

## DAFTAR PUSTAKA

- Aziz, Musdalifah. “*Mean Absolute Deviation Capital Asset Pricing Model Dan Arbitrage Pricing Theory Terhadap Return Saham Industri Manufaktur*”. Jurnal Ilmiah Masagena Kopertis Wilayah IX Sulawesi, Vol.V Ed.1 Januari 2010.
- Bank Indonesia. 2015. Sertifikat Bank Indonesia. [www.bi.go.id](http://www.bi.go.id).
- Black, Fischer, Michael, C. Jensen and Myron Scholes. “*The Capital Asset Pricing Model: Some Empirical Tests, in M. Jensen ed., Studies in the Theory of Capital Markets, (Praeger, New York)*”. 1972.
- Bodie, Kane, Marcus. “*Essentials of Investments*”.*Fourth Edition*. 2001.
- Chasanah, Pepi Mariana. “*Analisis Return dan Risiko Kelompok Saham LQ45 dengan Menggunakan Model APT (Arbitrage Pricing Theory)*”.Tesis Program Studi Manajemen Agribisnis Sekolah Pasca Sarjana Institut Pertanian Bogor 2008.
- Chen, N.F., R.Roll and S.Ross (1986), “*Economic Forces and the Stock Market*”, Journal of Business, Vol.59, pp.383-403.
- Corrado, Charles J. and Jordan, Bradford D. “*Fundamentals of Investment Analysis*”. *Fourth Edition*. Mc Graw Hill. Singapore. 2000.
- Dewi, Andam. “*Capital Asset Pricing Model dan Arbitrage Pricing Theory dalam Memprediksi Return Saham Kelompok Jakarta Islamic Index*”.Tesis Program Studi Manajemen Agribisnis Sekolah Pasca Sarjana Institut Pertanian Bogor 2008.
- Eto, Edwin, Gruber, Martin and Retzler, Joel. 1984. “*The Arbitrage Pricing Model and Returns on Assets Under Uncertain Inflation*”. *The Journal of Finance*. Vol. XXXVIII No. 2. May 1984.
- Fama, Eugene, F., and MacBeth, Jones, 1973. “*Risk, Return, and Equilibrium: Empirical Test*”. Journal of Political Economy, Vol. 81, 607-636.
- Fischer, Donald E. & Jordan, Ronald J. “*Security Analysis & Portfolio Management*”.*6th edition*. New Jersey: Prentice Hall, Hal. 65. 1995.
- Hadi, Nor. “*Pasar Modal*”. Yogyakarta: Graha Ilmu. 2013.
- Halim, Abdul. “*Analisis Investasi*”. Jilid 1, Edisi Pertama, Salemba Empat, Jakarta, 2003.

- Ilna, Darminto, Devi. "Penerapan Metode CAPM untuk Menentukan Pilihan Investasi pada Saham". *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB)* | Vol. 13 No. 2 Agustus 2014. Malang.
- Jogiyanto. "Teori Portofolio dan Analisis Investasi". Yogyakarta: BPFE Universitas Gadjah Mada. 2000.
- \_\_\_\_\_. "Teori Portofolio dan Analisis Investasi". Yogyakarta: BPFE Universitas Gadjah Mada. 2003.
- \_\_\_\_\_. "Teori Portofolio dan Analisis Investasi". Edisi Ketujuh. BPFE. Yogyakarta. 2010.
- \_\_\_\_\_. "Teori portofolio dan Analisis Investasi". Ed. VIII. Yogyakarta: BPFE- Yogyakarta. 2013.
- Lintner, J. "*The Valuation of Risk Assets and Selection of Risky Investments in Stock Portfolios and Capital Budgets*", *Review of Economics and Statistics*, Vol. 47, pp. 13-37, 1965.
- Maftuhah, Helmiyani. "Perbandingan Metode CAPM dan APT dalam Menghitung *Return* Saham JII". Jakarta, 2014.
- Markowitz, H. M., "*Portfolio Selection*", *Journal of finance*, Volume 7, 1952.
- Mossin, J. "*Equilibrium in a Capital Market*", *Econometrica*, ol. 34, pp. 768-783, 1966.
- Premananto, Gancar Candra dan Madyan. "Saham Industri Manufaktur Sebelum dan Semasa Krisis Ekonomi". *Jurnal Penelitian Dinamika Sosial* vol. 5 no. 2 (Agustus 2004): 125-139.
- Ramli, Anwar. "*Risk dan Return Saham Perusahaan Industri Barang Konsumsi Bursa Efek Indonesia*". *Jurnal Aplikasi Manajemen* vol. 8 no. 4 (November 2010): 1090-1096.
- Rosadi, Dedi. "Ekonometrika & Analisis Runtun Waktu Terapan dengan EViews". Yogyakarta: ANDI. 2012.
- Ross, S.A. "*The Arbitrage Theory of Capital Asset Pricing*", *Journal of Economic Theory*, Vol. 13, 1976.
- Sharpe, William. "*Investment*". *Sixth Edition*". New Jersey: Prentice Hall. 1999.
- \_\_\_\_\_, Alexander, Bailey. "investasi", edisi indonesia, penerjemah Henry Njooliangtik dan Agustiono, Prenhallindo, Jakarta, 1997.
- Singgih, Santoso. "*Business Forecasting : Metode Peramalan Bisnis Masa Kini dengan MINITAB dan SPSS*". Jakarta: PT. Elex Media Komputindo. 2009.

- Sugiyono. "Metode Penelitian Kuantitatif, kualitatif dan R&D". Bandung: Alfabeta. 2011.
- Supranto, J. "Ekonometri". Buku Kesatu. Bogor: Ghalia Indonesia. 2005.
- \_\_\_\_\_. "Statistika, Teori dan Aplikasi". Edisi Ketujuh, Jilid Dua. Jakarta: Erlangga, 2009.
- Suryani, Ima. "Pengujian Empiris Konsistensi CAPM di Pasar Modal Indonesia Periode 1991-2001". Tesis Program Manajemen Pasca Sarjana UNIKOM, 2003.
- Tandelilin, Eduardus. "Analisis Investasi Manajemen Portfolio". Cetakan Pertama, Yogyakarta: BPF. 2001.
- \_\_\_\_\_. "Portofolio dan Investasi: Teori dan Aplikasi". Edisi I. Yogyakarta: Kanisius, 2010.
- Treynor, Jack. "*Toward a Theory Of Market Value Risky Asset*", makalah tidak diterbitkan, Arthur D.Little, Cambridge, MA, 1961.
- Van Horne, James C, Wachowicz JR., John M. "*Fundamentals of Financial Management*". Buku 2. Edisi 12. Jakarta : Salemba Empat 2007.