

DAFTAR PUSTAKA

- Adnyana, I. M. (2020). Manajemen Investasi dan Portofolio. In *Lembaga Penerbitan Universitas Nasional (LPU-UNAS)*. Lembaga Penerbitan Universitas Nasional (LPU-UNAS)
- Aprillia, F. R., Warman, E., & Hidayati, S. (2020). Pengujian Fama-French Three Factor Model Terhadap Excess Return Saham Pada Perusahaan Indeks Kompas100 Periode 2016-2020. *Ikraith-Ekonomika*, 5(1), 262–271.
- Awwaliyah, I. N., & Husodo, Z. A. (2019). The Extended Fama-French Three Factor Model: Revisited. *Indonesian Capital Market Review*, 10(2). <https://doi.org/10.21002/icmr.v10i2.11181>
- Dewi, G. A. K. R. S., & Vijaya, D. P. (2018). *Investasi dan Pasar Modal Indonesia* (1st ed.). Rajawali Pers.
- Effendy, M. I. (2021). Pengaruh Excess Return Saham Berdasarkan Fama French Three Factors Model (Studi Pada Perusahaan Sektor Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia). *Jurnal Ilmiah Mahasiswa FEB*, 9(2).
- F. Eugene, B., & Joel F, H. (2018). *Dasar-dasar Manajemen Keuangan Buku 1 Edisi 14* (14th ed.). Salemba Empat.
- Fama, E. ., & French, K. . (1992). The Cross-Section of Expected Stock Returns. *Journal of Finance Volume XLVII, No. 2*.
- Fama, E. ., & French, K. . (1995). Size and Book to Market Factors in Earning and Returns. *Journal of Finance, L, 1*.
- Ghozali. (2016). *Aplikasi Analisis Multivariete Dengan Program IBM SPSS 23* (8th ed.). Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Gujarati, D. N., & Porter, D. C. (2012). *Dasar-dasar Ekonometrika* (5th ed.). McGraw-Hill Education. <https://doi.org/0071276254>
- Handini, S., & Astawinetu, E. D. (2020). *Teori Portofolio dan Pasar Modal Indonesia*. Scopindo Media Pustaka.
- Hardianto, D., & Suherman. (2009). Pengujian Fama-French Three-Factor Model Di Indonesia. *Keuangan*, 13(2), 198–208.
- Harmono. (2022). *Manajemen Keuangan: Berbasis Balanced Scorecard* (R.

- Rachmatika (ed.); 1st ed.). PT Bumi Aksara.
- Hasbiah, S., Anwar, A., & Bado, B. (2022). Model Markowitz Dalam Keputusan Investasi Saham Pada Index Lq45 di Bursa Efek Indonesia. *JEKPEND: Jurnal Ekonomi Dan Pendidikan*, 5(1), 69. <https://doi.org/10.26858/jekpend.v5i1.24709>
- Hayati, M. (2016). Investasi Menurut Perspektif Ekonomi Islam. *Journal of Islamic Economics and Business*, 1(1), 66–78.
- Hidayati, A. N. (2017). Investasi: Analisis dan Relevansinya dengan Ekonomi Islam. *Jurnal Ekonomi Islam*, 8, 227–242.
- Imam, G., & Ratmono, D. (2013). *Analisis Multivariat dan Ekonometrika, Teori, Konsep, dan Aplikasi dengan EViews 8*. Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Indrasetianingsih, A., & Wasik, T. K. (2020). Model Regresi Data Panel Untuk Mengetahui Faktor Yang Mempengaruhi Tingkat Kemiskinan Di Pulau Madura. *Jurnal Gaussian*, 9(3), 355–363. <https://doi.org/10.14710/j.gauss.v9i3.28925>
- Istiqomah, S., & Amanah, L. (2021). Pengaruh Kinerja Keuangan, Kapitalisasi Pasar dan Ukuran Perusahaan terhadap Pengungkapan Corporate Social Responsibility. *Jurnal Ilmu Dan Riset Akuntansi*, 10(2), 1–18.
- Justina, D. (2018). Pengaruh Firm Size dan Market to Book Ratio terhadap Return Portofolio. *Jurnal Manajemen Dan Bisnis Sriwijaya*, 15(2), 138–145. <https://doi.org/10.29259/jmbs.v15i2.5701>
- Mastiah, & Rujikartawi, E. (2023). Analisis Pengaruh Kapitalisasi Pasar dan Harga Saham Terhadap Return Saham Pada Perusahaan yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index Periode 2018-2021. *Tsarwah*, 8(1), 1–12. <https://doi.org/10.32678/tsarwah.v8i1.8127>
- Maulana, Y. (2022). Pemodelan Volatilitas Indeks Harga Saham Sektoral di Indonesia. *Logika : Jurnal Penelitian Universitas Kuningan*, 13.
- Muklis, F. (2016). Perkembangan dan Tantangan Pasar Modal. *Al Masraf (Jurnal Lembaga Keuangan Dan Perbankan)*, 1(1), 67–74.
- Murti, N. N. (2016). Analisis Pembentukan Portofolio Optimal Menggunakan

- Model Indeks Tunggal. *Jurnal Ilmiah Mahasiswa Universitas Brawijaya*, 10 (2), 1–18.
- Nugraha, F. (2020). Analisis Fama French 5 Factors Model Dalam Mempengaruhi Excess Return Saham Pada Lq45. *IKRAITH-EKONOMIKA*, 5(1), 89–102.
- Pardiansyah, E. (2017). Investasi dalam Perspektif Ekonomi Islam: Pendekatan Teoritis dan Empiris. *Economica: Jurnal Ekonomi Islam*, 8(2), 337–373. <https://doi.org/10.21580/economica.2017.8.2.1920>
- Purwanto, N. (2019). Variabel Dalam Penelitian Pendidikan. *Jurnal Teknodik*, 6115, 196–215. <https://doi.org/10.32550/teknodik.v0i0.554>
- Safelia, N. (2012). Konsep Dasar Keputusan Investasi Dan Portfolio. *Manajemen Keuangan*, 1.
- Sahir, S. H. (2021). *Metode Penelitian* (A. Rochmah (ed.); I). KBM Indoensia.
- Sekar Prianintan, P. I. I., Rapini, T., Riawan, R., & Riawan, R. (2022). Pengaruh Market Risk, Book To Market Ratio, dan Price Earning Ratio Terhadap Return Saham. *ISOQUANT : Jurnal Ekonomi, Manajemen Dan Akuntansi*, 6(2), 215–226. <https://doi.org/10.24269/iso.v6i2.1287>
- Sidik, P., & Sunarsi, D. (2021). *Metode Penelitian Kuantitatif* (Della (ed.)). Pascal Books.
- Sudiyatno, B., & Irsad, M. (2011). Menguji model tiga faktor fama dan french dalam mempengaruhi return saham studi pada saham lq45 di bursa efek indonesia. *Jurnal Bisnis Dan Ekonomi (JBE)*, 18(2), 126–137.
- Sudiyatno Moch Irsad, B., & Kendeng Bendan Ngisor, J. V. (2011). Menguji Model Tiga Faktor Fama Dan French Dalam Mempengaruhi Return Saham Studi Pada Saham Lq45 Di Bursa Efek Indonesia Testing Model Three Factors Affecting The Fama and French Study on Return Shares Shares in Indonesia Stock Exchange LQ45. *Jurnal Bisnis Dan Ekonomi (JBE)*, 18(2), 126–136.
- Suharti, E., Edawati, L., Zatira, D., Ak, M., & Th, M. (2022). Manajemen Investasi dan Teori Portofolio. In T. Endi & A. K. Negara (Eds.), *Manajemen Investasi dan Teori Portofolio* (pp. 1–30). Eureka Media Aksara.
- Sujai, M., Cahyadi, Asmawati, & Mekaniwati, A. (2022). *Manajemen Keuangan* (P. T. Cahyono (ed.)). CV Rey Media Grafika.

- Sulistyo Rahayu, V., Indah Mustikowati, R., & Suroso, A. (2020). Pengaruh Ukuran Perusahaan, Pertumbuhan Penjualan Dan Profitabilitas Terhadap Nilai Perusahaan. *Jurnal Riset Mahasiswa Manajemen*, 6(1), 1248–1277. <https://doi.org/10.21067/jrmm.v6i1.4467>
- Syahputri, A. Z., Fallenia, F. Della, & Syafitri, R. (2023). Kerangka berfikir penelitian kuantitatif. *Tarbiyah: Jurnal Ilmu Pendidikan Dan Pengajaran*, 2(1), 160–166.
- Tandelilin, E. (2010). *Dasar-dasar Manajemen Investasi* (pp. 1–34).
- Widyaningsih, E., & Zen, F. (2021). Pengaruh fama-french five factor model terhadap excess return pada perusahaan LQ 45 tahun 2014-2019. *Jurnal Ekonomi Bisnis Dan Pendidikan*, 1(5), 425–438. <https://doi.org/10.17977/um066v1i52021p425-438>
- Wijaya, S. C. W., Muhardi, W. R., & Utami, M. (2017). Analisis Fama French Five Factor Model Dan Three Factor Model Dalam Menjelaskan Return Portofolio Saham Yang Masuk Pada Indeks Kompas 100 Periode 2010-2015. *Jurnal Ilmiah Mahasiswa Universitas Surabaya*, 6(1), 938–959.
- Yuliyana, I. D. (2021). Analisis Model Lima Faktor Fama dan French pada Saham-Saham Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia Periode 2016-2019. *Jurnal Ekonomi, Bisnis, Manajemen Dan Akuntansi*, 18(2), 1–19.

Website

www.idx.co.id

www.bi.go.id

www.bps.go.id