

DAFTAR PUSTAKA

- Ahmad, K.2004. *Dasar –Dasar Manajemen Investasi dan Portofolio Cetakan Kedua*.Jakarta : PT. Rineka Cipta.
- Bursa Efek Indonesia.2010.*Sejarah Bursa Efek Indonesia*.Disadur dari <http://www.idx.co.id/id-id/beranda/tentangbei/sejarah.aspx>, diakses pada tanggal 25 Maret 2018, pukul 12.00 WIB.
- Bodi, Z., Alex K., Alan J. M., dan Ravi J. 2014. *Investment:Asia Global Edition*. Singapore: McGraw – Hill Education (Asia).
- Brigham, E. F., Michael C. E., A. Koh, dan S.-K. Ang.2014. *Financial Management : Theory and Practice*. Singapore : CENGAGE Learning (Asia).
- Fama, E. F., dan Kenneth R. F.1992.*The Cross Section of Expected Stock Returns*.Chicago: The Journal of Finance, Vol. XLVII, No.2, June 1992: 427 – 465.
- Hartono, J.2016.*Teori Portofolio dan Analisis Portofolio*.Yogyakarta:BPFE – YOGYAKARTA.
- Hasyim, A. I.2016.*Ekonomi Makro Edisi Pertama*.Depok : Kencana Prenadamedia Group.
- Husnan, S. 2005. *Dasar- Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas Edisi Keempat*.Yogyakarta : UPP STIM YKPN.
- Ibrahim, M. I., Jullia T., dan Tohap K. M. 2017. *Analisis Keakuratan Capital Asset Pricing Model (CAPM) dan Arbitrage Pricing Theory (APT) dalam Memprediksi Expected Saham pada LQ45*. Manado :JdC, Vol. 6, No. 1, Maret 2017 : 30 – 44
- Liani, M.2017.*Analisis Perbandingan Saham-Saham Efisien Pembentuk Portofolio Dengan Capital Asset Pricing Model(CAPM) Dan Fama – French Three Factor Model(Studi Kasus Pada Perusahaan KOMPAS 100 Tahun 2013-2015)*.Pekanbaru : KURS Vol. 2 No. 1, Juni 2017: 76 – 89.
- Premananto, G. C., dan Muhammad M. 2004.*Perbandingan Keakuratan Capital Asset Pricing Model dan Arbitrage Pricing Theory Dalam Memprediksi Tingkat Pendapatan Saham Industri Manufaktur Sebelum dan Semasa Krisis Ekonomi*.Surabaya : Jurnal Penelitian Dinamika Sosial Vol. 5 No. 2 Agustus 2004: 125-139.
- Putri, E. L. L.Jumat, 20 April 2018. *Investor pasar modal per Maret 2018 meningkat 8,34%*. Disadur dari <https://investasi.kontan.co.id/news/investor-pasar-modal-per-maret-2018-meningkat-834>, diakses pada tanggal 9 Juni 2018, pukul 20.50 WIB.



UNIVERSITAS
GADJAH MADA

ANALISIS PERBANDINGAN KEAKURATAN ANTARA SINGLE INDEX MODEL, CAPM, APT, DAN FAMA AND FRENCH 3 FACTOR MODEL DALAM MEMPREDIKSI RETURN SAHAM STUDI PENGAMATAN PADA PERUSAHAAN YANG TERMASUK INDEKS KOMPAS100 PERIODE 2012-2017

HAROLD KEVIN ALFREDO, 1. Bapak Prof. Dr. Indra Wijaya Kusuma, M.BA

Universitas Gadjah Mada, 2018 | Diunduh dari <http://etd.repository.ugm.ac.id/>

Saputra, I. D., dan Umi M. 2008. Perbandingan *Fama and French Three Factor Model* dengan *Capital Asset Pricing Model*. Yogyakarta : Jurnal Riset Akuntansi dan Keuangan Vol. 4, No.2, Agustus 2008 : 132 – 145.