

## DAFTAR PUSTAKA

- Adista, D. (2017). Teori *Efficient Market Hypothesis (EMH)*.
- Agustya, M., & Faisal. (2018). Sentimen Investor dan Ekspektasi Pertumbuhan Laba Jangka Panjang Pada Industri Non Keuangan di Indonesia. *Jurnal Ilmiah Mahasiswa Ekonomi*.
- Anusakumar, S. V., & Ali, R. (2017). The Effect of Investor Sentiment on Stock Returns: Insight From Emerging Asian Markets. *Asian Academy of manaAgement Journal of Accounting* , 159–178.
- Arifin, A. Z. (2016). Pengaruh Sentimen Investor Terhadap Reaksi Pasar Pada Bursa Efek Indonesia.
- Ariyani, I., & Nafiah, Z. (2017). Pengaruh Volume Perdagangan, Kurs dan Risiko Pasar Terhadap Return Saham. *Jurnal Sti Semarang*.
- Ary, W. W. (2019). Sentimen Investor dan Three-Factor Asset Pricing Model. *Jurnal Manajemen dan Keuangan*, Vol.8 No.2.
- Bangun, N. (2020). Pengaruh interest rate, investor sentiment, financial distress terhadap stock return. *Jurnal Bina Akuntansi*, 80-186.
- Faisal, F. (2017). Pengaruh Non-Linear Sentimen Investor terhadap Return Pada Perusahaan Manufaktur di Bursa Efek Indonesia Tahun 2014-2015. *Jurnal Ilmiah Mahasiswa Ekonomi Manajemen*, 246-259.
- Fernandes, C. M. (2013). *Does Sentiment Matter for Stock Market Returns? Evidence from a Small European Market* . *Journal of Behavioral Finance* , 254-267.
- Fisher, K. L., & Statman , M. (2003). *Consumer Confidence and Stock Return*. *The Journal Of Portofolio Management*, 115-126.
- Hu Sheng, C. X. (2014). *An Empirical Study of the Effect of Investor Sentiment on Returns of Different Industries*. *Mathematical Problems in Engineering*.
- KANSA, F. (2017). *Definiton of Stock Reurn*.
- Karam Kim, D. R. (2019). Sentimen investor, return saham, dan rekomendasi analis perubahan: di Bursa Saham Korea. *Jurnal Analisis Investasi*.
- Kencana, A. P. (2019). Analisis Hubungan Antara Sentimen Investor dan Imbal Hasil Pasar Saham dengan Pendekatan Aliran Dana Reksa Dana dan Analisis Vector Autoregressive (VAR). *Jurnal Ilmiah Ekonomi Bisnis Volume 24*, 211-2013.
- Laura Brad, D. (2014). Sentimen Investor dan Pengembalian Saham: *Evidence from Rumania*. *Jurnal Internasional Penelitian Akademik dalam Ilmu Akuntansi, Keuangan dan Manajemen*, 19-25.

- Lee, P.-E. (2019). Studi Empiris Sentimen Investor pada Prediksi Return Saham. *Jurnal Internasional Ekonomi dan Keuangan*, 119-124.
- Nila Firdausi Nuzula, R. (2018). *Does Investor Sentiment Affect Large-Cap and Small-Cap Stock Return*. *Jurnal Administrasi Bisnis*.
- Phen, D. (2020). Analisis Pengaruh Faktor Makro Ekonomi Terhadap Return Saham pada Sektor Properti yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2014-2017. *Jurnal manajemen bisnis dan kewirausahaan* , 19-23.
- Pontoh, W. (2019). Pengembalian Saham, Risiko Pasar, dan Sentimen. *Jurnal Riset Akuntansi Going Concern*, 225-229.
- Prof. Dr. Ferdinand Dehoutman S, D. (2015). Pengaruh Sentiment Investor Terhadap Harga Saham Studi Pada Perusahaan Non Finansial Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2008-2015. *FISIP UI*.
- Puja Padhi, P. (2016). Sentimen Investor, Pengembalian Pasar Saham dan Volatilitas: Bukti dari Bursa Efek Nasional India. *Int. J. Praktek Manajemen*.
- Sahlin, A. (2017). Managerial Sentiment, Investor. *Philosophy in Finance*.
- Santoso, H., & Inoue, T. (2019). Bagaimana Kepercayaan Konsumen Memengaruhi *Wealth Effect* Pasar Perumahan dan Pasar Saham terhadap Konsumsi? Bukti Empiris dari Negara-Negara Asia) . *Directorate of Special Housing, Directorate General of Housing Provision, Indonesian Ministry of Public Works and Housing*, 100-108.
- Shangkari V. Anusakumar 1, R. A. (2017). *The Effect of Sentiment Investor on Stock Returns: Emerging Asians Market*. *AAMJAF*, Vol. 13, No. 1, 159–178.
- Y, A. (2016). *A Testing of Efficient Market Hypothesis in Indonesia Stock Exchange*.
- Yelamanchili, R. K. (2019). *Predicting Short-term Market Returns and Volatility Using Index of Consumer Sentiment* . *Accounting and Finance Research* , 72-85.

[www.idx.com](http://www.idx.com)

[www.finance.yahoo.com](http://www.finance.yahoo.com)

[www.bi.go.id](http://www.bi.go.id) ( diakses pada 15 Mei 2020 )