

DAFTAR PUSTAKA

- Al-Mwalla, Mona. 2010. "Can Book-to-Market, Size, And Momentum Be Ekstra Risk Faktor That Explain The Stock Rate Of Return?: Evidence From Emerging Market." Dalam *Journal Of Finance, Accounting, and Management* 3 (2), h.42-57 Juli 2012
- Banz, Rolf W. 1981. "The Relationship Between Return And Market Value Of Common Stock." Dalam *Journal Of Financial Economics* No.9 h.3-18
- Bodie, Zvi, Alex Kane dan Alan J. Marcus. 2006. *Investment*. Jakarta: Salemba Empat
- Chan, Louis K. C, Yasushi Hamao, dan Josef Lakonishok. 1991. "Fundamental And Stock Return In Japan." Dalam Working Paper No. 45, *Journal Of Finance*
- Chan, Louis K. C, Narasimhan Jagadeesh, dan Josef Lakonishok. 1995. "Momentum Strategies." Dalam *NBER Working Paper Series* 5375
- DeBondt , Werner F.M. dan Richard Thaler. 1985. Does The Stock market Overreact? Dalam *The Journal Of Finance* Vol. XL, No.3 Juli 1985
- Du, Ding, dan Xiaobing Shao. 2010. "Momentum and Autocorrelation in Stock Returns." Dalam *International Research Jurnal Of Finance And Economics* 2010
- Fama, Eugene, dan Kaneth French. 1992. "The Cross Section Of Expected Stock Return." dalam *The Journal Of Finance* Vol. XLVII No.2, Juni 1993
- Fama, Eugene, dan Kaneth French. 1993. "Common Risk Factor In The Return On Stock And Bonds." Dalam *Journal Of Financial Economics* No.33 p.3-56
- Fama, Eugene, dan Kaneth French. 1995. "Size And Book To Market Factors In Earnings And Returns." Dalam *The Journal Of Finance* Vol. 50 Issue 1 p.131-155, Maret 1995
- Fama, Eugene, dan Kaneth French. 2011. "Size, Value, and Momentum in International Stock Returns."
- Fitriati, Ika Rosyada. 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.” Skripsi Program Sarjana Fakultas Ekonomi, Universitas Diponegoro Semarang
- Ghozali, Imam. 2006. *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS*. Badan Penerbit Universitas Diponegoro: Semarang
- Gujarati, Damodar. 1999. *Ekonometrika Dasar*. (Terj.) Sumarno Zain. Jakarta: Penerbit Erlangga.
- Halim, Abdul. 2005. *Analisis Investasi*. Ed. 2. Jakarta: Salemba Empat
- Haruman, Tendi, dkk. 2005. “Pengaruh Faktor Fundamental, Indikator Ekonomi Makro, Dan Risiko Sistematis Terhadap Tingkat Pengembalian Saham Di Bursa Efek Jakarta.” Dalam *Jurnal Ekonomi Dan Manajemen* Vol.6 No.3 h.462-477
- Hirschey, Mark dan John Nofsinger. 2008. *Investment Analysis And Behavior*. USA: McGraw Hill Irwin
- Husnan, Suad dan Enny Pudjiastuti. 2004. *Dasar-Dasar teori Portofolio Dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: UPP AMPYKPN
- Irfani, Agus S. dan Akromul Ibad. 2005. “Pengaruh Risiko Pasar Terhadap Required Return Saham Telkom dan Astra Internasional Di Bursa Efek Jakarta 2000-2004.” Dalam *Jurnal Manajemen Keuangan* Vol.12 No.3, September 2005
- Jagadeesh, Narasimhan dan Sheridan Titman. 1993. “Return To Buying Winner And Selling Loser : Implication For Stock Market Efficiency.” *Dalam Journal Of Finance* Vol.46 No.1 Maret 1993
- Jogiyanto. 2000. *Teori Portofolio Dan Analisis Investasi*. Ed. 2. Yogyakarta: BPF
- Jogiyanto. 2003. *Teori Portofolio Dan Analisis Investasi*. Ed. 3. Yogyakarta: BPF
- Karpoff , Jonathan M. 1987. “The Relation Between Price Changes And Trading Volume : A Survey.” Dalam *The Journal Of Financial And Quantitative Analysis*, Vo.22, No.1, h.109-129, Maret 1987
- Lozano B., Martin C. 2006. “Estimating And Evaluating Fama-French And Carhart Model.” Diakses tanggal 25 Februari 2012, dari www.uv.es/qfb.
- Manurung, A. Haymans. 2009. “Berinvestasi Dan Perlindungan Investor Di Pasar Modal.” Dalam *Perbanas Quarterly Review*, Vol. 2 No. 1 Maret 2009

- Moskowitz, Tobias J. 2010. "Momentum Investing: Finally Accessible for Individual Investors", dalam *Investment & Wealth Monitor*, diakses tanggal 12 Maret 2012
- Naftali, Yohan. 2009. "Capital Asset Pricing Model (CAPM)." Diakses tanggal 15 April 2012, dari <http://yohanli.com>
- Novak, Jiri dan Dalibor PETR. 2010. "CAPM Beta, Size, Book To Market, And Momentum In Realized Stock Returns." Dalam *Czech Journal of Economics and Finance* 60, No. 5
- Pasaribu, Rowlan B. F. 2010. "Asset Pricing Model Selection: Indonesian Stock Exchange." Dalam *Jurnal Akuntansi Dan Manajemen* Vol.21 No.3
- Ratnawati, Dyah. "2002. Analisis Volume Transaksi Saham Di Bursa Efek Jakarta." Dalam *Jurnal Penelitian Ilmu Ekonomi* Vol.2 No.4
- Rohman, Abdul. 2005. "Pengaruh Langsung Dan Tidak Langsung Arus Kas Dan Laba Terhadap Volume Perdagangan Saham Pada Emiten Di Bursa Efek Jakarta", dalam *Jurnal Akuntansi dan Auditing* Vol 01, No.02, h. 95-111, Mei 2005
- Rouwenhorst, K. Geert. 1998. "International Momentum Strategies." Dalam *The Journal Of Finance* Vol. LIII No.1, February 1998
- Samsul, Mohamad. 2006. *Pasar Modal Dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Erlangga
- Saputra, Dede I. dan Umi Murtini. 2008. "Perbandingan Fama Dan French *Three Factor Model* Dengan *Capital Asset Pricing Model*." Dalam *Jurnal Riset Akuntansi Dan Keuangan* Vol 4 No.2, Agustus 2008 h.132-145
- Schewrt, G. William. 1983. "Size And Stock Return, And Other Empirical Regularities." Dalam *Journal Of Financial Economics* 12 p.3-12
- Sharpe, William F. 1964. "Capital Asset Prices: A Theory Of Market Equilibrium Under Conditions Of Risk." Dalam *The Journal Of Finance* Vol.19 Issue 3 h.425-442
- Sharpe, William F, Gordin J Alexander, dan Jeffery V Bailey. 1997. *Investasi*. Jakarta: Prenhallindo
- Tai, Chu Shang. 2003. "Are Fama And French And Momentum Factors Really Priced?" Dalam *Journal Of Multifinancial Managing*, Vol.13, h.359-384

Tandelilin, Eduardus. 2001. *Analisis Investasi Dan Manajemen Portofolio*. Ed. 1. Yogyakarta: BPF

Wiksuana , I Gst. Bgs. 2009. "Kinerja Portofolio Saham Berdasarkan Strategi Investasi Momentum Di Pasar Modal Indonesia." Dalam *Jurnal Manajemen Dan Kewirausahaan*, Vol.11, No.1. h.73-84, Maret 2009