

DAFTAR PUSTAKA

- Bodie, Z Kane, A & Marcus A.J. 2005. *Investasi Terjemahan Zuliani D.dan Budi Wibowo*. Edisi Keempat Jakarta : Salemba.
- Fama Eugene F, French Keneth R. 1992. *The Cross Section Of Expected Stock Return Journal Of Finance* Vol XL VII, No 2,427-465.
- Fama Eugene F, French Keneth R. 1995. *Size And Book To Market Factor In Earnings And Returns The Journal Of Finance* vol. L, No. 1 , 1995.
- Fama Eugene F, French Keneth R. 1996. *Multifactor Explanation Of Asset Pricing Anomalies, Journal Of Finance* Vol. LI, NO,1 55-84.
- Gozali, Imam. 2006. *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS*, Edisi 4, Badan Penerbit Undip, Semarang.
- Gujarati, Damodaran. 2003. *Basic Econometrics Fourt Edition. McGraw Hill Companies, Inc, NewYork* 1002 pp.
- Hardiningsih, Pancawati. 2000. *Pengaruh Faktor Fundamental Dan Risiko Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Di BEI : Studi Kasus Basic Industry & Chemical* Jurnal Strategi Bisnis, Vol. 8 Des.
- Ika, Rosyada, Fitriati. 2010. *Analisis Hubungan Distress Risk, Firm Size dan Book to Market Ratio dengan Return Saham*. Skripsi Universitas Diponegoro Semarang.
- Jogiyanto. 2003. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta. BPF E.
- Kamarudin, Ahmad. 2004. *Dasar-dasar Manajemen Investasi dan Portofolio, Edisi Revisi*. Jakarta. Rineka Cipta.
- Lusiana, Lulu. 2013. *Pengaruh Beta, Firm Size, dan Book To Market Ratio Terhadap Return Saham Pada Industri Barang Konsumsi di BEI*. Skripsi Universitas Lampung.

- Riskiana. 2011. *Validitas Model Tiga Faktor Fama dan French dalam Memprediksi Return Saham di BEI di Banding dengan CAPM*. Skripsi Universitas Diponegorong Semarang.
- Ross, S.A. 1976. *The Arbitrage Theory Of Capital Asset Pricing*. *Journal Of Economic Theory*, Vol 13.
- Sanusi, Anwar. 2014. *Metodologi Penelitian Bisnis*. Salemba Empat. Jakarta.
- Sudiyatno, Bambang., dan Irsad, Moch. 2011. *Menguji Tiga Faktor Fama dan French dalam Mempengaruhi Return Saham Studi pada Saham LQ45 di BEI*. *Jurnal Bisnis dan Ekonomi (JBE)*. Universitas Stikubank Semarang Vol.18, No.2. ISSN: 1412-3126.
- Sugiyono. 2013 *Metode Penelitian Kombinasi*. CV Alfabeta. Bandung.
- Sri, Sudarsi. 2002, *Analisis Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi Deviden Payout Ratio Pada Industri Perbankan Yang Listed Di BEI* *Jurnal Bisnis dan Ekonomi*. STIE Stikubank Semarang. Vol 9, No. 1 Maret.
- Universitas Lampung 2010. *Panduan Penulisan Karya Ilmiah*. Universitas Lampung. Bandar Lampung.
- Wahyu, P.H.S. 2014 *Studi Komparasi Penilaian Kinerja Reksa Dana Saham, Reksa Dana Pendapatan Tetap dan Reksa Dana Campuran Dengan Menggunakan Metode APT Dancapm*. Skripsi Universitas Lampung.
- Widoatmodjo, Sawidji. 2005. *Cara Sehat Investasi di Pasar Modal*. Jakarta. PT. Elex Media Komputindo.
- Yuningsih dan Yudarudin. 2007. *Menentukan Pengaruh Model Tiga Faktor terhadap Return Saham*. *Jurnal Bisnis dan Ekonomi*. Universitas Pancasila Jakarta.
- www.bi.go.id diakses pada 3 Agustus 2015.
- www.idx.co.id diakses pada 25 Agustus 2015.
- <http://www.finance.yahoo.com> diakses pada 12 November 2015.