

DAFTAR PUSTAKA

- Alroaia, Y. V., S. R. Nabavi, & H. E. Mofidabadi. 2012. *Surveying effects of forward-backward P/E ratios on stock's return and fluctuation in Tehran's stock exchange*. *Management Science Letters*, 2(5), 1731-1740.
- Andansari, N. A., K. Raharjo, & R. Andini. 2016. Pengaruh *return on equity (ROE)*, *price earning ratio (PER)*, *total asset turn over (TATO)* dan *price to book value (PBV)* terhadap *return* saham: Studi kasus pada perusahaan manufaktur sektor makanan dan minuman yang terdaftar di BEI periode 2008-2014. *Journal of Accounting*, 2(2).
- Andari, A. T., & Y. Bakhtiar. 2019. Pengaruh *price cash flow ratio (PCFR)* dan *price sales ratio (PSR)* pada *return* saham: Studi pada perusahaan ritel tahun 2015-2016. *Riset & Jurnal Akuntansi*, 3(2), 184-194.
- Antara, I. M. Y., & N. P. S. Suryantini. 2019. Pengaruh rasio pasar terhadap *return* saham pada saham LQ-45 di bursa efek Indonesia. *E-Jurnal Manajemen*, 8(9), 5507-5526.
- Aprilianto, B., N. Wulandari, & T. Kurrohman. 2014. Perilaku investor saham individual dalam pengambilan keputusan investasi: Studi hermeneutika-kritis. *E-Journal Ekonomi Bisnis dan Akuntansi*, 1(1), 16-31.
- Asmi, T. L. 2014. *Current ratio, debt to equity ratio, total asset turnover, return on asset, price to book value* sebagai faktor penentu *return* saham. *Management Analysis Journal*, 3(2).
- Astuti, A. M. 2010. *Fixed effect model* pada regresi data panel. *Beta*, 3(2), 134-145.
- Azis, M., S. Mintarti, & M. Nadir. 2015. *Manajemen investasi: Fundamental, teknikal, perilaku investor dan return saham*. Yogyakarta: Deepublish.
- Basarda, R. F., M. Moeljadi, & N. K. Indrawati. 2018. *Macro and micro determinants of stock return companies in LQ-45 index*. *Jurnal Keuangan dan Perbankan*, 22(2), 310-320.
- Basuki, A. T., & N. Prawoto. 2017. *Analisis regresi dalam penelitian ekonomi & bisnis: Dilengkapi aplikasi spss & evIEWS*. Depok: PT Rajagrafindo Persada.
- Bawono, A., & A. F. I. Shina. 2018. *Ekonometrika terapan: Untuk ekonomi dan bisnis islam aplikasi dengan evIEWS*. Salatiga: LP2M IAIN Salatiga.
- Boentoro, N. V., & E. T. Widyarti. 2018. Analisis pengaruh rasio likuiditas, *leverage*, profitabilitas, aktivitas dan pasar terhadap *return* saham: Studi kasus perusahaan *consumer goods* periode 2012-2016. *Dipenogoro Journal of Management*, 7(2), 1-12.
- Bragg, S. M. 2002. *Business ratios and formulas: A comprehensive guide*. Hoboken, New Jersey: John Wiley & Sons, Inc.

- Brigham, E. F., & J. F. Houston. 2013. *Fundamentals of financial management*, Edisi Kedelapan. Mason, United States: Cengage Learning.
- Bursa Efek Indonesia. Indeks Saham LQ45. <https://www.idx.co.id/data-pasar/data-saham/indeks-saham/> diakses pada 15 November 2020.
- _____. Laporan Keuangan dan Tahunan. <https://www.idx.co.id/perusahaan-tercatat/laporan-keuangan-dan-tahunan/> diakses pada 11 Februari 2021.
- _____. Ringkasan Perdagangan Saham. <https://www.idx.co.id/data-pasar/ringkasan-perdagangan/ringkasan-saham/> diakses pada 12 Maret 2021.
- _____. Ringkasan Performa Perusahaan Tercatat. <https://www.idx.co.id/data-pasar/laporan-statistik/ringkasan-performa-perusahaan-tercatat/> diakses pada 12 Maret 2021.
- _____. Statistik Tahunan Bursa Efek Indonesia. <https://www.idx.co.id/data-pasar/laporan-statistik/statistik/> diakses pada 12 Maret 2021.
- Caraka, R. E., & H. Yasin. 2017. *Spatial data panel*. Ponorogo: Wade Group.
- Damodaran, A. 2012. *Investment valuation: Tools and techniques for determining the value of any asset*. Hoboken, New Jersey: John Wiley & Sons, Inc.
- Drake, P. P., & F. J. Fabozzi. 2010. *The basics of finance: An introduction to financial markets, business finance, and portfolio management*. Hoboken, New Jersey: John Wiley & Sons, Inc.
- Dwialesi, J. B., & N. P. A. Darmayanti. 2016. Pengaruh faktor-faktor fundamental terhadap *return* saham indeks Kompas 100. *E-Jurnal Manajemen Unud*, 5(4), 2544-2572.
- Ermianti, C., D. Amanah, D. A. Harahap, & E. S. Siregar. 2019. Pengaruh kebijakan dividen terhadap harga saham perusahaan subsektor otomotif dan komponen yang terdaftar di bursa efek Indonesia periode 2008-2017. *Niagawan*, 8(2), 131-139.
- Fraser, L. M. & A. Ormiston. 2004. *Memahami laporan keuangan*, Edisi Keenam. Jakarta: Indeks.
- Ghozali, I. 2014. *Ekonometrika: Teori, konsep dan aplikasi dengan IBM SPSS 22*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Glassman, J. 2005. *When numbers don't add up*. *Kiplinger's Personal Finance*, 59(8), 32-34.
- Gujarati, D. N., & D. C. Porter. 2012. *Dasar-dasar ekonometrika*, Edisi Kelima. Jakarta: Salemba Empat.
- Harahap, S. S. 2011. *Analisis kritis atas laporan keuangan*. Jakarta: RajaGrafindo Persada.
- Husnan, S., & E. Pudjiastuti. 2006. *Dasar-dasar Manajemen Keuangan*, Edisi Ketiga. Yogyakarta: UPP AMP YKPN.

- IDN Financials. Deviden Perusahaan. <https://www.idnfinancials.com/> diakses pada 20 November 2020.
- Jaunanda, M., & B. A. Fransesca. 2015. Analisis pengaruh rasio likuiditas, rasio profitabilitas, rasio solvabilitas dan rasio pasar terhadap *return* saham. *Ultima Accounting*, 7(1), 54-69.
- Jogiyanto. 2017. *Teori portofolio dan analisis investasi*, Edisi Kesebelas. Yogyakarta: BPFE-Yogyakarta.
- Kusmayadi, D., R. Rahman, & Y. Abdullah. 2018. *Analysis of the effect of net profit margin, price to book value, and debt to equity ratio on stock return. International Journal of Recent Scientific Research*, 9(7F), 28091-28095.
- Kustina, L., O. Safitri, & S. Anwar. 2019. Kebijakan deviden dan *capital gain*: Pengaruhnya terhadap harga saham. *Jurnal Investasi*, 5(1), 24-37.
- Mahardika, I. N. F., & L. G. S. Artini. 2017. Pengaruh rasio pasar dan rasio profitabilitas terhadap *return* saham perusahaan di bursa efek Indonesia. *E-Jurnal Manajemen Unud*, 6(4), 1877-1905.
- Majid, M. S. A., & Benazir. 2015. *An indirect impact of the price to book value to the stock returns: An empirical evidence from the property companies in Indonesia. Jurnal Akuntansi dan Keuangan*, 17(2), 91-96.
- McMillan, M. G., J. E. Pinto, W. L. Pirie, & G. V. Venter. 2011. *Investments: Principles of portfolio and equity analysis*. Hoboken, New Jersey: John Wiley & Sons, Inc.
- Murhadi, W. R. 2013. *Analisis laporan keuangan: Proyeksi dan valuasi saham*. Jakarta: Salemba Empat.
- Nazir, M. 2003. *Metode penelitian*. Jakarta: Ghalia Indonesia.
- Nestanti, D. D. 2017. Pengaruh rasio profitabilitas, rasio solvabilitas dan rasio nilai pasar terhadap *return* saham perusahaan *real estate* dan properti. *Jurnal Manajemen Bisnis*, 7(1), 35-44.
- O'Shaughnessy, J. P. 2005. *What works on wall street*, Edisi Ketiga. New York, United States: McGraw Hill.
- Pei Fun, L., & S. R. Basana. 2012. *Price earnings ratio and stock return analysis: Evidence from liquidity 45 stocks listed in Indonesia stock exchange. Jurnal Manajemen dan Kewirausahaan*, 14(1), 7-12.
- Penman, Stephen H. 2007. *Financial statement analysis and security valuation*, Edisi Ketiga. New York, United States: McGraw Hill.
- Pignataro, P. 2013. *Financing modeling and valuation: A practical guide to investment banking and private equity*. Hoboken, New Jersey: John Wiley & Sons, Inc.
- Ping-fu, L., & C. Kwai-yee. 2016. *Relationships between stock returns and corporate financial ratios based on a statistical analysis of corporate data*

- from the Hong Kong stock market. *Public Finance Quarterly, State Audit Office of Hungary*, 61(1), 110-123.
- Pinto, J. E., E. Henry, T. R. Robinson, & J. D. Stowe. 2010. *Equity asset valuation*. Hoboken, New Jersey: John Wiley & Sons, Inc.
- Polakitan, C. D. 2015. Analisis komparasi risiko saham LQ45 dan nonLQ45 pada beberapa subsektor perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI). *Jurnal Riset Bisnis dan Manajemen*, 3(1), 61-72.
- Pratama, I. G. S., & I. A. A. Idawati. 2019. Pengaruh rasio keuangan terhadap *return* saham pada perusahaan pertanian di bursa efek Indonesia. *Wicaksana, Jurnal Lingkungan & Pembangunan*, 3(1), 38-44.
- Reilly, F. K., & K. C. Brown. 2012. *Investment analysis & portfolio management*, Edisi Kesepuluh. Mason, United States: South-Western Cengage Learning.
- Rosiana, R., W. Retnowati, & Hendro. 2014. Pengaruh rasio profitabilitas, rasio aktivitas, rasio pasar, *firm size*, tingkat suku bunga, dan nilai tukar terhadap *return* saham: Studi empiris pada perusahaan makanan dan minuman di bursa efek Indonesia periode 2008-2011. *Jurnal Bisnis dan Manajemen*, 4(1), 79-91.
- Ross, S. A., R. W. Westerfield, & B. D. Jordan. 2008. *Fundamentals of corporate finance*, Edisi Kedelapan. New York, United States: McGraw-Hill/Irwin.
- Ross, S. A., R. W. Westerfield, B. D. Jordan, J. Lim, & R. Tan. 2015. *Pengantar keuangan perusahaan: Fundamentals of corporate finance*. Jakarta: Salemba Empat.
- Rumasukun, M. R., M. Y. Noch., V. Pattiasiana, A. Ikhsan, & R. W. Batilmurik. 2020. *Structural model of company stock return in basic and chemical industries: Impact of profitability, market value, liquidity and leverage*. *Talent Development & Excellence*, 12(2s), 3118-3129.
- Santoso, B., E. A. Sidharta, & A. K. Wardini. 2020. *The impact of fundamental factors on stock return of engineering and construction services companies*. *Jurnal Organisasi dan Manajemen*, 16(2), 158-170.
- Setyawan R., A. dkk. 2019. Analisis masalah heteroskedastisitas menggunakan *generalized least square* dalam analisis regresi. *Eigen Mathematics Journal*, 2(2), 61-72.
- Stefano, K. 2015. *The impact of financial ratio toward stock return of property industry in Indonesia*. *iBuss Management*, 3(2), 222-231.
- Sugiyono. 2013. *Metode penelitian kuantitatif, kualitatif dan R&D*. Bandung: ALFABETA.
- _____. 2018. *Metode penelitian kuantitatif*. Bandung: ALFABETA.
- Sutomo, L., & L. Ardini. 2017. Pengaruh rasio profitabilitas dan rasio nilai pasar terhadap *return* saham. *Jurnal Ilmu dan Riset Akuntansi*, 6(10).

- Tandelilin, E. 2017. *Pasar modal: Manajemen portofolio dan investasi*. Yogyakarta: Kanisius.
- Wahlen, J. M., S. P. Baginski, & M. T. Bradshaw. 2014. *Financial reporting, financial statement analysis, and valuation*, Edisi Kedelapan. Boston, United States: Cengage Learning.
- Weygandt, J. J., P. D. Kimmel, & D. E. Kieso. 2015. *Accounting principles*, Edisi Keduabelas. Hoboken, New Jersey: John Wiley & Sons, Inc.
- Yahoo Finance. Data Historis Indeks LQ45. <https://finance.yahoo.com/quote/%5EJKLQ45/history?p=%5EJKLQ45> diakses pada 14 Februari 2021.
- Zulfikar. 2016. *Pengantar pasar modal dengan pendekatan statistika*. Yogyakarta: Deepublish.