

DAFTAR PUSTAKA

- Adityo. 2012. *Analisis Pengaruh Corporate Social Responsibility, Beta, Firm Size dan Book to Market Ratio Terhadap Return Saham (Studi Kasus Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI Periode 2010-2011)*. Undergraduate Thesis. Semarang. Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro
- Ang, Robert 1997. *Buku Pintar: Pasar Modal Indonesia*. Jakarta: Erlangga
- Aprilianto, Robi. 2014. *Analisis Superioritas Pengaruh EVA, EPS, ROA atau ROE Terhadap Return Saham*. Undergraduate Thesis. Yogyakarta: Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Gajah Mada
- Arikunto, S. 2002. *Prosedur Penelitian, Suatu Pendekatan Praktek*. Jakarta: PT. Rineke Cipta
- Black, Fischer. 1972. *Capital Market Equilibrium with Restricted Borrowing*. Journal Business 45, 444-455
- Bodie, K, A. Kane, dan A. J. Marcus. 2014. *Manajemen Portofolio dan Investasi*. Jakarta: Salemba Empat
- Brealy, Richard A. Steward C, Myers. Alan J, Marcus. 2001. *Fundamentals of Corporate Finance*. Third edition. Singapore: Mc Graw Hill
- Brigham, E.F., Gapenski, Louis. 1997. *Intermediate Financial Management*. Fifth edition. Sea Harbor Drive: The Dryden Press
- Christianti, Ari. 2006. *Penentuan Perilaku Kebijakan Struktur Modal Pada Perusahaan Manufaktur di Bursa Efek Jakarta: Hipotesis Static Trade Off Atau Pecking Order Theory*. Simposium Nasional Akuntansi IX
- Downes, John dan Jordan E Goodman. 1999. *Kamus Istilah Keuangan dan Investasi*. Jakarta: PT. Elex Media Komputindo
- Fama, Eugene F., and Keneth R. French. 1992. *The Cross-Section of Expected Stocks Returns*. Journal of Finance Vol XLVII No.2, 427-465
- Fitriati. 2010. *Analisis Hubungan Distress Risk, Firm Size, dan Book to Market Ratio dengan Return Saham Pada Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar*

- di Bursa Efek Indonesia Periode Tahun 2005-2008*. Undergraduate Thesis. Semarang: Universitas Diponegoro
- Frazzini, A. Dan Pedersen L. 2014. *Betting against beta*. Journal of Financial Economics 111. 1-25
- Ghozali, Imam. 2006. *Aplikasi Analisis Multivariate dengan program SPSS*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro
- Hanafi, Mamduh M dan Abdul Halim. 2012. *Analisis Laporan Keuangan*. Edisi 4. Yogyakarta: STIM YKPN
- Harahap, Sofyan Syafri. 2007. *Analisis Kritis Atas Laporan Keuangan*. Edisi 1. Jakarta: raja Grafindo Persada
- Hartono, Jogiyanto. 2007. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi 5. Jogjakarta: BPFE
- Horne, James C. Van dan John M. Wachowicz, JR. 2009. *Prinsip-prinsip Manajemen Keuangan*. Edisi 12 Buku 1. Jakarta: Salemba Empat
- Husnan, Suad. 1998. *Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: Unit Penerbit & Percetakan (UPP) AMP YKPN
- Ikrarnanda, Manda Alvita. 2014. *Analisis Pengaruh Kinerja Keuangan Terhadap Return Saham Perusahaan Industri Jasa Periode 2008-2013*. Yogyakarta: Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Gajah Mada
- Juwita, Cerlienia. 2012. *Pengaruh variable ROA, ROE, DER, EPS dan PER terhadap return saham perusahaan non bank LQ45 Periode 2010-2012*. Undergraduate Thesis. Malang: Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Brawijaya
- Malinan, Rio. 2011. *Pengaruh Current Ratio (CR), Debt to Equity Ratio (DER), Price earning Ratio (PER) dan Return on Asset (ROA) Terhadap Return Saham Perusahaan Pertambangan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2005-2010*. Undergraduate Thesis. Malang: Universitas Brawijaya
- Martani, Dwi, Mulyono dan Rahfiani Khairurizka. 2009. *The Effect of Financial Ratios, Firm Size, and Cash Flow Operating Activities in the Interim*

- Report to the Stock Return*. Undergraduate Thesis. Working Paper. Depok: University of Indonesia
- Myranti, Nuza. 2012. *Pengaruh DER, Kapitalisasi Pasar, dan Turn Over Ratio Terhadap Return Saham pada Perusahaan yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index Periode 2005-2010*. Undergraduate Thesis. Depok: Universitas Indonesia
- Novy-Marx, Robert. 2016. *Understanding Defensive Equity*. NBER Working Paper No. 20591. New York: University of Rockester
- Oktanugroho, G Trisnamurti dan Taufikur Rahman. 2013. *Analisis Pengaruh Pengukuran Kinerja Keuangan Terhadap Return Saham (Studi Kasus Pada Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI periode 2008-2011)*. Undergraduate Thesis. Yogyakarta: Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Gajah Mada
- Prihanantyo, Andika Pandu. 2015. *Analisis Pengaruh Book to Market, Size dan Profitabilitas terhadap Return Defensive Stocks (Studi Empiris pada Perusahaan yang Tercatat dalam Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia pada periode 2010-2013)*. Undergraduate Thesis. Semarang: Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro
- Putra, Dianata Eka. 2005. *Berburu Uang di Pasar Modal*. Cetakan 3. Semarang: Effhar & Dahara Prize
- Putri, Anggi Yulviana. 2016. *Analisis Pengaruh Distress Risk, Firm Size, Book to Market Ratio, Price Earning Ratio, dan Debt to Equity Ratio terhadap Return pada Defensive Stocks (2016)*. Undergraduate Thesis. Semarang: Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro
- Riyanto, Bambang. 1995. *Dasar-dasar Pembelajaran Perusahaan*. Edisi 4. Yogyakarta: BPFE
- Sari, Nur Fita. 20012. *Analisis Pengaruh DER, CR, ROE dan TAT terhadap Return Saham*. Undergraduate Thesis. Semarang: Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro
- Sawir, Agnes. 2003. *Analisis Kinerja Keuangan dan Perencanaan Keuangan Perusahaan*. Jakarta: PT. Gramedia Pustaka Utama

- Sekaran, Uma. 2000. *Metode Penelitian untuk Bisnis*. Edisi 4. Jakarta: Salemba Empat
- Schwert, G. William. 1983. *Size and Stock Return and Other Empirical Regularities*. Journal of Financial Economics. USA: University of Rochester
- Sharpe, William. 1964. *Capital Asset Prices: A Theory of Market Equilibrium*. Journal of Finance
- Sjahrial, Dermawan. 2007. *Pengantar Manajemen Keuangan*. Jakarta: Mitra Wacana Media
- Sugiyono. 2011. *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif dan R&D*. Bandung: Alfabeta
- Tandelilin, Eduardus. 2001. *Portofolio dan Investasi: Teori dan Aplikasi*. Yogyakarta: Kanisius
- Wahyono, Hadi. 2002. *Kompensasi Kinerja Perusahaan Bank dan Asuransi Studi Empiris di Bursa Efek Jakarta. Vol 2*. Jurnal Riset Ekonomi dan Manajemen.