

DAFTAR PUSTKA

- Adityo. 2012. Analisis Pengaruh *Corporate Responsibility*, *Beta*, *Firm Size*, dan *Book to Market Ratio* Terhadap Return Saham. Skripsi Sarjana Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro Semarang.
- Ali, Hamza Dan Abdal Samed. 2012. *The Impact of Profitability, Liquidity, Leverage, and Activity ratios on Stock Return*. Tesis tidak dipublikasikan Magister Manajemen Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro Semarang.
- Brigham, Eugene. dan Houston, Joel.F. 2001. “*Manajemen Keuangan*”, Jakarta: Erlangga,
- Brigham, Eugene.F dan Houston, Joel.F. 2009. “*Dasar-dasar Manajemen Keuangan*”. Edisi Kesepuluh. Jakarta: Salemba Empat.
- Darusman, Dery. 2012. Analisis Pengaruh *Firm Size*, *Book to Market Ratio*, *Price Earning Ratio*, dan Momentum terhadap Return Portofolio Saham. Skripsi Sarjana Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro Semarang.
- Dio Vanny, M. 2011. “Menguji Pengaruh Beta Saham Terhadap Return Saham dengan *Unconditional dan Conditional Approach*”. Skripsi Sarjana Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro Semarang.
- Fama, Eugene.F. and French, Keneth.R. 1992. “*The Cross Section of Expected Return*”. The Journal of Finance, Vol. XLVII. Number 2
- Ghozali, Imam. 2005. “*Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS*”. Edisi Ketiga. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Ghozali, Imam. 2006. “*Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS*”. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Ghozali, Imam. 2013. “*Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS 21 Update PLS Regresi*”. Edisi Ketujuh. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Hanafi, Mamduh.M. dan Halim, Abdul. 2003. “*Analisis Laporan Keuangan*”. Yogyakarta: AMP-YKPN.
- Harahap, Sofyan.Syafri. 2004. “*Akuntansi Aktiva Tetap*”. Edisi Ketiga. Jakarta: PT. Raja Grafindo.
- Hartono, Jogyanto. 1998. “*Analisis dan Desain Sistem Informasi : Pendekatan Terstruktur Teori dan Praktek Aplikasi Bisnis*”. Yogyakarta: Andi Offset.

- Hartono, Jogyanto. 2000. *“Teori Portofolio dan Analisis Investasi”*. Edisi kelima. Yogyakarta: BPFE-UGM.
- Hartono, Jogyanto. 2009. *“Analisis dan Desain Sistem Informasi : Pendekatan Terstruktur Teori dan Praktek Aplikasi Bisnis”*. Yogyakarta: Andi Offset.
- Hartono, Jogyanto. (2007). *Metodologi Penelitian Bisnis: Salah Kaprah dan Pengalaman-pengalaman*. Cetakan pertama. Yogyakarta: BPFE.
- Herlambang, Rachmad, Sovi. 2003. *“Pengaruh Earning Power, Return On Equity, Deviden Payout Ratio dan Tingkat Suku Bunga Deposito Terhadap Return Saham (Studi Kasus Pada perusahaan Otomotif di BEJ)”*, Tesis Magister Manajemen Universitas Diponegoro, Semarang.
- Hidayati, Aisyi Anggun et all. 2014. *“Analisis Capital Asset Pricing Model (CAPM) Terhadap Keputusan Investasi Saham (Studi Kasus Pada Perusahaan-perusahaan Sektor Perbankan di BEI tahun 2009 – 2011)”*. Jurnal Administrasi Bisnis, Vol.9 No.1. April 2014. Universitas Brawijaya.
- Husnan, Suad. 2001. *“Manajemen Keuangan Teori dan Penerapan (Keputusan Jangka Pendek)”*. Buku 2. Edisi keempat. Cetakan pertama. Yogyakarta: BPFE.
- Jones, Charles P. 2000. *“Investment: Analysis and Management”* Edisi Ketujuh. New York: John Willey and sons Inc.
- Jogyanto, S.H. 2003. *“Teori Portofolio dan Analisa Investasi”*. Yogyakarta: BPFE.
- Lintner, John. 1965. *“The Valuation of Risk Assets and The Selection of Risky Investment in Stock Portofolio and Capital Budget”*. The Review of Economics and Statistic, Vol.47. No 1, pp 13-37.
- Mona Al-Mwalla. 2012. *“Can Book to Market, Size, and Momentum be Ekstra Risk Factor That Explain The Stock Rate of Return? Evidence from Emerging Market”*. Journal of Finance, Accounting and Management Vol.3(2), 42-57
- Mossin, Jan. 1966. *“Equilibrium in a Capital Assets Market”*. Econometrica, Vol.34. No.4, pp 768-783. Yogyakarta: BPFE.
- Moeljadi, 2006, *“Manajemen Keuangan Pendekatan Kuantitatif dan Kualitatif”*. Yogyakarta: BPFE.
- Mulyadi. 2001. *“Sistem Akuntansi”*. Edisi Ketiga. Cetakan Ketiga. Jakarta: Salemba Empat.
- Nasution, Lestari Indah Annio. 2006. Pengaruh faktor Fundamental dan Tekhnikal Terhadap Harga Saham Prperti yang Terdaftar di Bursa Efek Jakarta. Tesis Program PascaSarjana Universitas Sumatera Utara Medan.

- Novy-Marx, Robert. 2014. “*Understanding Defensive Equity*”. University Rochester, NBER.
- Pardede, Roniko. Dan Silalahi, Esli. 2014. “Pengaruh *Economic Value Added, Return On Asset, Return On Equity, dan Earning Per Share* Terhadap *Return Saham* Pada Perusahaan Manufaktur Yang Terdaftar Di BEI”. *Jurnal Manajemen dan Bisnis*. Vol.14. No.1.
- Prasetyo, Teguh. 2000. “*Analisis Laporan Keuangan dan Nilai Kapitalisasi Pasar sebagai Prediksi Harga Saham di BEJ pada periode Bullish dan Bearish*”. Simposium Nasional Akuntansi III.
- Prihanantyo, Andika. Pandu. 2015. Analisis Pengaruh Book to Market, Size, dan Profitability Terhadap Return Defensive Stocks. Skripsi Sarjana Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro Semarang.
- Rangkuti, Freddy. 2006. “*Analisis SWOT Teknik Membedah Kasus Bisnis*”. Cetakan kedua belas. Jakarta: PT. Gramedia Pustaka Utama.
- Reilly, Frank.K. and Brown, Keith.C. 2000. “*Investment Analysis and Portofolio Management*”. Pennsylvania State University: Dryden Press.
- Rosyada, Ika Fitriati. 2010. Analisis Hubungan Distress Risk, Firm Size, dan Book to Market Ratio, dengan Return Saham. Skripsi Sarjana Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro Semarang.
- Schwert, G. William. 1983. “*Anomalies and Market Eficiency*”. Chapter 15. University of Rochester. NBER.
- Septiani, Ni Nyoman Devi. dan Supadmi, Ni Luh. 2014. “*Analisis Beta Terhadap Return Saham Periode Sebelum dan Saat Krisis Global*”. Skripsi Sarja Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Udayana Bali.
- Sharpe, William.F. 1964. “*Capital Assets Price: A Theory of Market Equilibrium Under Condition of Risk*”. *The Journal of Finance*, Vol.19. No 3, pp.425-442.
- Solechan, Achmad. 2010. “Pengaruh Earning, Manajemen Laba, IOS, Beta, Size, dan Rasio Hutang Terhadap Return Saham Pada Perusahaan yang Go Public di BEI. Skripsi Sarjana STMIK HIMSYA Semarang.
- Sugiyono. 2008. “*Metode Penelitian Kuantitatif Kualitatif dan R&D*”. Bandung: AlfaBeta.
- Sunariyah, 2003. “*Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*”. Edisi ketiga. Yogyakarta: UPP STIM YKPN.
- Tandelilin, Eduardus. 2001. “*Analisis Investasi dan Manajemen Portoflio*”. Edisi Pertama. Yogyakarta: BPFE-UGM.

Trisnadewi, Mariana. 2012. Analisis Pengaruh Risiko Pasar, Size, Book to Market, dan Momentum Terhadap Return Saham. Skripsi Sarjana Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro Semarang.

Utomo, Welly. 2007. "*Analisis Pengaruh Beta dan Varian Return Saham Terhadap Return Saham*". Tesis Magister Manajemen Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro Semarang.

<http://aria.bapepam.go.id/>

<http://www.danareksa.com/>

<http://www.idx.com/>

McClure, Ben. "How Return on Equity Can Help You Find Profitable Stocks". www.investopedia.com diakses pada 18 September 2015

"Daftar Saham Kompas 100". www.sahamok.com diakses pada 2 Juli 2015

"Indeks Kompas 100". www.wikipedia.com diakses pada 10 September 2015