

DAFTAR PUSTAKA

- Achsien, Iggie H., *Investasi Syariah di Pasar Modal: Menggagas Konsep dan Praktik Manajemen Portofolio Syariah*, Jakarta: PT Gramedia Pustaka Utama, 2003.
- Agus Sartono, *Manajemen Keuangan Teori dan Aplikasi*, Yogyakarta: BPFE, 2002.
- Andri (2010). Perbandingan Keakuratan CAPM dan APT Dalam Memprediksi Tingkat Pendapatan Saham LQ45. *Skripsi, Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah*.
- Bodie, Kane, Marcus, *Investment*, Eighth Edition, New York: Mc-Graw Hill, 2008
- Boudoukh, J. dan Richardson, M. (1993), Stock Return and Inflation: A Long Horizon Perspective, *The American Economic Review*, Vol. 83, No.5.
- Bursa Efek Indonesia. *Pengumuman Pengaktifan Perdagangan Sesi Pre-Opening Peng-00029/BEI.PSH/U/05-2009*. 11 Mei 2009.
<https://demo.post.co.id/docs/preopening.pdf> (diakses tanggal 20 Mei 2013)
- Bursa Efek Indonesia. *Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-00283/BEI-PSH/07-2009*. 31 Juli 2009.
http://hadiborneo.files.wordpress.com/2013/03/20090731_lq45_aug09_jan10.pdf (diakses tanggal 20 Mei 2013)
- Bursa Efek Indonesia. *Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-00020/BEI.PSH/01-2010*. 29 Januari 2010.
http://hadiborneo.files.wordpress.com/2013/03/20100129_lq45_feb10_juli10.pdf (diakses tanggal 20 Mei 2013)
- Bursa Efek Indonesia. *Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-00439/BEI.PSH/-PSH/07-2010*. 30Juli 2010.
http://www.idx.co.id/Portals/0/StaticData/MarketInformation/ListOfSecurities/Pre-Opening//2010_PreOpening_Agt10-Jan11. (diakses tanggal 20 Mei 2013)
- Bursa Efek Indonesia. *Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-00023/BEI.PSH/01-2011*. 31 Januari 2011.

http://www.idx.co.id/Portals/0/StaticData/MarketInformation/ListOfSecurities/Pre-Opening//2011_PreOpening_Feb-Jul2011_New.pdf

(diakses tanggal 20 Mei 2013)

Bursa Efek Indonesia. *Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-00434/BEI.PSH/07-2011*. 25 Juli 2011.

http://hadiborneo.files.wordpress.com/2013/03/20110725_lq45_aug11-jan12.pdf (diakses tanggal 20 Mei 2013)

Bursa Efek Indonesia. *Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-00011/BEI.PSH/01-2012*. 24 Januari 2012.

http://hadiborneo.files.wordpress.com/2013/03/20120124_lq45_feb12-juli12.pdf (diakses tanggal 20 Mei 2013)

Bursa Efek Indonesia. *Pengumuman Saham Emiten Yang Masuk Dalam Perhitungan Indeks LQ45 No.Peng-00461/BEI.PSH/07-2012*. 24 Januari 2012.

http://www.idx.co.id/Portals/0/StaticData/MarketInformation/ListOfSecurities/IndexConstituent/LQ45/20120725_LQ45_Aug12-Jan13.pdf (diakses tanggal 20 Mei 2013)

Canegrati, E. (2008), Testing The CAPM: Evidences From Italian Equity Markets, *Journal of Economics*, Volume 49.

Darmadji, T. dan Fakhruddin, H.M, *Pasar Modal di Indonesia*. Salemba Empat: Jakarta, 2006

Fama, E.F., J.D. Macbeth (1973), Risk, Return, and Equilibrium: Empirical Tests, *The Journal of Political Economy*, Volume 81, Issue 3.

Fama, E.F., K.R. French (1992), The Cross Section of Expected Stock Returns, *The Journal of Finance*, Volume XLVII, No. 2.

Halim, dan Tandelilin, *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*, Edisi Pertama, Yogyakarta: BPFE, 2001

Hanif, M. (2010), Testing Application of CAP Model on KSE Pakistan. A Case Study on Tobacco Sector, *Management Accountant*, Vol. 19, No. 3.

Hanif, M., Bhatti, U. (2010), Validity of Capital Assets Pricing Model: Evidence from KSE Pakistan, *European Journal of Economics, Finance and Administrative Sciences*, No. 20.

- van Horne, J.C, *Fundamentals of Financial Management*, 12th Edition, New York: Financial Times Prentice Hall, 2005.
- Husnan dan Pudjiastuti, *Dasar-dasar Manajemen Keuangan*, Yogyakarta: UPP AMP YKPN, 2004
- Javid, A.Y., Ahmad, E. (2008), The Conditional Capital Asset Pricing Model: Evidence From Karachi Stock Exchange, *Journal of Economics*, Vol. 10, No. 29.
- Jensen, M.C., F. Black, M. Scholes. (1972). The Capital Asset Pricing Model: Some Empirical Tests. *Studies in The Theory of Capital Markets*, New York: Prager Publisher.
- Jogiyanto, *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, Edisi Ke-2, Yogyakarta: BPFE, 2003.
- Joseph, N.L. (2002), Modelling The Impacts of Interest Rate and Exchange Rate Change on UK Stock Return, *Derivative Use, Trading, & Regulation*, Vol. 7, No. 4.
- Michailidis, G., S. Tsopoglou, D. Papanastasiou, E. Mariola (2006), Testing The Capital Asset Pricing Model (CAPM): The Case of The Emerging Greek Securities Market, *International Research Journal of Finance and Economics*, Issue 4.
- Nasir, A. (2011), Pengaruh Nilai Kurs, Inflasi, Suku Bunga Deposito, dan Volume Perdagangan Saham Terhadap Return Saham pada Perusahaan Perbankan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia, *Jurnal Ekonomi Universitas Riau*, Vol. 19, No. 04.
- Nguyen, T.D., (2010), Arbitrage Pricing Theory: Evidence from an Emerging Stock Market, *Journal of Development and Policies Research*, Vol. 1, No. 5.
- Prabawani, Bulan (2003), Pengaruh Beta Saham Harian Terhadap Return Saham Harian Pada Pasar yang Sedang Berkembang. *Tesis, Universitas Diponegoro*.
- Sartono, Agus, *Manajemen Keuangan; Aplikasi dan Teori*. Yogyakarta: BPFE, 2002
- Sugiarto, A. (2011), Analisa Pengaruh Beta, Size Perusahaan, DER, dan PBV Ratio terhadap Return Saham, *Jurnal Dinamika Akuntansi*, Vol. 3, No. 1

- Titman, S., dan Warga, A. (1989), Stock Returns As Predictors of Interest Rates and Inflation, *Journal of Financial and Quantitative Analysis*, Vol. 24, No. 1.
- Vanny, M. Dio (2011), Menguji Pengaruh Beta Saham Terhadap Return Saham Dengan Unconditional dan Conditional Approach. *Skripsi, Universitas Diponegoro*.
- Yang, Xi dan Xu, Donghui, (2006), Testing The CAPM Model-A Study of The Chinese Stock Market. *International Journal of Applied Economics*, Vol. 20, No. 6.
- Zubairi, H.J., S. Farooq (2011), Testing The Validity of CAPM and APT in The Oil, Gas, and Fertilizer Companies Listed on The Karachi Stock Exchange, *Karachi: College of Business Management*.