

DAFTAR PUSTAKA

- Acaravci, S. K., & Karaomer, Y. (2017). International Journal of Economics and Financial Issues Fama-French Five Factor Model: Evidence from Turkey *. *International Journal of Economics and Financial Issues*, 7(6), 130–137.
<http://www.econjournals.com>
- Adnyana, I. M. (2020). *Manajemen Investasi dan Portofolio* (Melati, Ed.).
- Dewi, A. O., & Komara, E. F. (2024). Investigate The Influence Of The Fama and French Five-Factor Model On The SRI-KEHATI Stock Index. *Jurnal Manajemen Bisnis*, 11(2), 1399–1412. <https://doi.org/10.33096/jmb.v11i2.776>
- 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>
- Gujarati, D. (2002). *Ekonometrika Dasar*. Erlangga .
- Hair, J. F., Hult, G. T. M., Ringle, C. M., Sarstedt, M., Danks, N. P., & Ray, S. (2021). *Partial Least Squares Structural Equation Modeling (PLS-SEM) Using R*. Springer Nature Switzerland AG.
- Huang, T. L. (2019). Is the Fama and French five-factor model robust in the Chinese stock market? *Asia Pacific Management Review*, 24(3), 278–289.
<https://doi.org/10.1016/j.apmr.v.2018.10.002>
- Jorion, P. (2007). *Value at Risk: The new Benchmark for Managing Financial Risk* (Third). The McGraw-Hill Companies, Inc.
- Manurung, H. (2019). Analisis Kinerja Portofolio Saham dengan Menggunakan Metode Sharpe, Jensen dan Treyno. *Journal of Business Studies*, 04.
<http://journal.uta45jakarta.ac.id/index.php/jbsuta>

- Maruddani, D. A. I. (2019). *Value at Risk untuk Pengukuran Risiko Investasi Saham Aplikasi dengan Program R (Pertama)*. WADE GROUP.
- Nugraha, F., Nurmatitas, & Wahyudi. (2022). *Analisis Fama French 5 Factors Model Dalam Mempengaruhi Excess Return Saham Pada Lq45*.
- Nurlaeli, S., & Artati, D. (2020). Analisis Kinerja Portofolio Saham dengan Metode Sharpe, Treynor, dan Jensen (Saham IDX30 Tahun 2015 sampai 2019). In *Jurnal Ilmiah Mahasiswa Manajemen* (Vol. 2, Issue 6). <http://journal.stieputrabangsa.ac.id/index.php/jimmba/index>
- Pracanda, D. G. S. P., & Abundati, N. (2017). *Pembentukan Portofolio Optimal dengan Menggunakan Model Markowitz pada Saham Indeks IDX30 di Bursa Efek Indonesia*. 6(2), 802–829. www.sahamok.com
- Putri, L. D., Riaman, & Sukono. (2025). Analysis of the French Five Factors Fama Model on Excess Return of Stocks Listed on IDXBUMN20 for the Period 2020-2023. *International Journal of Quantitative Research and Modeling*, 6(2), 162–170.
- Rahmah, M., & Sulistianingsih, E. (2025). Pembentukan Portofolio Optimal dengan Metode Markowitz dan Mean Variance Efficient Portfolio (MVEP). In *Buletin Ilmiah Math. Stat. dan Terapannya (Bimaster)* (Vol. 14, Issue 4).
- Sitanggang, R. P., & Sinaga, L. P. (2023). Analisis Optimisasi Program Kuadratik Dengan Fungsi Penalty. *Jurnal Riset Rumpun Ilmu Pendidikan (JURRIPEN)*, 2(1), 32–42.
- Sriningsih, M., Hatidja, D., & Prang, J. D. (2018). *Penanganan Multikolinearitas dengan Menggunakan Analisis Regresi Komponen Utama pada Kasus Impor*

<https://doi.org/https://doi.org/10.35799/jis.18.1.2018.19396>

Sutedja, M. D. S., & Wijaya, L. I. (2022). Does Including Momentum Factor Into Fama-French Five-Factor Model Predict Better Return In Indonesia? *Syntax Literate ; Jurnal Ilmiah Indonesia*, 7(2), 852. <https://doi.org/10.36418/syntax-literate.v7i2.6326>

Sutrisno, B., & Ekaputra, I. A. (2016). *Uji Empiris Model Asset Pricing Lima Faktor Fama-French di Indonesia* (Vol. 20, Issue 3). <http://jurnal.unmer.ac.id/index.php/jkdp>

Tandelilin, E. (2010). *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi* (Pertama). PENRRBIT KANISIUS (Anggota IKPI).

Tarno, & Ispriyanti, D. (2010). *Buku Ajar Analisis Regresi*. UNDIP PRESS SEMARANG.

Wijaya, S. C., Murhadi, 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. In *Ilmiah Mahasiswa Universitas Surabaya* (Vol. 6, Issue 1). <https://journal.ubaya.ac.id/index.php/jimus/article/view/3387>

Yuliyana, D. I., & Sembiring, M. 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).