

## DAFTAR PUSTAKA

- Adityo. 2012. Analisis Pengaruh Corporate social responsibility, beta, firm size, dan Book to Market Ratio Terhadap Return Saham Manufaktur Di BEI. *Skripsi Universitas Diponegoro Semarang*.
- Andri. 2010. Perbandingan Keakuratan CAPM dan APT Dalam Memprediksi Tingkat Pendapatan Saham LQ45. *Skripsi Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah*.
- Bursa Efek Jakarta. Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-307/BEJ-DAG/U/07/-2007. 1 Agustus 2007. <http://bughibughi.files.wordpress.com>.  
(diakses tanggal 25 Maret 2013)
- Bursa Efek Indonesia. Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-23/BEI-PSH/U/01-2008. 1 Februari 2008. <http://bughibughi.files.wordpress.com>.  
(diakses tanggal 25 Maret 2013)
- Bursa Efek Indonesia. Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-364/BEI-PSH/U/07/-2008. 1 Agustus 2008. <http://bughibughi.files.wordpress.com>.  
(diakses tanggal 25 Maret 2013)
- Bursa Efek Indonesia. Pengumuman Pengaktifan Perdagangan Sesi Pre-Opening Peng-00029/BEI.PSH/U/05-2009. 11 Mei 2009. <http://bughibughi.files.wordpress.com>.  
(diakses tanggal 25 Maret 2013)
- Bursa Efek Indonesia. Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-00283/BEI-PSH/07-2009. 31 Juli 2009. <http://bughibughi.files.wordpress.com>.  
(diakses tanggal 25 Maret 2013)
- Bursa Efek Indonesia. Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-00020/BEI.PSH/01-2010. 29 Januari 2010. <http://bughibughi.files.wordpress.com>.  
(diakses tanggal 25 Maret 2013)
- Bursa Efek Indonesia. Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-00439/BEI.PSH/-PSH/07-2010. 30 Juli 2010. <http://bughibughi.files.wordpress.com>.  
(diakses tanggal 25 Maret 2013)

- Bursa Efek Indonesia. Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-00023/BEI.PSH/01-2011. 31 Januari 2011. <http://bughibughi.files.wordpress.com>.  
(diakses tanggal 25\_Maret 2013)
- Bursa Efek Indonesia. Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-00434/BEI.PSH/07-2011. 25 Juli 2011. <http://bughibughi.files.wordpress.com>.  
(diakses tanggal 25 Maret 2013)
- Bursa Efek Indonesia. Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-00011/BEI.PSH/01-2012. 24 Januari 2012. <http://bughibughi.files.wordpress.com>.  
(diakses tanggal 25 Maret 2013)
- Bursa Efek Indonesia. Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-00461/BEI.PSH/07-2012. 24 Januari 2012. <http://bughibughi.files.wordpress.com>.  
(diakses tanggal 25 Maret 2013)
- Bodie, Zvi Kane, Alex dan Marcus. Alan J. 2008. *Investment*. Edisi 7. McGraw Hill, Boston.
- Brigham, Eugne F dan Houston, Joel F. Dasar-Dasar Manajemen Keuangan, edisi 10.Terjemahan Ali Akbar Yulianto. Jakarta: Salemba Empat, 2006.
- Brigham, Eugene F dan Houston, Joel F. 2010. *Fundamentals of Financial Management*. Seventh Edition. South-Western Cengage Learning. USA.
- Faried, Asbi Rachman. 2008. Analisis Pengaruh Fundamental dan Nilai Kapitalisasi Pasar terhadap Return Saham Perusahaan Manufaktur Di BEI. *Skripsi Universitas Diponegoro Semarang*.
- Ghozali, Imam, 2011, Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS, Edisi V. Badan Penerbit Universitas Diponegoro, Semarang.
- Harga Saham Emiten. <http://finance.yahoo.com/> (diakses tanggal 8 Juni 2013)
- Merinda, Titut.2006. Pengaruh Rasio Keuangan (PER, DER, NPM, PBV) Terhadap Proporsi Kepemilikan Saham Asing Pada Perusahaan Manufaktur Di BEJ. *Skripsi Universitas Islam Indonesia*.
- Nachrowi, D. 2006. Ekonometrika untuk Analisis Ekonomi dan Keuangan. Cetakan Pertama. Jakarta. Lembaga Penerbit FEUI.

- Rachmawati, Sisca. 2010. Analisis Pengaruh Fundamental Terhadap Risiko Sistematis (Beta) Pada Saham Lq45 Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2006-2008. *Skripsi Universitas Diponegoro Semarang*.
- Santosa, Perdana Wahyu dan Laksana, Harry Yusuf. 2011. Value at Risk, Market Risk and Trading Activity (CAPM Alternative Model). *Journal of Applied Finance & Banking*, vol.1, no.4, 2011, 239-268. ISSN: 1792-6580 (print version), 1792-6599 (online).
- Sumekar, Kertati. 2003. Pengaruh Beta, Size, dan Price to Book Value Terhadap Return Saham LQ45 Di BEI. *Skripsi Universitas Diponegoro Semarang*.
- Sofiana, Nita. 2011. Pengukuran Value At Risk Pada Portofolio Dengan Simulasi Monte Carlo. *Skripsi Universitas Negeri Yogyakarta*.
- Sugiarto, Agung. Analisis Pengaruh Beta, Size Perusahaan, DER, dan PBV Ratio terhadap Return Saham. *Jurnal Dinamika Akuntansi*. Vol. 3. No. 1. Maret 2011.
- Suharli, Michell. 2005. Studi Empiris Terhadap Dua Faktor Yang Mempengaruhi Return Saham Pada Industri Food & Beverages Di Bursa Efek Jakarta. *Jurnal Akuntansi & Keuangan*. Vol. 7. No. 2. Nopember 2005.
- Solechan, Ahmad. 2011. Pengaruh Earning, Manajemen Laba, Ios, Beta, Size dan Rasio Hutang Terhadap Return Saham pada Perusahaan yang Go Public Di BEI. *Jurnal Akuntansi dan Auditing*. Vol. 6 No. 1.
- Trisnadewi, Mariana. 2012. Analisis Pengaruh Risiko Pasar, Size, Book To Market, Dan Momentum Terhadap Keputusan Investor Di Bursa Efek Indonesia. *Skripsi Universitas Diponegoro Semarang*.
- Pasaribu, Rowland Bismark Fernando. Analisis Pengaruh Faktor Fundamental Terhadap Risiko Sistematis (Beta) Pada Saham LQ45 Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2006-2008. *Jurnal Akuntansi dan Keuangan*. Vol. 21. No. 2. Agustus 2010 : 105-127.
- Winarno, Wing Wahyu. Analisis Ekonometrika dan Statistika Dengan Eviews Edisi 3. UPP STIM YKPN. Jakarta. 2011.
- Wolk et. al. 2001. *Accounting Theory: A Conceptual Institutional Approach*. Fifth Edition. South-Western College Publishing.
- Zvi Bodie, Alex Kane, dan Alan J Marcus. Investasi, edisi 6. Terjemahan Zuliani Dalimunthe dan Budi Wibowo. Jakarta: Salemba Empat, 2006.