

## DAFTAR KEPUSTAKAAN

- Adiwiratama, J. (2012). Pengaruh Informasi Laba, Arus Kas dan Size Perusahaan Terhadap Return Saham (Studi Empiris Pada Perusahaan Manufaktur Yang Terdaftar di BEI). *Jurnal Ilmiah Akuntansi dan Humanika (JINAH) Volume 2 Nomor 1, 2, 25*.
- Aisah, A. N., & Mandala, K. (2016). Pengaruh Return On Equity, Earning per Share, Firm Size dan Operating Cash Flow Terhadap Return Saham. *E-Jurnal Manajemen Unud, Vol.5, No.11, 6907-6936*.
- Akbar, R., & Herianingrum, S. (2015). Pengaruh Price Earning Ratio (PER), Price Book Value (PBV), dan Debt to Equity Ratio (DER) Terhadap Return Saham (Studi terhadap Perusahaan Properti dan Real Estate yang Listing di Indeks Saham Syariah Indonesia). *JESTT, Vol.2 No.9, 1-16*.
- Andansari, N. A., Raharjo, K., & Andini, R. (2016). Pengaruh Return On Equity (ROE), Price Earning Ratio (PER), Total Asset Turn Over (TATO) dan Price to Book Value (PBV) Terhadap Return Saham. *Journal of Accounting, 1-11*.
- Arslan, M. (2014). Impact of Dividend Yield and Price Earnings Ratio on Stock Returns : A Study Non-Financial listed Firms of Pakistan. *Research Journal of Finance and Accounting, 5(19), 68-75*.
- Astuti, P., Sari, Y. L., & WA, A. R. (2018). Analisis Pengaruh Return On Equity, Earning Per Share, Price To Book Value, Book Value. *Jurnal Ekonomi, Volume 20 Nomor 2, 14*.
- Atidhira, A. T., & Yustina, A. I. (2017). The Influence of Return on Asset, Debt to Equity Ratio, Earnings per Share, and Company Size on Share Return in Property and Real Estate Companies. *JAAF (Journal of Applied Accounting and Finance), 1(2), 128-146*. Retrieved from <http://www.bi.go.id>
- Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. J. (2011). *Investments 10th*. New York: McGraw-Hill Education, 2 Penn Plaza.

- Chui, A. C. W., Titman, S., & Wei, K. C. J. (2010). *Individualism and Momentum around the World. The Journal of Finance, 65(1), 361–392.* doi:10.1111/j.1540-6261.2009.01532.x
- Choe, H., Kho, B-C., & Stulz, R. M. (2005). Do domestic investors have an edge? The trading experience of foreign investors in Korea. *Review of Financial Studies, 18, 795–829.*
- Djamaluddin, S., & Marsoem, B. (2018). The Effect of the Fundamental Factors Against Price to Book Value on Building Construction Sub-Sector Companies in Indonesia Stock Exchange Period 2012-2016. *International Journal of Innovative Research & Development, 7(11), 149–156.*
- Damayanti. (2009). Pengaruh Rasio Keuangan Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Manufaktur Yang Tergabung Dalam Indeks LQ 45 Di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Ilmiah Manajemen Potensio, Volume 11, No.1.*
- Fama, E. F., & French, K. R. (2012). Size, value, and momentum in international stock returns. *Journal of Financial Economics 105, 457-472.*
- FarkhandanIka. (2012). Pengaruh Rasio Keuangan Terhadap Return Saham Perusahaan Manufaktur di BEI (Studi Kasus pada Perusahaan Manufaktur Sektor Food and Beverage) .*Jurnal Value Added, Vol. 9, No. 1.*
- Fun, L. P., & Basana, S. R. (2002). Price Earnings Ratio and Stock Return Analysis ( Evidence from Liquidity 45 Stocks Listed in Indonesia Stock Exchange).*Jurnal Manajemen dan Kewirausahaan, Vol.14 (1), 7–12.*
- Gallizo, J. L., & Salvador, M. (2003). Understanding the behavior of financial ratios: The adjustment process. *Journal of Economics and Business, 55(3), 267–283.* [https://doi.org/10.1016/S0148-6195\(03\)00022-5](https://doi.org/10.1016/S0148-6195(03)00022-5)
- Hakim, M. Z., & Abbas, D. S. (2019). Pengaruh Price Earning Ratio, Earning Per Share, Return On Equity, Debt To Equity Ratio dan Net Profit Margin Terhadap Return Saham (Pada Sektor Property and Real Estate Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2013-2017). *Competitive Jurnal Akuntansi dan Keuangan 2, Volume 3 No.1, 1-20.*

- Hartanti, W., Hermuningsih, S., & Mumpuni, D. L. (2019). Pengaruh Earning Per Share Dan Debt To Equity Ratio Terhadap Return Saham Dengan Kebijakan Deviden Sebagai Intervening Pada Perusahaan Property & Real Estate Yang Terdaftar Di Bei Periode 2013-2017. *Jurnal Sains Manajemen Dan Bisnis Indonesia*, 9, 11.
- Haruman, T., Setiawan, Stevanus Adree Cipto; & Ariyanti, Maya (2005). "Pengaruh Faktor Fundamental dan Risiko Sistematis terhadap Tingkat Pengembalian Saham BEJ. *Manajemen Usahawan Indonesia*, No. 11, 26-37.
- Husnan, S. (2010). *Dasar-dasar teori portofolio dan analisis sekuritas*. Yogyakarta : UPP STIM YKPN.
- Hutajulu, A. T., & Puspitasari, E. (2019). Analisis Pengaruh CAPM Beta, Firm Size, Book to Market Ratio dan Momentum Terhadap Return Saham. *Journal Accounting and Finance Edisi Vol.3 No.2*.
- Jegadeesh, N., & Titman, S. (1993). Returns to Buying Winners and Selling Losers : Implications for stock market efficiency. *The Journal of Finance*, Vol.48, No.1.
- Jogiyanto, H. M. (2003). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFE .
- John Y. Campbell, P. (2004). *Understanding Momentum*. Managing Partner, Arrowstreet Capital, L.P. and Otto Eckstein Professor of Applied Economics, Harvard University.
- Kartikasari, D., & Merianti, M. (2016). The Effect of Leverage and Firm Size to Profitability of Public Manufacturing Companies in Indonesia. *International Journal of Economics and Financial Issues*, 409-413.
- Kosasi, A. (2017). Analisis Pengaruh Book to Market Equity, Firm Size, Market Value Added (MVA), Momentum, dan Trading Volume Terhadap Return Saham (Studi Kasus Perusahaan Yang terdaftar dalam Indeks LQ-45 Periode 2012 s/d 2016). *Diponegoro Journal of Management*, Vol.6 (4), 1-12.
- Latan, H., & Temalagi, S. (2013). *Analisis multivariate teknik dan aplikasi menggunakan program IBM SPSS 20.0*. Bandung: Alfabeta.

- M.Griffin, J., & Xiuqing Ji, a. J. (2005). Global Momentum Strategies. *The Journal of Portfolio Management, Volume 31, No.2*, 23-39.
- Medyawati, H., & Yunanto, M. (2017). Factors determining stock returns in property, real estate and construction companies in Indonesia. *Int.J.Globalisasi and Small Business, Volume 9 , No.1*, 1-17.
- Najmiah, Sujana, E., & Sinarwati, N. K. (2014). Pengaruh Price to Book Value (PBV), Price Earning Ratio (PER) dan Debt to Equity Ratio (DER) Terhadap Return Saham Pada Industri Real Estate dan Property Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2009-2013. *e-Journal SI-Ak Universitas Pendidikan Ganesha, Volume : 2 , No.1*, 1-12.
- Nartea, G. V, Ward, B. D., & Djajadikerta, H. G. (2009). *Size , BM , and momentum effects and the robustness of the Fama-French three-factor model Evidence from New Zealand. 5(2)*, 179–200.
- Nisa, A., & Khairunnisa. (2019). Analisis Pengaruh Price to Book Value, Current Ratio, Tingkat Suku Bunga dan Ukuran Perusahaan Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Yang Terdaftar Di Indeks Kompas 100 Periode 2012-2016. *JIM UPB Vol.7 No.2*, 10-17.
- Ngurah, I. G., Rudangga, G., & Sudiarta, G. M. (2016). Profitabilitas Terhadap Nilai Perusahaan Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Udayana (Unud). *E-Jurnal Manajemen, Bali , Indonesia 5(7)*, 4394–4422.
- Novitasari, Ryan. (2013). Analisis Pengaruh Faktor Fundamental terhadap Return Saham (pada Perusahaan LQ 45 yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia tahun 2009-2012). *Jurnal Fakultas Ekonomi Universitas Diponegoro*, 13(2): h: 54-59.
- Penman, S. H., Richardson, S. A., & Tuna, I. (2006). The Book-to-Price Effect in Stock Returns: Accounting for Leverage. 64.
- Puspitadewi, C. I., & Rahyuda, H. (2016). Pengaruh DER, ROA, PER dan EVA Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Food and Beverage di BEI. *E-Jurnal Manajemen Unud, Vol 5, No.3*, 1429-1456.



- Puspitasari, P. D., Herawati, N. T., Luh, N., & Erni, G. (2017). Pengaruh Ukuran Perusahaan, *Total Asset Turnover*, *Return On Asset*, *Current Ratio*, *Debt To Equity Ratio*, Dan *Earning Per Share* Terhadap Return Saham Syariah Pada Perusahaan Perdagangan, Jasa, Dan Investasi Yang Terdaftar Di Indonesia Sharia Stock Index (ISSI) Periode 2012-2015 *e-Journal SI Ak Universitas Pendidikan Ganesha*. 1(1).
- Saftiana, Y. (2019). *Corporate Governance Quality, Firm Size and Earnings Management: Empirical study in Indonesia Stock Exchange*. [https://doi.org/10.21511/imfi.14\(4\).2017.10](https://doi.org/10.21511/imfi.14(4).2017.10)
- Sari, E. I., Safitri, E., & Ekawati, R. K. (2011). Pengaruh Faktor-faktor Fundamentak Terhadap Harga Saham PT Unilever Indonesia Tbk. *Jurnal Manajemen STIE MDP*, 1-7.
- Setianto, B. (2018). *573 Profile Usaha Emiten di BEI Tahun 2018*. BSK Capital.
- Simanjuntak, S. W., Sipayung, H., Sinaga, A. N., Permana, J., & Hutahaen, T. F. (2019). Pengaruh Struktur Modal, Net Profit Margin (NPM), Current Ratio (CR), dan Price Earning Ratio (PER) Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Manufaktur Sektor Industri Barang Konsumsi Yang Konsumsi Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2014-2017. *Jurnal Akrab Juara, Volume 4 Nomor 2 Edisi Mei*, 38-54.
- Situmeang, S. (2015). Analisis Pengaruh Volalitas Harga, Likuiditas Saham, EPS, Size Firm, Momentum Terhadap Return Saham (Studi Kasus perusahaan yang terdaftar dalam Indeks LQ45 Periode 2009-2013). *Diponegoro of Journal Management, Vol.4(3)*,1-12.
- Sugiyono. (2008). *Metode penelitian pendidikan:(pendekatan kuantitatif, kualitatif dan R & D)*. Bandung: Alfabeta.
- Sun, L. (2012). Information Content of PE Ratio, Price-to-book Ratio and Firm Size in Predicting Equity Returns. *International Conference on Innovation and Information Management, Vol.36*, 1-6.

- Tandelilin, E. (2001). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Yogyakarta: Yogyakarta: BPFE.
- Tandelilin, E. (2010). *Portofolio dan Investasi: Teori dan aplikasi*. Yogyakarta: Kanisius.
- Tandelilin, E. (2012). *Dasar-dasar Manajemen Investasi*. Universitas Terbuka.
- Usman, Ahmadi. (2013). Pengaruh NPM, PER, EPS dan Inflasi Terhadap Return Saham Pada Perusahaan BUMN Go Public. *Jurnal Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Hasanuddin, Makassar*, 1(11), pp: 67-92.
- Usman, Yulianty. (2004). "Analsis Pengaruh EVA, MVA, dan Kinerja Keuangan Konversiona lterhadap Return Saham di Bursa Efek Jakarta". *Jurnal Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Brawijaya Malang*, Vol. 1 No .1
- Wardani, I. K., Wardiningsih, S. S., & Utami, S. S. (2016). Pengaruh Debt To Equity Ratio, Inventory Turnover, Total Assets Turnover dan Firm Size Terhadap Profitabilitas Pada Perusahaan Real Estate dan Property Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Ekonomi dan Kewirausahaan*, Volume 16, No.1, 1-8.
- Wenjing, H. (2006). Price Earning Ratio and Influence Factors : Evidence from china. *Journal Faculty of Business Studies Departmen of Accounting and Finance*, 78.
- Yanti, M., & Salim, U. (2011). Determinan Price Earning Ratio dan Stock Return ( Studi pada Saham-Saham Syariah di Bursa Efek Indonesia ). *Jurnal Aplikasi Management Universitas Brawijaya*, Vol.10 (2), 66.