

## DAFTAR PUSTAKA

- Abd-Alla, M. H., & Sobh, M. (2020). *Empirical Test of Fama and French Three-Factor Model in the Egyptian Stock Exchange. Financial Assets and Investing, 11(2)*, 5–18. Di akses 20 febuari 2021, dari <https://doi.org/10.5817/fai2020-2->
- Asra, A., & Rudiansyah. (2017). *statistika terapan*. in media
- Ariawati, R. N., & Evita, S. N. (2018). *Metode Kuantitatif Praktis*. Bandung: Bima Pratama Sejahtera.
- Ajija, S. R., Sari, D. w, Setianto, R. H., & Primanti, M. R. (2011). *Mengenal Program EViews*. Salemba Empat.
- Algifari. (2019). *Statistika Deskriptif Plus Untuk Ekonomi dan Bisnis (Kedua)*. UPP STIM YKPN.
- Bank Indonesia. (2020). *Laporan Suku Bunga*. Diakses 21 Febuari 2021, dari <https://www.bi.go.id>
- Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. J. (2014). *Investment*. McGraw-Hill Education.
- Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. J. (2019). *Dasar-Dasar Investasi (Edisi 9)*. Salemba Empat.
- Bursa Efek Indonesia. (2021). *Laporan Buku Statistik*. Diakses 12 Febuari 2021, dari <https://www.idx.co.id>
- Chowdhury, E. K. (2017). *Functioning of Fama-French Three-Factor Model in Emerging Stock Markets: An Empirical Study on Chittagong Stock Exchange, Bangladesh. Journal of Financial Risk Management, 06(04)*, 352–363.
- Fawziah, S. A., & Margasari, N. (2016). *Pengaruh fama french three factor model terhadap return saham*. *Jurnal Manajemen Bisnis Indonesia, 5(5)*, 434–442.
- Febriansyah, N. M., Mardani, R. M., & Priyono, A. A. (2018). *Pengujian Fama French Three Factor Model's dalam Mempengaruhi Return Saham Studi Kasus Pada Saham LQ-45*. *Jurnal Riset Manajemen*.
- Gunawan, I. (2018). *pengantar statistika inferensial*. Pt Rajagrafindo Persada.

Faudia Rizky Aprillia, 2021

**PENGUJIAN FAMA-FRENCH THREE FACTOR MODEL TERHADAP EXCESS RETURN SAHAM PADA PERUSAHAAN INDEKS KOMPAS100 PERIODE 2016-2020**

UPN Veteran Jakarta, Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Program Studi S1 Manajemen  
[www.upnvj.ac.id](http://www.upnvj.ac.id) - [www.library.upnvj.ac.id](http://www.library.upnvj.ac.id) - [www.repository.upnvj.ac.id](http://www.repository.upnvj.ac.id)

- Habib, M., Shiddiq, N., Hasnawati, S., & Huzaimah, R. A. F. (2020). *Fama-French Three Factor Model : A Study on LQ 45 Companies In Indonesia Stock Exchange*. 11(3), 25–30. Di akses 1 maret 2021, dari <https://doi.org/10.9790/5933-1103062530>
- Investing. (2021). *Harga Saham Bulanan*. Diakses 15 Febuari 2021, dari [www.investing.com](http://www.investing.com)
- Jones, C. p. (2019). *Investasi : Prinsip dan Konsep*. Salemba Empat.
- Juncheng, L., & Yuning, S. (2020). *An Empirical Analysis of the Fama-French Three-Factor Model in A-Share Market*. *Iemetc*, 45–50.
- Kara, E. (2016). *Fama ve French'in Üç Faktörlü Varlık Fiyatlama Modeli'nin Geçerliliği: Borsa İstanbul Örneği*. *Cankiri Karatekin Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Dergisi*. Diakses 1 maret 2021 , dari <https://doi.org/10.18074/cnuibf.327>
- Lembaga Administrasi Negara. (2018). *Processing Data Penelitian Kuantitatif Menggunakan EViews*. Lembaga Administrasi Negara.
- Liani, M. (2017). *Analysis Of The Comparison Among Efficient Stocks That Form Portfolio Using Capital Asset Pricing Model (CAPM) And Fama-French Three Factor Model (Case Study On Kompas 100 Companies From 2013-2015)*. 2(1), 76–89.
- Mardhiyah, A. (2017). *Peranan Analisis Return Dan Risiko Dalam Investasi*. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Islam*, 2(1), 1–17. Diakses 5 maret 2021, dari <https://doi.org/10.32505/jebis.v2i1.120>
- Mulya, Y., Zaini, O., & Ramdani, S. (2019). *Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Excess Return dengan Pendekatan Model*. *Call for Papers FMI 2019 Samarinda*, 1(1977), 1–7.
- Nadiya, F. (2019). *Pengaruh Kinerja Keuangan Dan Ukuran Perusahaan Terhadap Return Saham*, 53(9), 1689–1699.
- Otoritas Jasa Keuangan. (2021). *Laporan Publikasi Perdagangan Saham*. Diakses 10 Febuari 2021, dari <https://ojk.go.id/>
- Perbedaan, A., Dan, R., Saham, R., Dengan, O., & Portofolio, B. (2015). *Analisis Perbedaan Return dan Risiko Saham Portofolio Optimal dengan Bukan Portofolio Optimal*. *Management Analysis Journal*, 4(1). Diakses 5 Maret 2021,

dari <https://doi.org/10.15294/maj.v4i1.7210>

- Perdana, E. (2016). *Olah Data Skripsi dengan SPSS 22*. Bangka Belitung: LAB KOM Manajemen FE UBB.
- Permana, S., Yordani, R., Robert, K., & Budi, Y. (2018). *Dasar-dasar Statistik dengan Software R Konsep dan Aplikasi*. In Media.
- Sattar, M., & -, J. (2017). *CAPM Vs Fama-French Three-Factor Model: An Evaluation of Effectiveness in Explaining Excess Return in Dhaka Stock Exchange*. *International Journal of Business and Management*, 12(5), 119. Diakses 12 Maret, dari <https://doi.org/10.5539/ijbm.v12n5p119>
- Sobti, N. (2016). *Revisiting CAPM and Fama French Three Factor Model in Indian Equity Market*. *Business Analyst*, 37(1), 31–46.
- Sunyoto, D. (2014). *statistik untuk paramedis*. alfabeta
- Surono, Y. (2016). *Memprediksi Return Saham: Keakuratan 2 (Dua) Model Fama French Dan CAPM*. *Eksis*, 7(2), 117–132.
- Sutrisno, B., & Nasri, R. (2018). *Is More Always Better? An Empirical Investigation of the CAPM and the Fama-French Three-factor Model in Indonesia*. *KnE Social Sciences*, 3(10), 454. Diakses 12 Maret, dari <https://doi.org/10.18502/kss.v3i10.3148>
- Thi, T., & Anh, T. (2017). *The Fama-French Three-Factor Model in Vietnam - A Quantile Regression Approach*. 1(2), 239–256.
- Utami, S., Aziz, A., & Jubaedah. (2021). *Analisis Determinan Return Saham Yang Terdaftar Di Bei Pada Masa Transisi Covid-19*. 2.
- Wijaya, E., & Sadria, F. (2019). *Pendekatan Three Factor Model Pada Sektor Property , Real Estate , dan Konstruksi Bangunan*. 4(3), 491–502.
- Wiley. (2018). *Behavioral Finance, Individual Investors, And Institutional Investors*. CFA Program Curriculum.
- Xie, S., & Qu, Q. (2016). *The Three-Factor Model and Size and Value Premiums in Chinas Stock Market*. *Emerging Markets Finance and Trade*, 52(5), 1092–1095. Diakses 13 maret, Dari <https://doi.org/10.1080/1540496X>

Faudia Rizky Aprillia, 2021

**PENGUJIAN FAMA-FRENCH THREE FACTOR MODEL TERHADAP EXCESS RETURN SAHAM PADA PERUSAHAAN INDEKS KOMPAS100 PERIODE 2016-2020**

UPN Veteran Jakarta, Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Program Studi S1 Manajemen

[www.upnvj.ac.id](http://www.upnvj.ac.id) - [www.library.upnvj.ac.id](http://www.library.upnvj.ac.id) - [www.repository.upnvj.ac.id](http://www.repository.upnvj.ac.id)