs & Company
- Hr, Muhammad Nafik. (2009). *Bursa Efek dan Investasi Syariah*. Jakarta : PT Serambi Ilmu Semesta.
- H,-J, Zimmerman. (1991). *Fuzzy Sets, Decision Making and Expert System*. Dordrecht-Boston: Kluwer Academic.

- 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.
- Kenneth D Lawrence, dkk. (2009). *A Fuzzy Programming Approach to Financial Model*.
- Kertonegoro Senatnoe. (2000). *Analisa dan Manajemen Investasi, Edisi Pertama*. Jakarta: PT Widya Press.
- Klir, G. J, Clair St. Ute, dan Yuan Bo. (1997) . *Fuzzy Set Theory (Foundations and Applications)*. USA: Prentice-Hall International
- Kusuma, Dewi. Purnomo, Hari. (2013). *Aplikasi Logika Fuzzy untuk Pendukung Keputusan*. Yogyakarta : Graha Ilmu.
- Lee, E. Stanley., Li R.J. (1993). *Fuzzy Multiple Objective Programming and Compromise Programming with Pareto Optimum*. Fuzzy Sets and System (275-288)
- Markowitz, Harry. (1952). Portofolio Selection. *Jurnal of Finance*, Vol. 7, No. 1, 77-91.
- Mohsen Gharakhani, Seyed Djafar Sadjadi. (2012). *A fuzzy Compromise Programmig approach for the Black-Litterman Portofolio Selection Model*. Decision Secience Letters, 11-22.
- Murray R. Spiegel, J. S. (2004). *Probabilitas dan Statistik Edisi Kedua*. Jakarta: Erlangga.
- M. Zeleny. (1982). *Multiple Descision Making*. New York : McGraww-Hill.
- Prabowo Pudjo Widodo, & R.T. Handayanto. (2012). *Penerapan Soft Computing Dengan MATLAB*. Bandung: Rekayasa Sains.
- Retno Subekti. (2008). Model Black Litterman Untuk Optimasi Portofolio. *Tesis*. Yogyakarta: UGM.
- Retno Subekti. Purwati. (2014). Pembentukan Views dengan Pendekatan Time Series pada model Black Litterman. Prosiding Konferensi Nasional Matematika XVII - 2014. 11 - 14 Juni 2014. ITS : Surabaya.
- Ross, T. J. (2010). *Fuzzy Logic with Engineering Applications (3 e dE.n)*. gland: John Wiley & Sons Inc.

- Sara Haerunnisa. (2016). Kinerja Model Black Litterman dengan Strategi Diversifikasi Naïve dan Minimum Variance dalam Analisis Portofolio Saham Syariah. E – Journal Universitas Negeri Yogyakarta. Volume 5 No 3.
- Salomons, Annisa. (2007). The Black Litterman Model Hype or Improvement. *Gro-ningen*.
- Satchell, S., and Scowcroft, A. (2000). A Demystification of The Black Litterman: Managing Quantitive and Traditional Construction. *Journal of Asset Management* , 138-150.
- Sharpe, William. (1966). *Mutual Fund Performance*. The Journal of Business, vol 39, No 1 Part 2, 119-138.
- Sri Kusumadewi . (2003). *Artificial Intelligent Edisi 2*. Yogyakarta: Graha Ilmu.
- Sri Kusumadewi , & Sri Hartati. (2010). *Neuro Fuzzy: Integrasi Sistem Fuzzy & Jaringan Syaraf Edisi 2*. Yogyakarta: Graha Ilmu
- Sri Kusumadewi , & Hari Pramono. (2013). *Aplikasi Logika Fuzzy untuk Pendukung Keputusan Edisi 2*. Yogyakarta: Graha Ilmu
- 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.
- Vita Susilo Dewi. (2014). Aplikasi Neural Network Algoritma Backpropagation pada Views untuk Portofolio Model Black Litterman. Skripsi. Yogyakarta: UNY.
- Wang, Li-Xiin. (1997). *A Course in Fuzzy System and Control*. USA : Prentice – Hall International.
- www.finance.yahoo.com, diakses pada Jumat, 13 Januari 2017 pukul 15.35 WIB.
- www.sahamok.com, diakses pada Jumat, 13 Januari 2017 pukul 15.35 WIB.
- www.bi.go.id, diakses pada Jumat, 13 Januari 2017 pukul 15.40 WIB.
- www.idx.co.id diakses pada Jumat, 13 Januari 2017 pukul 15.20 WIB.