

DAFTAR PUSTAKA

- Absari DUA, Sudarma M, Chandrarin G. 2013. *Analisis Pengaruh Faktor Fundamental Perusahaan dan Risiko Sistematis Terhadap Return Saham*. Jurnal Akuntansi 3(2), hal. 1-30.
- Afiyati, Hidayat Tri dan Topowijono. 2018. *Pengaruh Inflasi, Bi Rate dan Nilai Tukar Terhadap Return Saham (Studi Pada Perusahaan Subsektor Food & Beverages Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2013-2016)*. Jurnal Administrasi Bisnis (JAB)|Vol. 61 No. 2 Agustus 2018.
- Aisyafitri. (2015). *Pengaruh Risiko Pasar dan Risiko Likuiditas Terhadap Return Saham Pada Perusahaan (Riset Perusahaan-Perusahaan yang Masuk dalam Kelompok Jakarta Islamic Index 2010-2013)*. Skripsi UIN Sunan Kalijaga. Yogyakarta, 2015.
- Akbar, Rendra dan Sri Herianingrum. 2015. *Pengaruh Price Earning Ratio (PER), Price Book Value (PPV) dan Debt To Equity Ratio (DER) Terhadap Return Saham (Studi terhadap Perusahaan Properti dan Real Estate yang Listing di Indeks Saham Syariah Indonesia)*. JESTT Vol. 2 No. 9 September 2015.
- Aletheari, Ida Ayu Made dan I Ketut Jati. 2016. *Pengaruh Earning Per Share, Price Earning Ratio, Dan Book Value Per Share Pada Harga Saham*. E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana Vol.17.2. November (2016): 1254-1282.
- Amenc N, Le Sourd V. 2003. *Portofolio Theory and Performance Analysis*.Tangerang (ID): John Wiley & Sons.
- Aulianisa, Fitri.(2013).*Pengaruh Faktor Fundamental dan Risiko Sistematis Terhadap Harga Saham di Pasar Modal Syariah (Studi Empiris JII di BEI tahun 2007-2010)*. Jurnal Ekonomi Islam La_Riba, Vol. VII, No. 1, Juli, 2013.
- Aryani, Annisa, Dikdik Tandika dan Azib. 2015. *Pengaruh Risiko Sistematis Terhadap Return Saham (Studi Kasus Sektor Property yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode Tahun 2010-2014)*. Prosidingn Manajemen ISSN: 2460-6545.
- Bodie K, Marcus AJ. 2014. *Manajemen Portofolio dan Investasi*. Jakarta (ID): SalembaEmpat.
- Brealey, Myers, dan Marcus. 2008. *Dasar-dasarManajemenKeuangan*. Edisi 5.Jilid 1. Jakarta: Erlangga.

- Ciftci S. 2014. *The Influence of Macroeconomic Variables on Stock Performance* [thesis]. Enschede (NL): University of Twente.
- Erdugan R. 2012. *The Effect of Economic Factors on the Performance of the Australian Stock Market* [thesis]. Melbourne (AU): Victoria University.
- Evirrio, Stevan, Devi Farah Azizah dan Ferina Nurlaily. (2018). *Pengaruh Risiko Sistematis dan Risiko Tidak Sistematis Terhadap Expected Return Portofolio Optimal (Studi Pada Perusahaan yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index Tahun 2013-2017)*. *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB)* Vol. 61 No. 4. Agustus, 2018.
- Fama EF, MacBeth J. 1973. *Risk Return and Equilibrium: Empirical Tests*. *Journal of Political Economy* 81(3), hal. 607-636.
- Ghozali, Imam. (2013). *Aplikasi Analisis Multivariate Dengan Program SPSS 21, Edisi Kesembilan*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Hadad MD, Wibowo S, dan Besar DS. 2004. *Beta Sektor Sebagai Proxi Imbal Hasil dan Indikator Risiko di Pasar Saham*. *Research Paper Bank Indonesia* 6(12).
- Hadi, Nor, Dr. SE., M.Si., Akt. 2013. *Pasar Modal: Acuan Teoretis dan Praktis Investasi di Instrumen Keuangan Pasar Modal*. Edisi Pertama. Cetakan Pertama. Yogyakarta: Graha Ilmu.
- Hermuningsih, Sri, Anisya Dewi Rahmawati, dan Mujino. (2018). *Faktor-faktor yang Mempengaruhi Return Saham*. *Jurnal EKOBIS Khusus*. September, 2018.
- Husnan S. 2001. *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta (ID): UPP AMP YKPN.
- Jogiyanto, Hartono. (2015). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Sepuluh. Yogyakarta: BFFE.
- Keown AJ, et al. 2010. *Manajemen Keuangan: Prinsip dan Penerapan*. Jakarta (ID): PT. Indeks.
- Kasmir. (2014). *Analisa Laporan Keuangan*. Jakarta: PT Raja Grafindo Persada.
- Kurniasari, Wulan, Adi Wiratno dan Muhammad Yusuf. 2018. *Pengaruh Inflasi dan Suku Bunga Terhadap Return Saham dengan Profitabilitas Sebagai Variabel Intervening Di Perbankan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2013-2015*. *Journal Of Accounting Science* Vol. 2 No. 1 EISSN 2548-3501.

- Lestari, Fia Tri dan Endra Murti Sagoro. (2016). *Pengaruh Risiko Sistematis dan Risiko Tidak Sistematis terhadap Expected Return Portofolio Optimal*. JurnalProfitaEdisi 2 Tahun 2016.
- Lmiyono, Agung Fajar. (2017). *Pengaruh Kinerja Keuangan dan Faktor Ekonomi Makro dalam Memprediksi Volatilitas Harga Saham Perusahaan Subsektor Industri Food And Beverages*. JIAFE (Jurnal Ilmiah Akuntansi Fakultas Ekonomi) Volume 3 No. 1 Tahun 2017, Hal. 35-48.
- Machdar NM. 2015. *The Effect of capital Structure, Systematic Risk, and Unsystematic Risk On Stock Return*. Business and Entrepreneurial Review14(2), hal. 159-160.
- Magistasari, Rizkian. (2017). *Pengaruh Risiko terhadap Return Saham Industri Semen di Bursa Efek Indonesia*. Tesis ITB Tahun 2017.
- Mallik AT, Bepari MK. 2015. *Risk-Return Trade-off in Emerging Markets: Evidence from Dhaka Stock Exchange Bangladesh*. Australian Accounting,Business and Finance Journal 9(1), hal. 71-88.
- Mateev, M., Videv, A. (2008). *Multifactor asset pricing model and stock market in transition : New empirical tests*. Eastern Economic Journal No. 34, pp. 223-237.
- Nachrowi DN, Usman H. 2002. *Penggunaan Teknik Ekonometri: Pendekatan Populer dan Prektis Dilengkapi Teknik Analisis dan Pengolahan Data dengan Menggunakan Paket Program SPSS*. Jakarta (ID): PT Raja GrafindoPersada.
- Noersyam, Ujang dan Dikdik Tandika. 2018. *Pengaruh Earning Per Share (EPS), Price Earning Ratio (PER), Debt to Equity (DER), Return on Asset (ROA), dan Return on Equity (ROE) Terhadap Harga Saham Studi Kasus Pada Perusahaan Go Public Sektor Property dan Real Estate yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2010-2014*. Volume 4 No. 1 Tahun 2018.
- Oktiar, Tri. 2014. *Pengaruh Debt to Equity Ratio, Return on Equity, Tingkat Suku Bunga, dan Inflasi Terhadap Return Saham Perusahaan Subsektor Property dan Real Estate yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2007-2012*. Jurnal Akuntansi. Vol.2 No.2 Desember 2014.
- Pangemanan V. 2013. *Inflasi, Nilai Tukar, Suku Bunga Terhadap Risiko Sistematis Pada Perusahaan Sub-Sektor Food and Beverage di BEI*. Jurnal EMBA 1(3), hal. 189-196.

- Pinatih, Luh Putu Widiantari Kusuma dan Putu Vivi Lestari. (2014). *Pengaruh EPS, ROE, Risiko Sistematis Terhadap Return Saham Perusahaan Otomotif di BEI*. E-journal FEB.UniversitasUdayana, Bali, 2014.
- Purba BM. 2016. *Analisis Pengaruh Jenis Risiko Terhadap Kinerja Saham Indeks Sri Kehati* [tesis]. Bogor (ID): Institut Pertanian Bogor.
- Riyondo, Yudistira Wisentyo. 2016. *Analisis Fundamental Perusahaan dalam Pengambilan Keputusan Investasi Saham Industri Semen yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI)*. E-Journal 6 Juni 2016.
- Ross S, Westerfield, RW dan Jeffrey J. 2012. *Corporate Finance, 10th Edition*. Singapore (SG): McGraw-Hill/Iruin.
- Samsul M. 2006. *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Jakarta (ID): Erlangga.
- Sekaran, Uma. (2006). *Metodologi Penelitian untuk Bisnis, Edisi Keempat*. Jakarta: Penerbit Salemba Empat.
- Sharpe WF, Alexander GJ dan Bailey JV. 1999. *Investasi*. Jakarta (ID):Prehallindo.
- Sihaloho, MeygaTriana E. (2017).*Pengaruh Risiko Investasi dan Ukuran Perusahaan Terhadap Return Saham (Studi pada Perusahaan Makanan dan Minuman yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2011-2015)*.SkripsiUniversitas Lampung. Bandar Lampung, 2017.
- Sugiyono. (2016). *Metode Penelitian Kuantitatif Kualitatif R&D*. Bandung: Alfabeta.
- Sumani dan ChristineSuhari. (2013). *Analisis Pengaruh Risiko Sistematis dan Likuiditas Terhadap Tingkat Pengembalian Saham Dalam Perusahaan Non-Kuangan LQ-45 Periode 2007-2009*. Jurnal, Vol. 17, No. 1, Januari 2013.
- Suryanto. 2015. *Analysis of Abnormal Return Before and After The Announcement of Investment Grade Indonesia*. International Journal of Business andManagement Review 3(1), hal. 11-23.
- Sutrisno. 2012. *Manajemen Keuangan*. Yogyakarta: Ekonisia.
- Tandelilin, Eduardus. (2017). *Pasar Modal Manajemen Portofolio & Investasi*. Daerah Istimewa Yogyakarta: PT Kanisius.
- Umar, Husein. (2008). *Metode Riset Bisnis*. Jakarta: PT Gramedia Pustaka Utama.

www.bi.go.id

www.idx.com

www.yahoofinance.com

www.finance@yahoo.co.id

Yunanto M, Medyawati H. 2009. *Studi Empiris Terhadap Faktor Fundamental dan Teknikal yang Mempengaruhi Return Saham pada Bursa Efek Jakarta*. Jurnal Ekonomi Bisnis 14(1), hal. 28-38.

Yustari, TK. 2010. *Analisis Pengaruh Variabel Makroekonomi Terhadap Return Saham Pertambangan yang Terdaftar di BEI periode Januari 1999 - Desember 2009 Dengan Menggunakan Multifactor Model* [Tesis]. Jakarta(ID): Universitas Indonesia.