

## DAFTAR PUSTAKA

- Abdillah, Willy., & Hartono, Jogiyanto, (2015). "Partial Least Square (PLS) Alternatif Structural Equation Modeling (SEM) dalam Penelitian Bisnis". Yogyakarta: Andi Offset
- Agung Sugiarto. (2011). Analisa Pengaruh Beta, Size Perusahaan, Der Dan Pbv Ratio Terhadap Return Saham. *Jurusan Akuntansi, Fakultas Ekonomi, UNIKA Soegijapranata Semarang, Indonesia, Vol. 3, No. 1, Maret 2011*, 8-14.
- Andini Sulistiani. (2020). Pengaruh Return On Equity, Book To Market Ratio Dan Ukuran Perusahaan Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Subsektor Farmasi Yang Terdaftar Di Bei Tahun 2013-2020. *Fakultas Ekonomi Dan Bisnis Universitas Pakuan Bogor*
- Aldi Kosasi, & Prasentiono. (2017). Analisis Pengaruh Book To Market Equity, Firm Size, Market Value Added (Mva), Momentum, Dan Trading Volume Terhadap Return Saham (Studi Kasus Perusahaan Yang Terdaftar Dalam Indeks LQ-45 Periode 2012 s/d 2016). *Departemen Manajemen Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro, Volume 6, Nomor 4, Tahun 2017*, 1-12.
- Alex Tumpal Hutajulu, & Evita Puspitasari. (2019). Analisis Pengaruh Capm Beta, Firm Size, Book To Market Ratio, Dan Momentum Terhadap Return Saham. *Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Universitas Padjadjaran, Vol. 3 No. 2 September 2019*, 1-9.
- Antula, J.Ch, dkk. (2017), Pengaruh Manajemen Laba Dan Earnings Per Share Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Makanan Dan Minuman Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2012-2015, *Jurnal EMBA*, vol.5, 3262-3271
- Desy Septariani. (2015). Pengaruh Financial Ratios Dan Size Terhadap Price To Book Value (Studi Perusahaan Lq45 Yang Terdaftar Di Bei Periode 2010-2013). *Program Studi Pendidikan Ekonomi Fakultas Ilmu Pendidikan dan Pengetahuan Sosial Universitas Indraprasta PGRI, Volume 2 Nomor 2 Desember 2015*, 134-150.
- Dian Rachmatika . (2006). Analisis Pengaruh Beta Saham, Growth Opportunities, Return On Asset Dan Debt To Equity Ratio Terhadap Return Saham Studi Komparatif Pada Perusahaan di BEJ yang Masuk LQ-45 Tahun 2001-2004 Periode Bullish dan Bearish). *Program Studi Magister Manajemen Program Pascasarjana Universitas Diponegoro Semarang* , 1-70.
- Dormauli Justinaa. (2017). Pengaruh Firm Size dan Market to Book Ratio terhadap Return Portofolio. *Jurnal Manajemen dan Bisnis Sriwijaya, Vol.15 (2), 2017*, 139-145.
- Eduardus Tandelilin, (2017). Pasar Modal "Manajemen Portofolio dan Investasi" (G. Sudibyo (ed.)). Yogyakarta: PT. Kanisius

- Esli Silalahi, S. M., & Poltak Theodorus Parhusip, S. M. (2017). PENGARUH FAKTOR FUNDAMENTAL DAN RISIKO SISTEMATIK TERHADAP RETURN SAHAM PADA PERUSAHAAN MANUFAKTUR YANG GO PUBLIK DI BURSA EFEK INDONESIA. *Journal of Applied Business and Economics*, Vol 3 No. 1, Maret 2017, (Hal. 71-88).
- Fawziah, Siti Apriani. (2016). Pengaruh Fama-French Three Factor Model Terhadap Return Saham . Jurnal Universitas Negeri Yogyakarta.
- Fama, E. F, and French, K. R. (1992) The Cross-section of Expected Stock Return, The Journal of Finance. Desember.
- Fama, E.F., and Mc Beth, J.D. (1973) Risk, Return and Equilibrium : Emperical Tests, Journal of Political Economy 81 (May-June)
- Firda Huwaida Ulfah. (2017). Analisis Pengaruh Book To Market, Size, Systematic Risk, Dan Momentum Terhadap Return Saham Small But Liquid Dan Big But Illiquid (Studi pada Perusahaan yang terdaftar di Kompas100 Tahun 2011-2015). *Fakultas Ekonomika Dan Bisnis Universitas Diponegoro Semarang*, 1-18.
- Ghozali, Imam. (2018). Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS 25. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro
- Hadi Ismanto . (2011). Analisis Pengaruh Ukuran Perusahaan, Book -To-Market Value, Dan Beta Terhadap Return Saham Di Bel. *Jurnal Ekonomi & Pendidikan*, Volume 8 Nomor 2, November 2011, 186-205.
- Harsalim, N. (2013). Pengaruh Market Risk, Size, Book to Market Ratio Equity, Distress Risk, and Stock Returns. *Journal Ilmiah Mahasiswa Universitas Surabaya*, Vol. 2, No. 2.
- Jogiyanto, Hartono. 2017. Teori Portofolio dan Analisis Investasi (Edisi Kesebelas). Yogyakarta: BPFE
- Monang Juanda Tua Sihombing, Suhendri Nasution, & Seven Nainggolan. (2018). Faktor – Faktor Yang Mempengaruhi Return Saham Dengan Harga Saham Sebagai Variabel Moderating Pada Perusahaan Manufaktur Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia. *Journal of Information Technology and Accounting binjai*, Vol. I, No. 1, Januari 2018, 1-15.
- Ni Nyoman Devi Septiani, & Ni Luh Supadmi. (2014). Analisis Pengaruh Beta Terhadap Return Saham Periode Sebelum Dan Saat Krisis Global (Studi Pada Perusahaan Perbankan di BEI). *Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Udayana (Unud)*, Bali, Indonesia, 7.1 (2014, 19-32.
- Pramusinta, Winda Safitri. 2015. Analisis Pengaruh Distress Risk, Size, Book To Market, Dan Momentum Terhadap Return Saham (Studi pada perusahaan Sektor Industri Dasar dan Industri Barang Konsumsi periode 2009-2014). *Junal Universitas Diponegoro*
- Puspa Indah Sekar Prianintan, Titi Rapini, & Riawan. (2022). Pengaruh Market Risk, Book To Market Ratio, dan Price Earning Ratio Terhadap Return

- Saham. *Universitas Muhammadiyah Ponorogo*, Vol. 6 No. 2 (2022): Oktober, Hal: 215-226.
- Sista Nurwitasari. (2012). Beta, Size, Book-To-Market Equity Dan Excess Returns Pada Kondisi Pasar Yang Berfluktuasi. *Fakultas Ekonomi Dan Bisnis Universitas Airlangga Surabaya*, i-xiii.
- Widiastari, Putu Ayu dan Yasa, Gerianta Wirawan. 2018. Pengaruh Profitabilitas, Free Cash Flow, dan Ukuran Perusahaan pada Nilai Perusahaan. *E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana* Vol.23.2. Mei (2018): 957-981.
- Windi Novianti dan Wendy May Agustian, 2018, Improving Corporate Values Through the Size of Companies and Capital Structures, *ICOBEST; Atlantis Press* 225, 255-257
- Y.S. Soefian Nur Hidayat, Sri Hasnawati, , & Ernie Hendrawaty. (2019). Pengaruh size dan beta terhadap return pada perusahaan kecil dan besar yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2010-2014. *Universitas Lampung, Jalan Prof . Dr. Sumantri Brojonegoro No. 1 Bandar Lampung 35145, Indonesia, Volume 9 Number 1 Mei - Oktober 2019*, 93-108.
- Yulinda Devi Pramita. (2016). Earnings Quality And Beta On Cost Of Equity Capital Kualitas Laba Dan Beta Terhadap Biaya Modal Ekuitas. *Universitas Muhammadiyah Magelang, Volume 14, Nomor 2, Oktober 2016*, 123-131.