

## DAFTAR PUSTAKA

- Adityo dan Erman Denny. 2012. *Analisis Pengaruh Corporate Social Responsibility, Beta, Firm Size, dan Book to Market Ratio Terhadap Return Saham (Studi Kasus Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bei Periode 2010-2011)*. Undergraduate Thesis, Fakultas Ekonomika Dan Bisnis, Universitas Diponegoro.
- Ang, Robert, 1997, Buku Pintar: Pasar Modal Indonesia. Jakarta: Erlangga.
- Asnawi, Said K. dan Chandra Wijaya. 2005. *Riset Manajemen Keuangan*. Jakarta: Gramedia.
- Baker, M., Bradley, B., dan Wurgel. 2011. "Benchmarks As Limits To Arbitrage: Understanding The Low-Volatility Anomaly". *Financial Analysis Journal* 67. 1-15.
- Frazzini, A. dan Pedersen L. 2014. "betting against beta". *Journal of Financial Economics* 111. 1-25.
- Bodie, K., Kane, A. dan A. J. Marcus. 2014. *Manajemen portofolio dan Investasi*. Jakarta: Salemba Empat.
- Black, Fischer. 1972. "Capital Market Equilibrium with restricted Borrowing". *Journal of Business* 45, 444-455.
- Blitz, D., dan Van Vliet. 2007. "The Volatility Effect: Lower Risk Without Lower Return". *Journal of portofolio Management*. 102-113.
- Fama dan French. 1993. "Common Risk Factor In The Return On Stock And Bonds". *Journal of Financial Economics* 33, 3-56.
- Fahmi, Irham dan Y. Lavianti Hadi. 2011. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Bandung: Alfabeta.
- Fitriati, Ika Rosyada dan Prasetiono. 2010. *Analisis Hubungan Distress Risk, Firm Size, dan Book to Market Ratio dengan Return Saham pada Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode Tahun 2005 – 2008*. Undergraduate Thesis, Universitas Diponegoro.
- Ghozali, Imam. 2006. *Aplikasi Analisis Multivariate dengan program SPSS*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.

- Ghozali, Imam. 2007. *Manajemen Risiko Perbankan*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Horne, James C. Van dan John M. Wachowicz, JR. 2012. *Prinsip-prinsip Manajemen Keuangan*. Edisi 12 Buku 1. Jakarta: Salemba Empat.
- Indonesian Capital Market Directory (ICMD)*.
- Jogiyanto. 2003. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Ketiga. Yogyakarta: BPFE.
- Novy-Marx, Robert. 2014. "Understanding Defensive Equity". *NBER Working Paper No. 20591*.
- Riyanto, Bambang. 1995. *Dasar-dasar Pembelanjaan Perusahaan*. Edisi Keempat. Yogyakarta: BPFE.
- Sartono, Agus, R. 1994. *Manajemen Keuangan*. Yogyakarta: BPFE-Yogyakarta.
- Sekaran, Uma. 2000. *Metode Penelitian Untuk Bisnis*. Edisi Keempat. Jakarta: Salemba Empat.
- Sharpe, William. 1964. "Capital Asset Prices: A Theory of Market Equilibrium". *Journal of Finance*.
- Sinaga, Benni. 2009. *Kitab suci pemain saham*. Jakarta Selatan: Dua Jari Terangkat.
- Sjahrial, Dermawan. 2007. *Pengantar Manajemen Keuangan*. Jakarta: Mitra Wacana Media.
- Tacana, Stella dan Erman Denny. 2014. *Analisis Pengaruh Trade, Momentum, Firm dan Market Characteristics Factors Terhadap Return Saham (Studi pada Perusahaan Manufaktur yang Listing di Bursa Efek Indonesia Periode 2009 Hingga 2012)*. Undergraduate Thesis, Fakultas Ekonomika Dan Bisnis, Universitas Diponegoro.
- Tandelilin, Eduardus. 2001. *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Edisi Pertama. Yogyakarta: BPFE Yogyakarta.
- Tandelilin, Eduardus. 2010. *Portofolio Dan Investasi Teori Dan Aplikasi*. Edisi Pertama. Yogyakarta: Kanisius.

Trisnadewi, Mariana dan Erman Denny. 2012. *Analisis Pengaruh Risiko Pasar, Size, Book to Market, dan Momentum Terhadap Keputusan Investor di Bursa Efek Indonesia (Studi Kasus pada Perusahaan Non Perbankan yang Termasuk dalam Indeks LQ 45 Periode 2007-2010)*. Undergraduate Thesis, Fakultas Ekonomika Dan Bisnis, Universitas Diponegoro.

