

DAFTAR PUSTAKA

- Alfarisi, S. 2017. Sistem Prediksi penjualan gamis toko qitaz menggunakan metode single exponential smoothing. *JABE (Journal of Applied Business and Economic)* Vol. 4 No. 1, Hal: 80-95.
- Arisena, A., dan Ikhsan, S. 2019. *Return* Portofolio Optimal Menggunakan Single View Black-Litterman Model dengan Pendekatan ARIMA (Autoregressive Integrated Moving Average. *Jurnal Co Management* Vol. 1, No. 2, Hal: 258-264.
- Atmaja, M., Z., E., Prahutama, A., dan Ispriyanti, D. 2021. Pembentukan dan Pengukuran Kinerja Portofolio Efisien dengan Metode *Constant Correlation Model* menggunakan GUI MATLAB (Studi Kasus: Kelompok Saham pada Indeks JII, LQ45, dan INFOBANK15). *Jurnal Gaussian* Vol. 10, No. 2, Hal: 180-189.
- Bodie, Z., Kane, A., dan Marcus, A., J. 2013. *Investments*, Tenth Edition. Mc-Graw Hill Education.
- Chang, P.-C., Wang, Y.-W., dan Liu, C.-H. 2007. The development of a weighted evolving fuzzy neural network for PCB sales forecasting. *Expert Systems with Applications* Vol. 32, Hal: 86-96.
- Daniel, W., W. 1978. *Applied Nonparametric Statistics*, Second Edition. Books/Cole Cengage Learning.
- Desiyanti, R. 2017. *Teori Investasi dan Portofolio*. Padang: Bung Hatta University Pers.

- Hansun, S. 2013. A new approach of moving average method in time series analysis. *Conference on new media studies (CoNMedia)* Hal: 1-4.
- Hansun, S. 2013. Penerapan WEMA dalam peramalan data IHSG. *Ultimatics: Jurnal Teknik Informatika* Vol. 5, No. 2, Hal: 63-66.
- He, G., dan Litterman, R. 1999. *The intuition behind Black-Litterman model portfolios*. Goldman, Sachs dan Co.
- Herlansyah, R., R., dan Saepudin, D. 2023. USE OF THE BLACK-LITTERMAN MODEL IN PORTFOLIO OPTIMIZATION FOR ACTIVE INVESTORS ON STOCKS IN LQ45 INDEX. *JUPI (Jurnal Ilmiah Penelitian dan Pembelajaran Informatika)*, Vol. 8, No. 1, Hal: 181-188.
- Idzorek, T. 2004. *A step-by-step guide to the Black-Litterman model: incorporating user specified confidence levels*. Zephyr Associates.
- Jogiyanto, H. 2016. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, Edisi Kedelapan. Yogyakarta: Bpfe.
- Kusumawardhani, D. A. 2024. Optimisasi Portofolio Saham Jakarta Islamic Index (JII) Menggunakan Model Black-Litterman Dengan Pendekatan Arima-Garch. Skripsi Sarjana. Program Studi Matematika Fakultas Sains dan Matematika Universitas Diponegoro Semarang.
- Liawati. 2011. Analisis Diversifikasi dan Ukuran Perusahaan terhadap *Return*, Resiko, dan Portofolio. Skripsi. Program Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah Jakarta.
- Lütkepohl, H. 2005. New introduction to multiple time series analysis. *Springers Science dan Business Media*.

- Makridakis, S., Wheelwright, S., C., dan McGee, V., E. 1999. *Metode dan Aplikasi Peramalan*, Jilid 1. Erlangga, Jakarta.
- Tazilla, N., A. 2022. Penerapan Model Black-Litterman dengan Estimasi EGARCH-M dalam Portofolio Saham LQ-45. Skripsi Sarjana. Program Studi Statistika Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam Universitas Gadjah Mada.
- Jorion, P. 2007. *Value at Risk: The New Benchmark for Managing Financial Risk*, Third Edition. The McGraw-Hill Companies, Inc.
- Rahmawati, I. Y., dan Pandansari, T. 2020. Pengujian Anomali January Effect Terhadap Saham Pada Perusahaan Yang Terdaftar Di Jakarta Islamic Index. *Media Ekonomi* Vol. 20, No. 1, Hal: 6-15.
- Satchell, S., dan Scrowcroft, A. 2000. A demystification of the Black–Litterman model: Managing quantitative and traditional portfolio construction. *Journal of Asset Management*, Vol. 1, No. 2. Hal: 138-150.
- Subekti, R. 2009. Keunikan Model Black Litterman dalam Pembentukan Portofolio. *Seminar Nasional*. Yogyakarta: FMIPA UNY.
- Widodo, B. W., Achsani, N. A., dan Andati, T. 2017. An application of the Black-Litterman model with ARIMA-ARCH views for Islamic stock portfolio in Indonesian stock exchange. *Asian Journal of Business and Management*, Vol. 5, No. 1.