

DAFTAR PUSTAKA

- Smita , D., & Anindita, C. (2018). Fama French Three-factor Model A Comparative Study. *Rukmini Devi Institute Of Advanced Studies, Effulgence, Vol. 16, No. 2, July - December, 2018*, ISSN (O) : 2456-6675, ISSN (P) : 0972-8058.
- Agung, K. (2015). Analisis faktor-faktor yang Mempengaruhi Equity Risk Premium pada Perusahaan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *universitas Lampung*, 50-62.
- Alex, T. h., & Evita, P. (2019). Analisis Pengaruh CAMP Beta, Firm Size, Book to market Ratio, dan Momentum Terhadap Return Saham. *Universitas Telkom, Jurnal Accounting and Finance Edisi Vol. 3 No. 2*, 2581-1088.
- Baskoro, Y. L., & R., J. S. (2015). Analisis Pengaruh Beta, size, Book to Market dan Profitability terhadap Return Aggressive Stock. *Jurnal Of Management Diponegoro., vol 4. Nomor 4*, 1-8.
- Brigham , & Houston . (2012). Dasar Dasar Manajemen Keuangan. *Buku 1 Salemba Empat, Jakarta*.
- Choudhary, K., & Choudhary, S. (2010). Testing Capital Asset Pricing Model Empirical Evidences From Indian Equity Market. *Eurasian Jurnal of Business and Economics*, 3 (6), 127-138.
- Dahoei, & Parvis, S. (2006). Examining The Relationship Between Compani size and stock Exchange Market. 50-62.
- Daniel , N. A., Andi, Y., & Marita, B. (2014). Analisis Perbandingan tingkat Keuntungan dan Risiko Portofolio Dengan Menggunakan Model Indeks TUNggal DAN CAMP (Studi Kasus PAdA Portofolio Saham Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *Program Studi Manajemen Keuangan Sekolah Tinggi Ekonomi Kesatuan, vol. 2 No. 3, 2014*, 191-284.
- Fama, F. (2017). Analisis Pengaruh Book To Market Equity, Firm Size, Market Value Added (MVA), Momentum, Dan Trading Volume Terhadap Return Saham. Studi Kasus Pada Perusahaan Yang Terdaftar dalam Indeks LQ-45. *. Fakultas ekonomi Dan Bisnis Universitas Diponegoro*.
- Farhan, N., Nurmatias, & Wahyudi. (2022). analisis Fama-French 5 Faktor model dalam mempengaruhi Excess Return Saham Pada Lq45. *Universitas Pembangunan Nasional Veteran Jakarta, No 1 Vol*, 12-45.
- Faudia , R. A., Edi, W., & Siti, H. (2022). Pengujian Fama-French Three Factor Model Terhadap Excess Return Saham Pada Perusahaan Indeks Kompas100 Periode 2016-2020. *Universitas Pembanguna Nasional Veteran Jakarta, Ikraith-Ekonomika No 1 Vol 5 Maret 2022*.
- Hardianto, Damar, & Suherman. (2007). Pengujian Fama-French Three Factor Model di indonesia. *Jurnal Keuangan Dan Perbankan, Vol 13, No. 2 Mei, Hal*, 198-208.

- I W. Wedana Yasa, I G. B. Sila Dharma, & I Gst. Ketut Sudipta. (2013). Manajemen Risiko Operasional Dan Pemeliharaan Tempat Pembuangan Akhir (Tpa) Regional Bangli Di Kabupaten Bangli. *Jurnal Spektran Mahasiswa Program Studi Magister Teknik Sipil, Program Pascasarjana Universitas Udayana*, Vol. 1, No. 2, Juli 2013.
- Marista, O., Asyidatur, R., & Samsul, H. (2019). Analisis Pengaruh Ukuran Perusahaan (size) Dan Struktur Modal Terhadap Nilai Perusahaan. *Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Muhammadiyah Surabaya*, Balance Vol. XVI No. 1.
- Marwan , E., & Arie , D. P. (2018). Analisis Beta Saham Harian Terhadap Imbal Saham Harian Sebuah Studi Kasus Saham-saham LQ45 pada Periode Februari – Juli 2015. *Jurnal Ilmiah Manajemen Kesatuan Program Studi Manajemen Keuangan Sekolah Tinggi Ilmu Ekonomi Kesatuan Bogor, Indonesia*, Vol. 6 No.1, 2018, 033 -042.3455TYTYT
- Mossin, J. (1996). Security Pricing and Investment Criteria in Competitive Markets. *The American Economis Review*. 5, 748-756.
- Ni Nyoman, D. S., & Ni, L. S. (2014). analisis pengaruh beta terhadap return saham periode sebelum dan saat krisis global studi pada pada perusahaan perbankan di (BEI). *E-jurnal Akutansi Universitas Udayana*, 7.1, 19-32.
- Nurafiyana , I. (2010). Kemampuan Model Fama and French Three Factor Model dan Model CAMP dalam Menjelaskan Return Saham (studi Kasus Pada JII Periode Januari 2004-Desember 2019). *Universitas Islam Sunan Kalijaga Yogyakarta*.
- Pitriyanti, K., Dharmawan, K., & Gandhiadi , G. (2015). Perbandingan Capital Asset Pricing Model (CAMP) dan Three Factors Model Fama and French (TFMFF) dalam Mengestimasi Return Saham. *E-Jurnal Matematika*, 4 (4), 181-187.
- Richard , I., & Werner, R. M. (2006). Analisis Pengaruh Three Factor Model dan Presentase Kepemilikan Asing terhadap Tingkat Return di Bursa efek Indonesia Pada tahun 2008-2011. *Universitas Of surabaya*, III, 50-62.
- Gunartha, Dwi Putra I Made dan I Made Dana. 2016. Pengaruh Profitabilitas, Leverage, Likuiditas, dan Ukuran Perusahaan Terhadap Return Saham pada Perusahaan Farmasi di BEI. *E-Jurnal Manajemen Unud*, 5(11):
- Har, Wong Pik and Ghafar, M.A.A. 2015. *The Impact of Accounting Earnings on Stock Returns: The Case of Malaysia's Plantation Industry*. *International Journal of Business and Management*, 10(4): 155-165.
- Hartono, J. 2008. Teori Portofolio dan Analisis Investasi, Edisi 5. Yogyakarta : BPFE UGM.
- Husnan, S., dan E. Pudjiastuti. 2009. Dasar-dasar Manajemen Keuangan, Edisi 2. Yogyakarta : UPP AMP-YKPN.
- Hutauruk, M.R., Hj. Sri M., and H. Ardi P. 2014. *Influence of Fundamental Ratio, Market Ratio and Business Performance to The Systematic Risk and Their Impacts to The Return on Shares at the Agricultural Sector Companies at*

The Indonesia Stock Exchange for The Period of 2010-2013. Academic Research International, 5(5): 149-168.

- Indah, Cokorde Istri Puspitadewi. 2016. Pengaruh DER, ROA, PER, dan EVA Terhadap *Return Saham* pada Perusahaan *Food And Beverage* di BEI. *EJurnal Manajemen Unud*, 5(3): 1429-1456.
- Irfani, Agus. 2011. *A Study of Financial Performance and Stock Return in IPO Underpricing Phenomenon on the Indonesia Stock Exchange (IDX)*. *INDONESIAN CAPITAL MARKET REVIEW*, 4(2): 101-116.
- Mahmudah, Umrotul. 2016. Pengaruh ROA, *Firm Size*, dan NPM Terhadap *Return Saham* pada Perusahaan Semen. *Jurnal Ilmu Riset Manajemen*, 5(1): 1-15.
- Martani, Dwi., Mulyono., Khairusizka. 2009. *The Effect of Financial Raatios, Firm Size and Cash Flow From Operating Activities in the interim report to the Stock Return*. *Chinese Business Review*, 8(6): 44-56.
- Mathilda, Mariana dan Meythi. 2012. Pengaruh *Price Earnings Ratio* dan *Price to Book Value* Terhadap *Return Saham* Indeks LQ 45 (Perioda 2007-2009). *Jurnal Akuntansi*, 4(1): 1-21.
- Mazviona, *Batsirai Winmore and Davis Nyangara*. 2014. *Does Firm Size Affect Stock Returns? Evidence From the Zimbabwe Stock Exchange*. *International Journal of Business and Economic Development*, (IJBED), 2(3): 13-17.
- Wiagustini, Ni Luh Putu. 2010. *Dasar-dasar Manajemen Keuangan*. Denpasar. Udayana University Press.
- Wirawan, Nata. 2002. *Cara Mudah Memahami Statistik 2 (Statistik Inferensia) Untuk Ekonomi dan Bisnis*. Edisi Kedua. Denpasar: Keramat Emas.
- Yongyoot Chairatanawan. 2008. *Predictive Power of Financial Ratios to Stock Return in Thailand*. *Institute of International Studides, Ramkhamhaeng University Bangkok, Thailand*. RU. Int. J. 2 (2): 113-120.
- Zulaikha, Muhammad H. 2013. Pengaruh *Earnings Per Share*, *Return Saham*, Kualitas Audit, dan Hasil Laba Terhadap *Return Saham* Satu Tahun Kedepan. *E-Journal-S1.Undip*, 2(3): 1-9.