

DAFTAR PUSTAKA

- Apriliyani, S. (2024). Analisis Pengaruh Market Factor, Size, Book To Market Ratio, Profitability, And Investment Terhadap Excess Return Saham (Studi pada Indeks Saham Jakarta Islamic Index (JII) yang terdaftar di BEI pada Tahun 2020-2022). Skripsi: Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Universitas Islam Negeri Jakarta.
- Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. J., (2019). Dasar-Dasar Investasi. Jakarta: Salemba Empat
- Darma, Y.D., Indriati, P., Pujihearta, Hartati, N., dan Indriani M., (2024). Mampukah Model Enam Faktor *Fama and French* menggungguli Model Tiga Faktor *Fama and French* dengan Proksi Indeks Kompas 100. Jurnal Riset Akuntansi dan Perpajakan, 11(1), 89-104.
- Fama, E. F., & French, K. R. (2015). A five-*factor* asset pricing model. Journal of Financial Economics, 116(1), 1–22.
- Fama, E. F., & French, K. R. (2018). Choosing *factors*. Journal of Financial Economics, 128(2), 234–252.
- Florensia, C. and Susanti, N., (2020). How does the six-*factor* model do in explaining the relationship between *return* and *risk* on the Indonesia stock exchange?. International Journal of Research in Business & Social Science, 9(7), 93-107.
- Indriyani. (2021). Analisis *Fama and French* Five *Factor* Model Terhadap *Excess Return* Pada Saham Yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2016-2019. Skripsi: Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Institut Informatika dan Bisnis Darmajaya Lampung.
- Lubis, P. K. D., Silalahi, H. H. B., Sinaga, A. F., Sapma, P. N., dan Sitio, V., (2024). Pasar Modal Dan Pengaruhnya Terhadap Perekonomian Di Indonesia. Jurnal Akuntansi, Keuangan, dan Auditing, 5(1), 196-214.
- Munawaroh, U. and Sunarsih, (2020). The effects of Fama-French five *factor* and *momentum factor* on Islamic stock portfolio *excess return* listed in ISSI. Jurnal Ekonomi & Keuangan Islam, 6(2), 119-133.



2020). Pengujian Fama-French Five *Factor* Model Terhadap *Excess Return* Pada Saham yang Terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII) Periode 2016-2019. Skripsi: Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Universitas Islam Negeri Jember.

- Putra, I. G. S., Susanti, N., & Putra, O. E. (2019). Pengujian Fama & French Five - *Factors* Asset Pricing Model. *Bisma (Jurnal Bisnis Dan Manajemen)*, 13(3), 148–157.
- Ross, Stephen A., Westerfield, Randolph W., Bradford D. Jordan, Joseph Lim, Ruth Tan. (2015). *Fundamentals of Corporate Finance*. McGraw-Hill Education (Asia).
- Rahayu, K., Aidid, M. K., & Rais, P. (2023). Analisis Regresi Data Panel Pada Angka Partisipasi Murni (APM) Jenjang Pendidikan SMP Sederajat di Provinsi Jawa Barat Pada Tahun 2018-2021. *VARIANSI: Journal of Statistics and Its Application on Teaching and Research*, 5(2), 64-75.
- Shiddiq. (2020). Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi *Excess Return* Dengan Pendekatan Fama-French Three *Factor* Model Pada Saham Lq-45 Di Bursa Efek Indonesia.
- Subarsih, S. & Sholihati, A. M. (2023). Five-Factor Asset Pricing Model Fama and French dalam Memahami *Excess Return* Saham Syariah sebelum dan sesudah Diumumkan Covid-19 di Indonesia. *BENEFIT: Jurnal Manajemen dan Bisnis*, 8(1), 94-112.
- Sutrisno, B. & Ekaputra, I. A. (2016). Uji Empiris Model Asset Pricing Lima Faktor Fama-French di Indonesia. *Jurnal Keuangan dan Perbankan*, 20(3), 343-357.
- Tandellin, Equardus. (2010). *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi*. Yogyakarta: Kanisius.
- Thoraya & Muyassaroh. (2023). Analisis Pengaruh *Return On Assets*, *Debt To Equity Ratio* Dan *Corporate Social Responsibility* Terhadap *Return* Saham Pada Perusahaan Manufaktur Sektor Barang Konsumsi Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2016-2020. *Jurnal Ekonomi dan Akuntansi*, 3(2), 393-408.
- Tirta, W. O. P. (2016). Identifikasi Perbedaan Asset Pricing Model: Pendekatan Three *Factor* Model, Identifikasi Perbedaan Asset Pricing Model: Pendekatan Three *Factor* Model, Q-*Factor* Model & Five *Factor* Model (Studi Kasus Pada Perusahaan Yang Terdaftar Di Bursa Efek). *Journal Manajemen Airlangga*,



- Yuliyana, I., & Sembiring, F. (2022). Analisis Model Lima Faktor Fama dan French pada Saham-Saham Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia Periode 2016-2019. *Portofolio: Jurnal Ekonomi, Bisnis, Manajemen, Dan Akuntansi*, 18(2), 101 - 119.
- Zubir, Z. (2013). *Manajemen Portofolio Penerapannya Dalam Investasi Saham*. Jakarta: Salemba empat.

