

## DAFTAR PUSTAKA

- [1] E. Tandelilin, “Dasar-dasar Manajemen Investasi,” *Manajemen Investasi*, vol. 34, 2010.
- [2] R. Rifqiawan, “Analisis Rasionalitas Investor dalam Pemilihan dan Penentuan Portofolio Optimal pada Saham-Saham Jakarta Islamic Index,” *Economica*, vol. II, Nov. 2012.
- [3] R. Paramitasari and Mulyono, “Analisis Portofolio Untuk Menentukan Expected Return Optimal dan Risiko Minimal pada Saham Perusahaan Telekomunikasi yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia,” *Manajemen dan Organisasi*, vol. VI, no. 1, Apr. 2015.
- [4] E. F. Komara and E. E. Sumiyati, “Pengujian Validitas Empiris Capital Asset Pricing Model (CAPM) Di Jakarta Islamic Indeks (JII) Periode 2011-2014,” *Jurnal Ekonomi Manajemen & Akuntansi*, vol. 13, no. 2, pp. 158–172, 2016.
- [5] E. F. Fama and K. R. French, “The Cross-Section of Expected Stock Returns,” *J Finance*, vol. 47, no. 2, pp. 427–465, 1992.
- [6] E. F. Fama and K. R. French, “A Five-Factor Asset Pricing Model,” *J financ econ*, vol. 116, no. 1, pp. 1–22, Apr. 2015, doi: 10.1016/j.jfineco.2014.10.010.
- [7] S. Murdiana, “Pengujian Fama-French Five Factor Model terhadap Excess Return pada Saham yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2012-2018,” Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah, Jakarta, 2020.
- [8] R. Widiyanto, “Pengaruh Five Factor Model Fama and French Terhadap Expected Return Saham yang Terdaftar di ISSI pada Tahun 2012-2016,” Skripsi, Universitas Islam Negeri Sunan Kalijaga, Yogyakarta, 2018.
- [9] Bursa Efek Indonesia, “Laporan Keuangan dan Tahunan,” [idx.co.id](http://idx.co.id). Accessed: Dec. 02, 2023. [Online]. Available: <https://www.idx.co.id/id/perusahaan-tercatat/laporan-keuangan-dan-tahunan>
- [10] Investing.com, “Quotes Saham,” Investing.com. Accessed: Dec. 03, 2023. [Online]. Available: <https://id.investing.com/equities>

- [11] J. Manurung and A. H. Manurung, *Ekonomi Keuangan dan Kebijakan Moneter*. Jakarta: Salemba Empat, 2009.
- [12] Halilurohman and S. Sitohang, “Analisis Portofolio Model Indeks Tunggal Optimalisasi Saham pada Perusahaan Advertising, Printing dan Media,” *Jurnal Ilmu dan Riset Manajemen*, vol. 5, Aug. 2016.
- [13] E. Fitriani Komara, E. Febrian, and M. Anwar, “Analisis Three Factor Fama and French Model terhadap Return pada Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI) Periode 2011-2014,” *Jurnal Inspirasi Bisnis dan Manajemen*, vol. 3, no. 2, pp. 105–116, 2019, [Online]. Available: <http://jurnal.unswagati.ac.id/index.php/jibm>
- [14] I. M. Adnyana, *Manajemen Investasi dan Portofolio*. Jakarta: Lembaga Penerbitan Universitas Nasional, 2020.
- [15] M. Habibi, *Hukum Pasar Modal Indonesia: Perkembangan Hukum Pasar Modal Era Kolonial hingga Era Digital*, 1st ed. Malang: Inara Publisher, 2022.
- [16] A. Widarjono, *Analisis Statistika Multivariat Terapan*. Yogyakarta: Unit Penerbitan dan Percetakan STIM YKPN, 2010.
- [17] A. Telussa, E. Persulesy, and Z. Leleury, “Penerapan Analisis Korelasi Parsial untuk Menentukan Hubungan Pelaksanaan Fungsi Manajemen Kepegawaian dengan Efektivitas Kerja Pegawai,” *Jurnal Barekeng*, vol. 7, pp. 15–18, 2013.
- [18] Sihabudin *et al.*, *Ekonometrika Dasar: Teori dan Praktik Berbasis SPSS*. Banyumas: Pena Persada, 2021.
- [19] D. Gujarati, *Dasar-Dasar Ekonometrika*, Edisi 3. Jakarta: Erlangga, 2006.
- [20] R. K. Sembiring, *Analisis Regresi*. Bandung: ITB, 1995.
- [21] R. E. Walpole, *Pengantar statistika*, Edisi 3. Jakarta: Gramedia Pustaka Utama, 1995.
- [22] I. Ghozali, *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS 25*, 9th ed. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro, 2018.
- [23] M. Abdi, Wiralestari, E. Casmi, and Y. Andriati, *Manajemen Keuangan Perusahaan*. Yogyakarta: PT Penamuda Media, 2023.

- [24] J. Hartono, *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, 10th ed. Yogyakarta: BPFE, 2014.
- [25] E. F. Fama and K. R. French, “Size and Book-to-Market Factors in Earnings and Returns,” *J Finance*, vol. 50, no. 1, pp. 131–155, 1995, doi: 10.1111/j.1540-6261.1995.tb05169.x.
- [26] B. Sutrisno and I. A. Ekaputra, “Uji Empiris Model Asset Pricing Lima Faktor Fama-French di Indonesia,” *Jurnal Keuangan dan Perbankan*, vol. 20, no. 3, 2016.
- [27] M. M. Hanafi and A. Halim, *Analisis Laporan Keuangan*, 4th ed. Yogyakarta: UPP STIM YKPN, 2009.
- [28] A. Aziz, *Ekonometrika: Teori & Praktik Eksperimen dengan MATLAB*. Malang: UIN-Maliki Press, 2010.
- [29] M. Hallin, “Gauss–Markov Theorem in Statistics,” *Encyclopedia of Environmetrics*, Sep. 2012, doi: 10.1002/9781118445112.stat07536.