

DAFTAR PUSTAKA

- Acheampong, P., Agalega, E., & Shibu, A. K. (2014). The Effect of Financial Leverage and Market Size on Stock Returns on the. *Journal of Financial Research*, 125-134.
- Adiwiratama, J. (2012). Pengaruh Informasi Laba, Arus Kas dan Size Persahaan Terhadap Return Saham. *Jurnal Ilmiah Akuntansi dan Humanika* , 1-25.
- Al-Mwalla, M., & Karasneh, M. (2011). Fama and French Three Factor Model : Evidence from Emerging Market. *European Journal of Economics, Finance and Administrative Sciences*, 132-140.
- Baltagi, B. H. (2012). *Econometric Analysis of Panel Data* . New Jersey: Wiley & Sons.
- Baltagi, B. H. (2015). *The Oxford Handbook of Panel Data* . New York: Oxford University Press.
- bi.go.id. (t.thn.). *BI 7-day (Reserve) Repo Rate*. Dipetik Juni 20, 2020, dari <https://www.bi.go.id/id/moneter/bi-7day-RR/data/Contents/Default.aspx>
- Brigham, E. F., & Houston, J. F. (2012). *Fundamentals of Financial Management*. United States: South-Western Cengage Learning.
- Chui, A. W., & Jhon Wei, K. C. (1998). Book-to-market, firm size, and the turn-of-the-year effect Evidence from Pacific Basin emerging market. *Pacific-Basin Finance Journal*, 275-239.
- Darusman, D., & Prasetiono. (2012). Analisis Pengaruh Firm Size, Book-to-Market Ratio, Price Earning Ratio, dan Momentum, Terhadap Return Portofolio Saham. *Diponegoro Journal of Management*, 212-225.
- Ekonomi.kompas.com. (2017). *Catatan 2017, IHSG Berhasil Tembus Rekor Tertinggi Sepanjang Masa*. Retrieved Mei 19, 2020, from <https://ekonomi.kompas.com/read/2017/12/26/063253926/catatan-2017-ihsg-berhasil-tembus-rekor-tertinggi-sepanjang-masa?page=all>
- Fama, E. F., & French, K. R. (1992). The Cross-Section of Expected Stock Returns. *Journal of Finance*, 427-465.
- Fama, E. F., & French, K. R. (1996). Multifactor Explanations of Asset Pricing Anomalies . *Journal of Finance*, 55-84.
- finance.yahoo.com. (n.d.). *Jakarta Composite Index*. Retrieved Juli 10, 2020, from <https://finance.yahoo.com/quote/%5EJKSE/history?p=%5EJKSE>
- Gujarati, D. (2012). *Econometrics by Example*. New York: Pargrave Macmilan.

- Hasnawati, S. (2005). Dampak Set Peluang Investasi Terhadap Nilai Perusahaan Publik di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Akutansi dan Auditing Indonesia*, 117-126.
- Hardianto, D., & Suherman. (2009). Menguji Fama french-Three Factor-Model di Indonesia. *Jurnal Keuangan dan Perbankan*, 198-208.
- Husein, F., & Mahfud, M. K. (2015). Analisis pengaruh Distress risk, firm size, book-to-market ratio, return on asset, dan debt equity ratio terhadap return saham. *Diponegoro Journal of Management*, 1-15.
- IDX.co.id. (n.d.). *Fact Sheet Inex*. Retrieved Mei 04, 2020, from https://www.idx.co.id/media/8208/fact-sheet_20191230_14_kompas100.pdf
- IDX.co.id. (n.d.). *Laporan Keuangan dan Tahunan*. Retrieved Juni 29, 2020, from <https://www.idx.co.id/perusahaan-tercatat/laporan-keuangan-dan-tahunan/>
- IDX.co.id. (n.d.). *Laporan Tahunan*. Retrieved Mei 06, 2020, from <https://www.idx.co.id/perusahaan-tercatat/laporan-keuangan-dan-tahunan/>
- IDX.co.id. (n.d.). *Ringkasan Performa Perusahaan Tercatat*. Retrieved Juli 5, 2020, from <https://www.idx.co.id/data-pasar/laporan-statistik/ringkasan-performa-perusahaan-tercatat/>
- IDX.co.id. (n.d.). *Ringkasan Saham*. Retrieved Mei 05, 2020, from <https://www.idx.co.id/data-pasar/ringkasan-perdagangan/ringkasan-saham/>
- Janie, D. N. (2012). *Statistik Deskriptif dan Regresi Linier Berganda Dengan SPSS*. Semarang: Semarang University Press.
- Justina, D. (2017). Pengaruh Firm Size dan Market to Book Ratio terhadap Return Portofolio. *Jurnal Manajemen dan Bisnis Sriwijaya*, 138-145.
- Khudoykulov, K. (2017). The analysis of the arbitrage pricing model on the stock return: a case of Athens stock market. *American Journal Finance and Accounting*, 51-63.
- Komara, F. E. dkk. (2019). Analisa Three Factor Fama and French Model terhadap Return pada Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI) Periode 2011-2014. *Jurnal Inspirasi Bisnis dan Manajemen*, 105-116.
- KSEI.co.id. (2018). *Inovasi Untuk Kenyamanan Transaksi di Pasar Modal*. Retrieved April 20, 2020, from KSEI.co.id: https://www.ksei.co.id/files/uploads/press_releases/press_file/id-id/156_berita_pers_21_tahun_ksei_inovasi_untuk_kenyamanan_transaksi_di_pasar_modal_20190111170001.pdf
- KSEI.co.id. (2019). *Mendukung Pengembangan Infrastruktur Untuk Kenyamanan Investasi di Pasar Modal*. Retrieved April 20, 2020, from https://www.ksei.co.id/files/uploads/press_releases/press_file/id-

id/174_berita_pers_22_tahun_ksei_mendukung_pengembangan_infrastruktur_untuk_kenyamanan_investasi_di_pasar_modal_20200123102748.pdf

- Lubis, T. A. (2009). *Manajemen Investasi (Pendekatan Teoritis dan Empiris)*. Malang : Universitas Brawijaya.
- Nugroho, I., & Sukhemi. (2013). Pengaruh Risiko Sistematis dan Likuiditas Terhadap Return saham Pada Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI. *Jurnal Akuntansi*, 63-74.
- Pasaribu, R. B. (2009). Model Fama dan French Sebagai Pembentukan Portfolio Saham di Indonesia. *Jurnal Akutansi dan Bisnis*, 1-12.
- Petty, J. W., Titman, S., Keown, A. J., & Martin, J. D. (2011). *Financial Maagement: Principles and Application*. Australia: Pearson.
- Rachmatika, D. (2006). Analisis Pengaruh Beta Saham, Growth Opportunities, Return On Asset, dan Debt to Equity Ratio Terhadap Return Saham. *Tesis*.
- Saputra, D. I., & Murtini, U. (2008). Perbandingan Fama and French Three Factor Model dengan Capital Asset Pricing Model . *Riset Akuntansi dan Keuangan*, 132-145.
- Saputra, D. I., & Murtini, U. (2008). Perbandingan Faman and French Three Factor Model dengan Capital Asset Pricing Model. *Jurnal Riset Akutansi dan Keuangan*, 132 - 145.
- Sharpe, W. F., Alexander, G. J., & Bailey. , J. V. (2005). *Investasi, Edisi kelima. (Bahasa Indonesia). Jilid I*. Jakarta: PT. Prenhalindo.
- Shleifer, A. (2000). *Inefficient Markets an Introduction to Behavioral Finance*. New York: Oxford University Pers Inc.
- Sudiyatno, B., & Irsad, M. (2011). Menguji Model Tiga Faktor Fama dan French Dalam Mempengaruhi Retrurn Saham Studi Pada Saham LQ 45 di Bursa efek Indonesia. *Jurnal Bisnis dan Ekonomi*, 126-136.
- Sugiarto, A. (2011). Analisa Pengaruh Beta, Size Perusahaan, DER, dan PBV Ratio terhadap return saham. *Jurnal Dinamika Akuntansi*, 8 - 14.
- Suliyanto. (2011). *Ekonometrika Terapan: Teori dan Aplikasi dengan SPSS*. Yogyakarta: Andi.
- Suryani, & Hendryadi. (2015). *Metode Riset Kuantitatif: Teori dan Aplikasi pada Penelitian Bidang Manajemen dan Eknomi Islam*. Jakarta: Kencana.
- Sutarso, Kurniasih, A., & Haningsih, L. (2016). Analisis Pengaruh Multifaktor Terhadap Return Saham Di Indonesia. *Jurnal Manajemen*, 435-452.
- Tandelilin, E. (2017). *Portofolio dan Investasi: Teori dan Aplikasi*. Yogyakarta: Kanisius.

- Widarjono, A. (2007). *Ekonometrika Pengantar dan Aplikasinya*. Yogyakarta: Ekonisia.
- Winarno, W. W. (2017). *Analisis ekonometrika dan Statistika dengan Eviews*. Yogyakarta: Unit Penerbitan dan Percetakan STIM YKPN.
- Wolk, H. I., Dodd, J. L., & Rozycki, J. J. (2008). *Accounting Theory; Conceptual Issues in a Political and Economic Environment* . United States : Sage Publication .
- Yolita, & Fauzie, S. (2015). Analisis Stock Return Perusahaan Perbankan Pada Jakarta Composite Index Menggunakan Fama-French Three-Factor Model . *Jurnal Ekonomi dan Keuangan*, 700-715.
- Yuningsih, I., & Yudaruddin, R. (2007). Pengaruh Model Tiga Faktor Terhadap Return Saham . *Akuntabilitas*, 79-84.

