

## DAFTAR PUSTAKA

- Amihud, Yakov. 2000. *Illiquidity and Stock Returns: Cross-Section and Time-Series Effects*. Setrn School of Business, New York University, New York 10012, NY.
- Andy, Porman. 2008. *Menilai Harga Wajar Saham*. Jakarta: PT. Elex Media Komputindo.
- Dede, Hertina dan Mohamad Bayu Herdiana Hidayat. 2018. *Financial Performance and Systemic Risk Effect On Stock Return (Case Study on Oil and Gas Companies Listed In IDX Year 2011-2016)*. Perisai, vol 2 (2), October 2018, 87-100. ISSN 2503-3077.
- Deden, Mulyana. 2011. *Analisis Likuiditas Saham Serta Pengaruhnya Terhadap Harga Saham Pada Perusahaan Yang Berada Pada Index LQ45 di Bursa Efek Indonesia*. Jurnal Magister Manajemen, Volume 4 Nomor 1 Maret 2011 halaman 77-96.
- Eduardus, Tandelin. 2010. *Portofolio dan Investasi*, edisi pertama. Yogyakarta: Kanisius.
- \_\_\_\_\_. 2017. *Pasar Modal Manajemen Portofolio & Investasi*. Yogyakarta: Kanisius.
- Galatia, Sinaga, Deanes, dan Muslih (2016) *Analisis Pengaruh Fundamental dan Risiko Sistematis terhadap Return Saham Perusahaan Manufaktur di Bursa Efek Indonesia (BEI)*. e-Proceeding of Management, Vol. 3, No. 2, Agustus 2015.
- Hanafi, Mahmud M. 2015. *Manajemen Keuangan*, edisi pertama. Yogyakarta: BPFE.
- Hendy, M.F. 2008. *Istilah Pasar Modal A-Z*. Jakarta: PT. Elex Media Komputindo.
- Horne, James C. Van dan Jhon M Wachowicz. 2013. *Fundamentals of Financial Management (Prinsip-prinsip Manajemen keuangan)*, edisi keduabelas. Jakarta: Salemba Empat.
- Irham, Fahmi. 2015. *Rahasia Saham & Obligasi (Strategi Meraih Keuntungan Tak Terbatas dalam Bermain Saham dan Obligasi)*. Bandung: Alfabeta.
- Jogiyanto, Hartono. 2010. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, edisi ketujuh. Yogyakarta: BPFE.

- \_\_\_\_\_. 2017. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, edisi kesebelas. Yogyakarta: BPFE.
- Joko, Salim. 2010. *Cara Gampang Bermain Saham*. Jakarta: PT. Elex Media Komputindo.
- Kasmir. 2016. *Analisis Laporan keuangan*. Jakarta: Raja Grafindo Persada.
- Ketut Arya, I Wayan Suwendra, dan Gede Putu Agus. 2014. *Pengaruh ROI, EVA dan Likuiditas Saham terhadap Return Saham pada Sektor Keuangan yang Go Public*. E-Journal Bisma Universitas Pendidikan Ganesha Jurusan Manajemen, Volume 2 Tahun 2014.
- Kumianny, Elly dan Pwee Leng (2002) *Pengaruh Risiko Sistematis dan Likuiditas terhadap Tingkat Pengembalian Saham*. Jurnal Manajemen dan Kewirausahaan, Vol. 4, No. 1, Maret 2002, 15-25.
- Latifah Dwi Anggiyanti. 2018. *Pengaruh Indiosyncratic Risk dan Likuiditas Saham terhadap Return Saham Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI)*. Jurnal Manajemen Bisnis Indonesia, Vol. 7, No. 4 (2018), 390-399.
- Lo, A. W., M.J. Wong. 2000. *Trading Volume: definitions, Data Analysis, and Implications of Portofolio Theory*. The Review of Financial Studies, P.257.
- Mursidah Nurfadilah. 2018. *Pengaruh Risiko Sistematis dan Likuiditas Saham terhadap Return Saham Pada PT. Bank Muamalat Indonesia, Tbk. di Bursa Efek Indonesia*. Jurnal Ekonomi dan Manajemen Universitas Muhammadiyah Kalimantan Timur, Vol. 12, No. 1, Januari 2018, 25-34.
- Mochamad, Effendi (2017) *Analisis Risiko Sistematis dan Risiko Tidak Sistematis terhadap Expected Return Saham dalam Pembentukan Portofolio Optimal Indeks Saham LQ45*. Jurnal Manajerial Bisnis, Vol. 1, No. 2, Desember 2017-Maret 2018, 178-193. ISSN 2597-503X.
- Oni, Ade Mahendra, Irni Yunita, dan Tieka Trikartika Gustyana (2017) *Pengaruh Likuiditas Perdagangan Saham dan Profitabilitas terhadap Return Saham Pada Indeks Saham Syariah Indonesia di Bursa Efek Indonesia (BEI). Periode 2011-2015*. e-Proceeding of Management, Vol. 4, No. 2, Agustus 2017, 1171-1177. ISSN 2355-9357.
- Poltak, Theodorus dan Esli Silalahi. 2017. *Pengaruh Faktor Fundamental dan Risiko Sistematis terhadap Return Saham Pada Perusahaan Manufaktur yang Go Publik di Bursa Efek Indonesia*. Jurnal Riset Akuntansi dan Keuangan, Vol. 3, No. 1, Maret 2017, 71-88. ISSN 2443-1079.

- Ross, A Stephen. Westerfield, Rondolph W. Jordan, Bradford D. 2003. *Fundamentals of Corporate Finance*. Sixth Edition. New York: MC Graw-Hill.
- Suad, Husnan. 2005. *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*, edisi keempat. Yogyakarta: UPP STIM YKPN.
- Sugiyono. 2012. *Metode Penelitian Pendidikan Pendekatan Kuantitatif, Kualitatif dan R&D*. Bandung: Alfabeta.
- \_\_\_\_\_. 2013. *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif dan R&D*. Bandung: CV Alfabeta.
- \_\_\_\_\_. 2014. *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif dan R&D*. Bandung: Alfabeta.
- \_\_\_\_\_. 2016. *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif dan R&D*. Bandung: Afabeta.
- \_\_\_\_\_. 2018. *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif dan R&D*. Bandung: Afabeta.
- Sumani dan Christine Suhari. 2013. *Analisis Pengaruh Risiko Sistematis dan Likuiditas Saham terhadap Tingkat Pengembalian Saham dalam Perusahaan Non-Keuangan LQ45 Periode 2007-2009*. Jurnal Fakultas Ekonomi Universitas Katolik Indonesia Atma Jaya, Volume 17, Nomor 1, Januari 2013.
- Werner, R. Murhadi. 2013. *Pengaruh Indiosyncratic Risk dan Likuiditas Saham Terhadap Return Saham*. Jurnal Universitas Surabaya, Vol. 15, No. 1, Maret 2013, 33-40. ISSN 1411-1438.

[www.astra-agro.co.id](http://www.astra-agro.co.id)  
[www.finance.yahoo.com](http://www.finance.yahoo.com)  
[www.idx.co.id](http://www.idx.co.id)