DAFTAR PUSTAKA

Agathia, C., & Sumiati. (2022). Pengaruh Fama-French Five Factor Model Terhadap Return Saham (Vol. 1). http://dx.doi.org/10.

Amalia, R., dkk. (2024). Pengaruh Return on Assets terhadap Harga dan Return Saham pada Perusahaan Indeks SRI KEHATI. Jurnal Akuntansi dan Investasi, 24(1), 67–80.

Anggraini, W., & Jogiyanto, H. M. (2000). Penelitian tentang informasi laba dan dividen kas yang dibawa oleh pengumuman pemecahan saham. *Jurnal Bisnis Dan Akuntansi*, *2*(1), 1–12.

Anwar, C., & Jauhari, A. (2022). Pengaruh Book-to-Market Ratio terhadap Return Saham pada Sektor Manufaktur Pulp dan Kertas di Indonesia. Jurnal Akuntansi Multiparadigma, 14(1), 77–93.

BMoney. (2023). Penyebab IHSG naik dan Turun.

Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. J. (2018). Investments. Ed. 11th.

Brigham, E. F., & Houston, J. F. (2013). *Fundamentals of financial management*. *South-Western Cengage Learning.*

Candika, Y. I. (2017). Pengujian kekuatan model carhart empat faktor terhadap excess return saham di Indonesia. *The Indonesian Journal of Applied Business*, *1*(1), 14–29.

Chiah, M., Chai, D., Zhong, A., & Li, S. (2016). *A Better Model? An empirical investigation of the Fama–French five-factor model in Australia. International Review of Finance, 16(4), 595–638*.

Choiriyah, N., et al. (2021). Pengaruh Profitabilitas terhadap Return Saham di Pasar Modal Indonesia. Jurnal Manajemen dan Bisnis, 20(4), 312–325.

Darmadji, T., & Fakhruddin, H. M. (2022). Pasar Modal di Indonesia (Edisi 7). Jakarta: Salemba Empat.

Dewi, A. O., & Komara, E. F. (2024). Investigate the Influence of the Fama and French Five-Factor Model on the SRI-KEHATI Stock Index (The Period of 2015–2022). Jurnal Manajemen Bisnis, 11(2), 1399–1412. https://doi.org/10.33096/jmb.v11i2.776

Djamaluddin, S., & Roffi, A. (2017). *Fama and French five-factors pricing model testing in Indonesia. International Journal of Business and Management Invention, 6(9), 75–90.*

Durbin, J., & Watson, G. S. (1951). Testing for Serial Correlation in Least Squares Regression. Biometrika

Dwi Yuliyana, I., & Magdalena Sembiring, F. (2021). Analisis Model Lima Faktor Fama dan French pada Saham-Saham Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia Periode 2016-2019. In *Bisnis, Manajemen dan Akuntansi* (Vol. 18, Issue 2). www.idx.co.id

Fama, E. F., & French, K. R. (1993). Common risk factors in the returns on stocks and bonds. *Journal of Financial Economics*, *33*(1), 3–56.

Fama, E. F., & French, K. R. (1993). Common risk factors in the returns on stocks and bonds. Journal of Financial Economics, 33(1), 3–56. https://doi.org/10.1016/0304-405X(93)90023-5

Fama, E. F., & French, K. R. (2015). A five-factor asset pricing model. Journal of Financial Economics, 116(1), 1–22. https://doi.org/10.1016/j.jfineco.2014.10.010

Ghozali, I. (2013). Aplikasi analisis multivariate dengan program. *Edisi Ketujuh. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro*.

Giantari, I. G. A. K. (2024). Pengaruh Ukuran Perusahaan terhadap Return Saham pada Indeks SRI KEHATI. Jurnal Keuangan dan Perbankan, 28(1), 55–67.

Gujarati, D. N., & Porter, D. C. (2012). Dasar-dasar ekonometrika. *Jakarta: Salemba Empat*, *1*.

Hartono, J. (2023). Perilaku Investor di Pasar Berkembang: Studi Kasus Indonesia. Yogyakarta: BPFE.

Hou, K., Xue, C., & Zhang, L. (2017). A comparison of new factor models. *Fisher College of Business Working Paper*, *2015–03*, 05.

Insight Kontan. (2021). *Indeks SRI-KEHATI Merombak Konstituen Sesuai Free Float*.

Jogiyanto, H. (2017). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi (Kesepuluh)*. BPFE.

Kiymaz, H. (2019). Factors influencing SRI fund performance. *Journal of Capital Markets Studies*, *3*(1), 68–81. https://doi.org/10.1108/JCMS-04-2019-0016

Kiymaz, H. (2019). The Impact of Firm Size on ESG Implementation and Investor Confidence. International Journal of Sustainable Finance, 11(4), 301–315.

Lauw, A., Maulana, A., & Komarudin, K. (2025). Efektivitas Faktor Risiko Pasar dalam Model Fama-French Lima Faktor: Tinjauan Literatur Sistematis di Pasar Berkembang. Jurnal Riset Keuangan dan Investasi, 13(1), 45–60.

Lestari, P., Yusuf, A. A., & Maulana, Y. (n.d.). *Analisis Excess return Pada Perusahaan Indeks Saham MNC36 Periode 2020-2022*.

Lintner, J. (1965). The valuation of risk assets and the selection of risky investments in stock portfolios and capital budgets. The Review of Economics and Statistics, 47(1), 13–37. https://doi.org/10.2307/1924119

Maharani, D. (2023). Pengaruh Nilai Perusahaan terhadap Return Saham pada Perusahaan Tambang Batubara Indeks SRI KEHATI. Jurnal Akuntansi dan Investasi, 23(3), 221–236.

Maramis, A., Norisanti, N., Komariah, K., & Sukabumi, U. M. (n.d.). Analisis Pengaruh Firm Size Dan Sales Growth Terhadap Return Saham Analysis Of The Influence Of Firm Size And Sales Growth On Stock Return.

Market Bisnis. (2021). *Dari Sri Kehati hingga ESG Quality 45 IDX, Kenali 4 Indeks Berbasis ESG Di Indonesia* .

Markowitz, H. M. (1991). American Finance Association Foundations of Portfolio Theory. In *Source: The Journal of Finance* (Vol. 46, Issue 2). http://www.jstor.orgURL:http://www.jstor.org/stable/2328831http://

www.jstor.org/stable/2328831?seq=1&cid=pdf-reference#references_tab_contents

Novy-Marx, R. (2013). The other side of value: The gross profitability premium. Journal of Financial Economics, 108(1), 1–28. https://doi.org/10.1016/j.jfineco.2013.01.003

Nugroho, A. F., & Safitri, W. (2023). Persepsi Investor terhadap Investasi Perusahaan Berkelanjutan di Indonesia. Jurnal Investasi dan Keuangan, 14(2), 99–113.

Nugroho, A. F., & Suherman, A. (2023). Preferensi Investor Institusional terhadap Saham Berbasis ESG di Indonesia. Jurnal Investasi dan Keuangan, 14(1), 65–80

Nurfadillah, R., & Wibowo, A. (2020). The effects of Fama-French five factor and momentum factor on Islamic stock portfolio excess returns. Jurnal Ekonomi & Keuangan Islam, 6(2), 145–160. https://journal.uii.ac.id/JEKI/article/view/15089

Pratama, R., Santoso, B., & Kurniawan, F. (2024). Pengaruh Price to Book Value terhadap Return Saham di Pasar Modal Indonesia. Jurnal Ekonomi dan Keuangan, 19(2), 191–205.

Priyatno, D. (2013). Mandiri belajar analisis data dengan SPSS. *Yogyakarta: Mediakom*.

Purnomo, A., & Setiawan, D. (2023). Kualitas Laba dan Preferensi Investor pada Saham Berkelanjutan. Jurnal Akuntansi dan Keuangan, 28(2), 133–147

Putra, A. A., et al. (2019). Pengaruh Investasi Berkelanjutan terhadap Return Saham di Indonesia. Jurnal Ekonomi dan Bisnis, 24(3), 145–160.

Putra, I. G. S., Susanti, N., & Putra, O. E. (2019). Pengujian Fama & French Five-Factors Asset Pricing Model Pada Indeks Lq 45 Periode 2014-2018. *BISMA: Jurnal Bisnis Dan Manajemen*, *13*(3), 148–157.

Rivan Kurniawan. (2020). *Evaluasi Indeks SRI-KEHATI oleh BEI, Emiten Mana saja yang Lolos ?*

SAL POJK 51 - keuangan berkelanjutan. (n.d.).

Saleh, A. (2020). Pengaruh Risiko Pasar terhadap Return Saham pada Indeks SRI KEHATI. Jurnal Ekonomi dan Keuangan Indonesia, 18(2), 101–115.

Saleh, M. (2020a). Empirical Testing of the Five-Factor Model of Fama and French in Indonesia as an Emerging Capital Market. *Journal of Economics and Business Saleh, Mustaruddin*, *3*(1), 19–28. https://doi.org/10.31014/aior.1992.03.01.175

Saleh, M. (2020b). Empirical Testing of the Five-Factor Model of Fama and French in Indonesia as an Emerging Capital Market. *Journal of Economics and Business*, *3*(1). https://doi.org/10.31014/aior.1992.03.01.175

Sari, N. P., & Wibowo, A. (2022). Analisis Model Lima Faktor Fama dan French pada Saham-Saham Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia. Jurnal Portofolio, 2(1), 1–15. https://journal.unjani.ac.id/index.php/portofolio/article/view/212

Savitri, E., & Pinem, M. (2022). Pengaruh Profitabilitas terhadap Return Saham pada Perusahaan Sektor Konsumsi di Indonesia. Jurnal Keuangan dan Perbankan, 26(3), 198–210.

Sharpe, W. F. (1964). Capital asset prices: A theory of market equilibrium under conditions of risk. The Journal of Finance, 19(3), 425–442. https://doi.org/10.2307/2977928

Sharpe, W. F. (1977). THE CAPITAL ASSET PRICING MODEL: A "Multi-Beta" Interpretation. In *Financial Dec Making Under Uncertainty* (pp. 127–135). Elsevier. https://doi.org/10.1016/b978-0-12-445850-5.50011-8

Sudiyatno, B. (2011). Menguji model tiga faktor fama dan french dalam mempengaruhi return saham studi pada saham lq45 di bursa efek indonesia. *Jurnal Bisnis Dan Ekonomi*, *18*(2).

Sugiyono, S. (2012). *Metode Penelitian Pendidikan Pendekatan Kuantitatif dan R & D Cetakan ke-14*. Bandung.

Sunariyah, S. (2022). Pengantar Pengetahuan Pasar Modal (Edisi 8). Yogyakarta: UPP STIM YKPN.

Suriyanti, & Hamzah Fyrdha Faradyba. (2024). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*.

Susilowati, E. M., & Nawangsasi, E. (2018). Pengaruh Current Ratio, Debt To Equity, Price Earning Ratio, Total Assets Turn Over Terhadap Return Saham LQ45. *ProBank*, *3*(2), 43–51.

Suteja, J., & Gunardi, A. (2016). Manajemen Investasi dan portofolio. *Bandung: Refika Aditama*.

Sutrisno, B., & Ekaputra, I. A. (2016). Uji Empiris Model Asset Pricing Lima Faktor Fama-French Di Indonesia. *Jurnal Keuangan Dan Perbankan*, *20*(3), 343–357.

Tandelilin, E. (2001). Beta pada pasar bullish dan bearish: studi empiris di Bursa Efek Jakarta. *Journal of Indonesian Economy and Business (JIEB)*, *16*(3).

Tandelilin, E. (2017). Pasar modal manajemen portofolio & investasi. *Yogyakarta: PT Kanisius*.

Thoraya, & Muyassaroh. (n.d.). Analisis Pengaruh Return On Assets, Debt To Equity Ratio Dan Corporate Social Resposibility Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Manufaktur Sektor Barang Komsumsi Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2016-2020. In *Jurnal Ekonomi dan Akuntansi* (Vol. 3, Issue 2).

Widodo, S., & Hermawan, A. (2023). Indikator Keberlanjutan dan Preferensi Investor pada Saham SRI KEHATI. Jurnal Sustainable Finance, 9(2), 115–129.

Widyastuti, S., & Priyadi, M. P. (2023). Preferensi Investor Institusional terhadap Aspek ESG di Pasar Modal Indonesia. Jurnal Manajemen dan Bisnis, 21(2), 140–153.

wijaya, C. S., Murhadi, R. W., & 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. In Ilmiah Mahasiswa Universitas Surabaya (Vol. 6, Issue 1).

Wijaya, S. C., Murhadi, W., & Utami, M. (2017). Analisis Fama French five factor model dan three factor model dalam menjelaskan return portofolio saham. *Roundtable for Indonesian Entrepreneurship Educators (RIEE)-5*.

Yuliyana, I., & Sembiring, R. (2021). Pengaruh Ukuran Perusahaan terhadap Return Saham di Pasar Modal Indonesia. Jurnal Akuntansi dan Keuangan, 16(2), 89–102.

Zulfikar, Z., & Si, M. (2016). Pengantar pasar modal dengan pendekatan statistika. *CV Budi Utama*.