

DAFTAR PUSTAKA

- Anton, H. (2010). *Elementary Linear Algebra*. New York: Anton Textbook.
- Azizah, S. (2014). *Pengukuran Kinerja Portofolio Saham Menggunakan Model Black-Litterman Berdasarkan Indeks Treynor, Indeks Sharpe, dan Indeks Jensen*. Semarang: Universitas Diponegoro.
- Bain, L. J., & Engelhardt, M. (1992). *Introduction to Probability and Mathematical Statistic*. California: Duxbury Press.
- Black., F. & Litterman, R. (1992). Global Portfolio Optimization. *Financial Analysts Journal*.
- Erik, N. (2012). Portofolio Optimazion An Evaluation of the Black-Litterman Approach. *Master of Science in Applied Economics & Finance*.
- Halim, A. (2005). *Analisis Investasi Edisi 2*. Jakarta: Salemba Empat.
- Hanke, J. E., & Winchern, D. (2005). *Business Forecasting*. Pearson Prentice Hall: New Jersey.
- Harahap, S., & Pardomuan P. (2003). Analisis Perbandingan Kinerja Reksa Dana Syariah terhadap Reksa Dana Konvensional (Reksa Dana Mawar) Tahun 1997-2001. *Media Riset Bisnis & Manajemen*, Volume 3 No 3.
- Hartono, J. (2014). *Teori dan Praktik Portofolio dengsn Excel*. Jakarta: Salemba Empat.
- Hartono, J. (2003). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi Edisi Kesembilan*. Yogyakarta: BPFE-Yogyakarta.
- He, G., & Litterman, R. (1999). The Intuition Behind Black Litterman Model Portofolio. *Investment Management Research*.
- Husnan, S. (2005). *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan AMP YKPN.
- Idzorek, T. (2005). A Step by Step to The Black Litterman Model. 1-34.
- Johnson, R. A., & Wichern, D. W. (2007). *Applied Multivariate Statistical Analysis*. New Jersey: Pearson Education, Inc.
- Manurung, A. H. (2008). *Dana Investasi*. Jakarta: Penerbit Buku Kompas.

- Markowitz, H. (1952). Portofolio Selection. *Jurnal of Finance*, Vol. 7, No. 1, 77-91.
- Merdekawati, I. (2015). *Analisis Reksa Dana dengan Menggunakan Metode Sharpe, Treynor, Jensen, dan M² pada Bursa Efek Indonesia pada Tahun 2012-2014*. Yogyakarta: Universitas Negeri Yogyakarta.
- Murray, R. S. (2004). *Probabilitas dan Statistik Edisi Kedua*. Jakarta: Erlangga.
- Pratomo, E & Ubaidillah, N. (2009). *Reksa Dana Solusi Perencanaan Investasi di Era Modern*. Jakarta: Garamedia Pustaka Utama.
- Pudjiastuti. (2006). *Matriks Teori dan Aplikasi*. Yogyakarta: Graha Ilmu.
- Subekti, R. (2008). Aplikasi Model Black-Litterman dengan pendekatan Bayes (Studi kasus: portofolio dengan 4 saham dari S&P500). *Proceeding Semnas Matematika UNY November 2008*. Yogyakarta.
- Subekti, R., Saptanningtyas, F. Y., & Insani, N. (2012). Pembentukan Portofolio Optimal di Pasar Saham Indonesia dengan Kalibrasi Estimasi Parameter Model Black-Litterman. *Laporan Penelitian Dosen Yuniior Anggota Pusdi*. Yogyakarta.
- Samsul, M. (2006). *Pasar Modal dan Manajemen dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Erlangga.
- Satchell, S., & Scowcroft, A. (2000). A Demystification of the B-L Model: Managing Quantitative and Traditional Portofolio Construction. *Journal of Asset Management*. Vol.1, No. 2, 138-150.
- Senatnoe, K. (2000). *Analisa dan Manajemen Investasi, Edisi Pertama*. Jakarta: PT Widya Press.
- Sharpe, W. F. (2001). Mutual Fund Performance. *The Journal of Business*, Vol.39, 119-138.
- Sumiati, & Tika, W. (2012). *Analisis Kelayakan Model Nam (Nedbor Afstromnings Model) Untuk Prediksi Ketersediaan Air Pada Das Ho*. Bali: Universitas Udayana.
- Tandelilin, E. (2001). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Yogyakarta: BPPE-Yogyakarta.
- Tandelilin, E. (2010). *Portofolio dan Investasi*. Yogyakarta: Kanisius.

Victor, S. (2010). Analisis Perbandingan Kinerja Reksa Dana Campuran dengan Reksa Dana Saham. *Jurnal Akuntansi Pasar Modal*. Vol. 9, No. 2. Jakarta: Universitas Trisakti.

www.boomberg.com, diakses pada Kamis, 16 Maret 2017 pukul 11.28 WIB.

www.finance.yahoo.com, diakses pada Kamis, 16 Maret 2017 pukul 21.32 WIB.

www.bi.go.id, diakses pada Sabtu, 8 April 2017 pukul 20.15 WIB.