

DAFTAR PUSTAKA

- M, Jogyanto, 2003, Teori Portofolio dan Analisis Investasi, Edisi Ketiga, BPFE-Yogyakarta
- Nurhayati, S., & Keuangan, M. (2017). Peranan Manajemen Keuangan Dalam Suatu Perusahaan. *Jbma*, <http://jurnal.amaypk.ac.id/index.php/jbma/article/view/56/58>
- Pasaribu, R.B.F., 2010, Pemilihan Model Asset Pricing, *Jurnal Akuntansi & Manajemen*.
- Pasaribu Bale Dedi, Maruddani dan Sugito , 2018, Pengukuran Kinerja Portofolio Optimal Capital Asset Pricing Model (Capm) Dan Arbitrage Pricing Theory (Apt)
- Premanto, G.C., dan Madyan, M., 2009, Perbandingan Keakuratan Capital Asset Pricing Model dan Arbitrage Pricing Theory Dalam Memprediksi Tingkat Pendapatan
- Sintyana, I. P. H., & Artini, L. G. S. (2018). Pengaruh Profitabilitas, Struktur Modal, Ukuran Perusahaan Dan Kebijakan Dividen Terhadap Nilai Perusahaan. *E-Jurnal Manajemen Universitas Udayana*, 8(2), 757. <https://doi.org/10.24843/ejmunud.2019.v08.i02.p07>
- Sugiyono. (2013). *Metode Penelitian Pendidikan Pendekatan Kuantitatif, Kualitatif dan R&D*. Bandung: ALFABETA
- Sugiyono. (2015). *Metode Penelitian Pendidikan Pendekatan Kuantitatif, Kualitatif dan R&D*. Bandung: ALFABETA
- Tandelilin, Eduardus. (2010). *Analisi Investasi dan Manajemen Keuangan Portofolio*, Yogyakarta : BPFE.
- Suharli, Michell. 2006. “Studi Empiris Terhadap Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi Nilai Perusahaan Pada Perusahaan Go Public Di Bursa Efek Indonesia”. *Jurnal Maksi*. Vol.6 No.1. Semarang: Universitas Diponegoro.
- Sharpe, W. 1964. Capital Asset Prices: A Theory of Capital Market Equilibrium Under Conditions of Risk. *Journal of Finance*, 19, 425-442

- Bodie, Z., A. Kane, dan A. J. Marcus. (2007). *Investment*, (7th Ed). New York: Mc Grow-Hill.
- N. Chen., Roll, R., Ross, S. (1986). *Economics Forces and The Stock Market*. Journal Of Business, 59, 383-403.
- Yohantin, Yesica, Penggunaan Metode CAPM Dalam Menilai Risiko Dan Return Saham Untuk Menentukan Pilihan Berinvestasi Pada Saham Jakarta Islamic Index Periode Januari 2004 Desember 2008 di Bursa Efek Indonesia, Skripsi, Universitas Gunadarma.
- Miles, Matthew B. and A. Michael Huberman. 2005. *Qualitative Data Analysis (terjemahan)*. Jakarta : UI Press.
- Miles,M.B, Huberman,A.M, dan Saldana,J. 2014. *Qualitative Data Analysis, A Methods Sourcebook*, Edition 3. USA: Sage Publications. Terjemahan Tjetjep Rohindi Rohidi, UI-Press.
- Fama, E. F. ; French, Kenneth R. 1998. Taxes, Financing Decision and Firm Value. *The Journal of Finance*, Vol. LIII, No. 3, June 1998.
- Canbas,S.,H.Duzakin,dan S. B. Kilic. 2000. *Fundamental and Macro economic Information for Common Stock Valuation: The Turkish Case*. Financial Analyst Journal Vol.12.
- Faisal, Andri. 2005. *Hubungan Antara Faktor Fundamental Perusahaan dan Indikator Makro dalam Penentuan Return Saham Pertambangan di BEJ*.Tesis Pasca Sarjana Ekonomi Universitas Indonesia.
- Chasanah. N. 2008. *Analisis Pengaruh Empowerment, Self Efficacy Dan Budaya Organisasi Terhadap Kepuasan Kerja Dalam Meningkatkan Kinerja Karyawan*. Tesis. Universitas Diponegoro Semarang.
- Fabozzi, Frank. J. (1995). *Manajemen Investasi*. Jakarta : Salemba Empat.
- Fahmi, Irham. Yovi Lavianti Hadi. (2009). *Teori Portofolio Dan Analisis Investasi*. Bandung : Alfabeta.
- Cooper, Donald R., Pamela, S. Schindler. (2006). *Business Research Methods* (9th Ed). New York: McGraw-Hill.
- Dwi, Yulianti. (2009). *Analisis Pengaruh Suku Bunga, Inflasi dan Nilai Tukar Terhadap Tingkat Pengembalian Saham Sektor Industri Barang Konsumsi*

- dan Sektor Properti dan Real Estat*. Jakarta: Skripsi Sarjana S1 Universitas Indonesia.
- Ervan, Kustanto. (2011). *Pengaruh Kurs Dollar, Inflasi dan Suku Bunga Terhadap Harga Saham di BEI (Studi Kasus Pada Perusahaan Banking)*. Surakarta: Skripsi Sarjana S1 Universitas Muhammadiyah Surakarta.
- Fifield, S. G. M. Power, D. M and Sinclair, C. D. (2002). *Macroeconomics Factor And Share Returns: An Analysis Using Emerging Data*. International Journal of Finance and Economics, 7, 51-62.
- Gujarati, Damodar N. (2003). *Basic Econometrics* (4th ed) Singapore: McGrawHill.
- Jogianto. (1998). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, BPF, Yogyakarta.
- Mankiw, N, Gregory. (2003). *Teori Makroekonomi* (Edisi 5). (Imam Nurmawah, penerjemah). Jakarta: Erlangga
- Cooper, Donald R., Pamela, S. Schindler. (2006). *Business Research Methods* (9th Ed). New York: McGraw-Hill.
- Dwi, Yulianti. (2009). *Analisis Pengaruh Suku Bunga, Inflasi dan Nilai Tukar Terhadap Tingkat Pengembalian Saham Sektor Industri Barang Konsumsi dan Sektor Properti dan Real Estat*. Jakarta: Skripsi Sarjana S1 Universitas Indonesia.
- Husnan, Suad. (2005). *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta, UPP AMP YKPN.
- Bhandari, L, 1988. "Debt/Equity Ratio and Expected Common Stock Returns: Empirical Evidence". *Journal of Finance*, 43: 507-528.
- Bilinski, P. and Lyssimachou, D, 2005. "Validiting the Fama and French Three Factor Model:The Case of the Sockholm Stock Exchange, 1982 – 2002". *Master Thesis*, Graduate Business School, Goteborg University.
- Black, Fischer, Michael, C. Jensen and Myron Scholes, 1972. "The Capital Asset Pricing Model: Some Empirical Tests, in M. Jensen ed., *Studies in the Theory of Capital Markets*, (Praeger, New York).
- Abdul, Aziz. (2010). Perhitungan keakuratan metode CAPM dan APT diukur dengan *Mean Absolute Deviation* (MAD).

- Ang, Robert. 2010. *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia*, Mediasoft Indonesia, Jakarta.
- Arikunto S. 2013. *Prosedur Penelitian Suatu Pendekatan Praktik*. Jakarta: Rineka Cipta
- Baridwan, Zaki. 2014. *Sistem Akuntansi Penyusunan dan Metode*. Edisi Kelima. Cetakan Kedelapan. BPFE. Yogyakarta
- Zubir, Z. (2013). *Managemen Portofolio: Penerapannya dalam Investasi Saham*. Jakarta: Penerbit Salemba Empat.
- Maftuhah, Helmiah.(2014).Perbandingan Model CAPM dan APT pada JII
- Widianita,Sulistiari.“Analisis Perbandingan Keakuratan Capital Asset Pricing Metode (CAPM) dan Arbitrage Pricing Theory (APT) Dalam Memprediksi *Return* Saham LQ-45 diBursa Efek Indonesia.”Skripsi S1 Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah Jakarta,2008.
- Yohantin, Yesica. “Penggunaan Metode CAPM dalam Menilai Risiko dan *Return* Saham untuk Menentukan Pilihan Berinvestasi pada Saham JII Periode Januari 2004 – Desember 2008. ”Skripsi S1 Jurusan Akuntansi, Fakultas Ekonomi,Universitas Gunadarma,2009.
- Azis,Musdalifah.“*Mean Absolute Deviation Capital Asset Pricing Model Dan Arbitrage Pricing Theory Terhadap Return Saham Industri Manufaktur.*”Jurnal Ilmiah Masagena Kopertis Wilayah IX Sulawesi, Vol. V Ed. 1 Januari2010.
- Dewi, Andam. *Capital Asset Pricing Metode dan Arbitrage Pricing Theory dalam Memprediksi Return Saham Kelompok Jakarta Islamic Index.*” Tesis Program Studi Manajemen Agribisnis Sekolah Pasca Sarjana Institut Pertanian Bogor 2006.

www.yahoofinance.com

www.bps.com

www.idx.com

www.bi.go.id