

DAFTAR PUSTAKA

- Anoraga, Pandji., dan Pakarti, Piji. (2008). *Pengantar Pasar Modal*. Jakarta: Rineka Cipta
- Arikunto S, (2006). *Prosedur Penelitian Suatu Pendekatan Praktik*. Jakarta: PT Rineka Cipta
- Black,F., Jensen, M.C., and Scholes, M.,(1972).*The Capital Asset Pricing Model Some Empirical Tests*.Injensen (ed) *Studies in the Theory of Capital Markets*.New York:Prager
- Black, Fischer. (1998). *Beta and Return*. New York: Goldman, Sachs & Co. in
- Fabozzi, Frank., Modigliani, F., and Ferri, M., (1994). *Pasar dan Lembaga Keuangan*. Jakarta: Salemba Empat
- Fahmi, Irham., dan Lavianti, Y., (2011). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi Teori dan Soal Jawab*. Bandung: Alfabeta
- FPEB. (2013). *Pedoman Operasional Penulisan Skripsi*. Bandung: Prodi Pendidikan Akuntansi Fakultas Pendidikan Ekonomi dan Bisnis Universitas Pendidikan Indonesia
- Hadi, A., Haratik., dan Pramesti,G., (2012). *Aplikasi SPSS dalam Saham*. Jakarta: Gramedia
- Haming, Murfidin. (2010). *Studi Kelayakan Investasi:Poryek & Bisnis*. Jakarta: Bumi Aksara
- Hartono, Jogiyanto. (2012). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFE-Yogyakarta
- Harianto, F dan Sudomo, S. (2001). *Perangkat dan Teknik Analisis Investasi di Pasar Modal Indonesia*. Jakarta: Bursa Efek Jakarta.
- Hogin, Robert L. (2004). *Investment Manajerial*. New Jersey: John Wiley & Sons
- Husnan, S. (2001). *Dasar-dasar Teori Portifolio dan Analisis Sekuritas*. Edisi Ketiga. Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan AMP YKPN.
- Husnan, Suad., dan Pudjiastuti, Enny. (2006). *Dasar-dasar Manajemen Keuangan*. Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan Sekolah Tinggi Ilmu Manajemen YKPN

- Husnan, Suad. (2009). *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan Sekolah Tinggi Ilmu Manajemen YKPN
- Jones, Charles P. (2000). *Investment Analysis and Management*. John Wiley & Sons, Inc: United States of America
- Keown, A.J.et all. (2008). *Manajemen Keuangan*. Edisi kesepuluh. Cetakan Pertama. PT. Macanan Jaya Cemerlang.
- Martalena dan Malinda, M. (2011). *Pengantar Pasar Modal*. Yogyakarta: Andi.
- Tandelilin, Eduardus. (2010). *Portofolio dan Investasi*. Yogyakarta: Penerbit Kanisius
- Rusdin. (2008). *Pasar Modal Teori, Masalah, dan Kebijakan dalam Praktik*. Bandung: Alfabeta
- Samsul, Mohamad. (2006). *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Penerbit Erlangga
- Sartono, Agus. (2008). *Manajemen Keuangan Teori dan Aplikasi*. Yogyakarta: BPFE-Yogyakarta
- Sudjana. (2000). *Statistika Untuk Ekonomi dan Niaga 1*. Bandung: Penerbit Tarsito
- _____. (2003). *Teknik Analisis Regresi Dan Korelasi*. Bandung: Tarsito
- _____. (2004). *Statistika Untuk Ekonomi dan Niaga*. Bandung: Tarsito
- Sugiyono. (2011). *Metode Penelitian Kombinasi (Mixed Methods)*. Bandung: Alfabeta.
- _____. (2013). *Metode Penelitian Pendidikan (Pendekatan Kuantitatif, kualitatif dan R&D)*. Bandung : Alfabeta.
- Sunariyah. (2003). *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*. Yogyakarta: UPP AMP YKPM.
- Widoatmodjo, Sawidji. (2009). *Pasar Modal Indonesia: Pengandar dan Studi Kasus*. Bogor: Penerbit Ghalia Indonesia
- Waspada,I. (2010). *Pengetahuan Pasar Modal dan Portofolio*. Bandung: Laboratorium Pendidikan Ekonomi dan Koperasi.

Zubir, Zalmi. (2011). *Manajemen Portofolio: Penerapannya dalam Investasi*. Jakarta: Salemba Empat

Jurnal dan Penelitian Terdahulu:

Amaroh, Siti. (2009). "*Intemporal Capital Assets Pricing Model Sebagai Preditor Return Portofolio Saham*", *Aset*, September 2009, hal. 159-169. Vol. 11 No.2

Evans, Martin D. D. (1994). "*Expected Returns, Time-varying Risk, and Risk Premia*", *The Journal of Finance*. Vol. XLIX. No. 2

Galadera, Don U.A. (2007). "*A review of capital asset pricing models*", *Managerial Finance*. Vol. 33 No. 10, 2007 pp.821-832

Basu, D. Chawla, D. (2008). "*An Empirical Test of CAPM – The Case of Indian Stock Market*", *Global Business Review*, 11:2 (2010); 209-220

Brawijaya, Universitas. (2002). "*Analisis Risiko Sistematis dan Risiko Tidak Sistematis Terhadap Expected Return Saham Dalam Pembentukan Portofolio Optimal Di Bursa Efek Jakarta*", *Jurnal Penelitian Ilmu-ilmu Sosial Program Pascasarjana Universitas Brawijaya Malang*. Vol. 1 No 1. Januari 2002

Labubscher, ER. (2002). "*A review of the theory of and evidence on the use of the capital asset pricing model to estimate expected share returns*", *Meditari Accountancy Research*. Vol. 10 2002 : 131-146

Lewellen, Jonathan. (1999). "*The Time-series relation among expected return, risk, and book-to Market*", *Journal of financial Economics* 54 (1999) 5-43

Maharani, Silcia. (2008). *Pengaruh risiko sistematis dan risiko tidak sistematis terhadap expected return dengan menggunakan single indek model pada perusahaan food & beverages*. Tesis Magister. Tidak dipublikasikan. Semarang: Universitas Diponegoro.

Markowitz, Harry. (1952). *Portofolio Selection*, *Journal of Finance*. March 1952

- Poon, S; S.J. Taylor; dan C.W.R. Ward. (1992). *Portfolio Diversification: A Pictorial Analysis of The UK Stock Market*. Journal of Business Finance & Accounting. Vol. 19 No. 1: 87-101.
- Pramitasari, Ratih. (2011). *Pengaruh Risiko Sistematis dan Risiko Tidak Sistematis Terhadap Return ekspektasian Portofolio Saham Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia*. Tesis Magister. Tidak dipublikasikan. Surakarta: Universitas Sebelas Maret.
- Sunariyah. (2011). *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*. Edisi keenam. Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan STIM YKPN.
- Utomo, Welly. (2007). *Analisis Pengaruh Beta dan Varian Return Saham Terhadap Return Saham: Studi Pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Jakarta Bulan Januari Tahun 2005 Sampai Dengan Bulan Desember Tahun 2005*. Tesis Magister. Tidak dipublikasikan. Semarang: Universitas Diponegoro.
- Zhang, J., And Wihlborg, C. (2010). "CAPM in Up and Down Market: Evidence from Six European Emerging Markets", *Journal of Emerging Market Finance*. 9:2 (2010) 229-255

Sumber internet:

www.idx.co.id

www.bi.go.id