

## DAFTAR PUSTAKA

- Amihud, Yakov. 2002. "Illiquidity and Stock Returns: Cross-Section and Time Series Effects," dalam *The Journal of Financial Market*. Vol.5. hlm. 31-56.
- Ang, Robbert. 1997. *The Intelligent Guide to Indonesian Capital Market*. Jakarta: Mediasoft Indonesia.
- Bodie, Zvi, Alex Kane, dan Alan J. Marcus. 2006. *Investments*. Jakarta: Salemba Empat.
- Carhart, Mark M. 1997. "On Persistence in Mutual Fund Performance," dalam *The Journal of Finance*. No.1/Vol.52. Maret. hlm. 57-82.
- Dichev, Illia D. 1998. "Is the Risk of Bankruptcy a Systematic Risk?," dalam *The Journal of Finance*. Vol.53. Juni. hlm. 1131-1147.
- Elton, Edwin J., Gruber & Cristopher R. Blake. 1995. "Fundamental Economic Variables, Expected Return and Bond Fund Performance," dalam *The Journal of Finance*. No.4/Vol.50. September. hlm. 1229-1256
- Fama, E. F. and French, K. R. 1992. "The Cross-Section of Expected Stock Returns," dalam *The Journal of Finance*. No.2/Vol.47. Juni. hlm. 427-466.
- Fama, E. F. and French, K. R. 1993. "Common Risk Factors in the Returns of Stock and Bonds," dalam *The Journal of Finance*. No.2/Vol.33. Juli. hlm. 3-56.
- Fama, E. F. and French, K. R. 1995. "Size and Book to Market Factors in Earnings and Returns," dalam *The Journal of Finance*. No.1/Vol.50. Maret. hlm. 131-155.
- Fitriati, Ika Rosyada. 2010. "Analisis Hubungan Distress Risk, Firm Size, dan Book to Market Ratio dengan Return Saham." Skripsi S-1 Jurusan Manajemen Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro Semarang.
- Ghozali, Imam. 2005. *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Ghozali, Imam. 2006. *Aplikasi Analisis Multivariate Lanjutan dengan Program SPSS*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Griffin, John M. and Michael L. Lemmon. 2002. "Book to Market Equity, Distress Risk, and Stock Returns," dalam *The Journal of Finance*. No.5/Vol. 58. Oktober. hlm. 171-203.

- Horne, James C. Van dan John M. Wachowicz. 2013. *Fundamentals of Financial Management*. Jakarta: Salemba Empat.
- Indrianto, Nur dan Bambang Supomo. 2009. *Metodologi Penelitian Bisnis*. Yogyakarta: BPFE-Yogyakarta.
- Jegadeesh, Narasimhan and Sheridan Titman. 1993. "Returns to Buying Winners and Selling Losers: Implications for Stock Market Efficiency," dalam *The Journal of Finance*. No.1/Vol.48. Maret. hlm. 65-91.
- Jogiyanto. 2003. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFE-Yogyakarta.
- Jogiyanto. 2009. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFE-Yogyakarta.
- Lai, et al. 2010. "O-score Financial Distress Risk Asset Pricing," dalam *Research in Finance*. Vol.26. Maret. hlm. 51-94.
- Naif, Amir. 2014. "Pengaruh Prediksi Kebangkrutan terhadap Return Saham pada Perusahaan Sektor Keuangan di BEI," dalam *Jurnal Akuntansi Fakultas Ekonomi Universitas Negeri Surabaya*.
- Ohlson, James A. 1980. "Financial Ratios and the Probabilistic Prediction of Bankruptcy," dalam *The Journal of Accounting Research*. No.1/Vol.18. hlm. 109-131.
- Prihanantyo, Andika Pandu. 2015. "Analisis Pengaruh *Book to Market*, *Size*, dan *Profitability* terhadap *Return Defesive Stocks*." Skripsi S-1 Jurusan Manajemen Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro Semarang.
- Raida, Rahmi. 2010. "Pengaruh Risiko Pasar, *Leverage*, dan ukuran perusahaan terhadap *Rate of Return* Saham. Skripsi S-1 Fakultas Ekonomi Universitas Negeri Padang.
- Rizkiana, Sindi Meida. 2011. "Studi Perbandingan Model Penilaian Aset: Model Tiga Faktor Fama dan French dengan *Capital Asset Pricing Model* pada Bursa Efek Indonesia." Skripsi S-1 Jurusan Akuntansi Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro Semarang.
- Riyanto, Bambang. 1995. *Dasar-dasar Pembelanjaan Perusahaan*. Yogyakarta : Yayasan Badan Penerbit Gadjah Mada.
- Sharpe, William F., Gordon J. Alexander, Jeffery V. Bailey. 1997. *Investments*. New Jersey: Prentice Hall, Inc.
- Sugiyono. 2009. *Metode Penelitian Bisnis*. Bandung: Alfabeta.

- Tandelilin, Eduardus. 2001. *Analisis Investasi Dan Manajemen Portofolio*. Yogyakarta: BPFE-Yogyakarta.
- Trisnadewi, Mariana. 2012. “Analisis Pengaruh Risiko Pasar, *Size*, *Book to Market*, dan *Momentum* terhadap keputusan Investor di Bursa Efek Indonesia.” Skripsi S-1 Jurusan Manajemen Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro Semarang.
- Utama, Cynthia Afriani dan Astari Lumondang. 2009. “Pengaruh *Bankruptcy Risk*, *Size*, dan *Book to Market* Perusahaan terhadap Imbal Hasil,” dalam *Jurnal Akuntansi dan Keuangan Indonesia*. No.2/Vol.6. Desember. hlm.152-176. Jakarta: Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia.

*Bloomberg*.

*Indonesia Capital Market Directory*.

[www.idx.com](http://www.idx.com).

*Yahoo Finance*.