

DAFTAR PUSTAKA

- Adhelia, Nona Della. (2017). “Pengaruh Return Saham, Capital Structure, Ownership Structure dan Kebijakan Dividen Terhadap Risiko Investasi.” Diakses dari <http://eprints.perbanas.ac.id/2764/>
- Aji, Rio Satriyo. (2015). “Analisis Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Risiko Sistematis (Beta) Saham Pada Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2009-2014.” Diakses dari <https://core.ac.uk/download/pdf/76930298.pdf>
- Anggito, Albi, Johan Setiawan. (2018). *Metodologi Penelitian Kualitatif*. Jawa Barat. Diakses dari https://www.google.co.id/books/edition/Metodologi_penelitian_kualitatif/59V8DwAAQBAJ?hl=en&gbpv=1&dq=Metodologi+Penelitian+Kualitatif+albi+anggito&printsec=frontcover
- Banz, Rolf W. (1981). “The Relationship Between Return and Market Value of Common Stocks. *Journal of Financial Economy* 9.” Diakses dari [https://doi.org/10.1016/0304-405X\(81\)90018-0](https://doi.org/10.1016/0304-405X(81)90018-0)
- Baskoro, Yogo Laksono. (2015). “Analisis Pengaruh Beta, Size, Book to Market, dan Profitability Terhadap Return Aggressive Stock.” Diakses dari http://eprints.undip.ac.id/47185/1/08_BASKORO.pdf
- Basu, Debarati dan Deepak Chawla. (2012). “An Empirical Test of the Arbitrage Pricing Theory-The Case of Indian Stock Market. *Global Business Review* 13,3 (2012): 421-432.” Diakses dari <https://doi.org/10.1177%2F097215091201300305>
- Bowman, Edward H. (1980). “A Risk/ Return Paradox For Strategic Management.” Diakses dari <https://dspace.mit.edu/bitstream/handle/1721.1/48928/riskreturnparado00bowm.pdf?sequence>
- Bursa Efek Indonesia. Diakses dari <https://www.idx.co.id/>
- Chari, Murali D.R, Parthiban David, Augustine Duru, dan Yijiang Zhao. (2018). “Bowman’s Risk-Return Paradox: An Agency Theory Perspective. *Journal of Business Research*.” Diakses dari <https://doi.org/10.1016/j.jbusres.2018.08.010>
- Fama, Eugene F., dan Kenneth R. French. (1992). “The Cross-Section of Expected Stock Returns. *The Journal of Finance* Vol. XLVII, No. 2.” Diakses dari <https://www.jstor.org/stable/2329112>

- Fiigenbaum, Avi. (1990). "Prospect Theory and the Risk-Return Association. *Journal of Economic Behavior and Organization*." Diakses dari [https://doi.org/10.1016/0167-2681\(90\)90074-N](https://doi.org/10.1016/0167-2681(90)90074-N)
- Fiigenbaum, Avi dan Howard Thomas. (1988). "Attitudes and the Risk-Return Paradox: Prospect Theory Explanations. *Academy of Management Journal*. 31, (1), 85-106. Research Collection Lee Kong Chian School of Business." Diakses dari <https://doi.org/10.2307/256499>
- Henkel, Joachim. (2008). "The Risk-Return Paradox for Strategic Management: Disentangling True and Spurious Effects." Diakses dari <https://dx.doi.org/10.2139/ssrn.1014325>
- Ismail, Farida Fitriani dan Dedy Sudarmadi. (2019). "Pengaruh Sistem Informasi Akuntansi dan Pengendalian Internal Terhadap Kinerja Karyawan PT. Beton Elemen Persada. *Jurnal Akuntansi, Audit, dan Sistem Informasi Akuntansi* Vol. 3, No. 1." Diakses dari <https://media.neliti.com/media/publications/284413-pengaruh-sistem-informasi-akuntansi-dan-1b7c3aee.pdf>
- Justina, Dormauli. (2017). "Pengaruh Firm Size dan Market to Book Ratio Terhadap Return Portofolio. *Jurnal Manajemen dan Bisnis Sriwijaya* Vol. 15 (2)." Diakses dari <https://www.neliti.com/publications/283964/pengaruh-firm-size-dan-market-to-book-ratio-terhadap-return-portofolio>
- Kahneman, Daniel & Amos Tversky. (1979). "Prospect Theory: An Analysis of Decision Under Risk. *Econometrica* 47: 263-291." Diakses dari <https://sci-hub.se/10.1017/cbo9780511609220.014>
- Kurniawan, Oki Tjandra Suryo dan IB. Anom Purbawangsa (2018). "Pengujian Anomali Pasar Size Effect dan the day of Week Effect di Bursa Efek Indonesia. *E-Jurnal Ekonomi dan Bisnis Udayana* 7.9 (2018) halaman 2147-2174." Diakses dari <https://doi.org/10.24843/EEB.2018.v07.i09.p03>
- Maknun, Lu'luil. (2010). "Analisis Pengaruh Frekuensi Perdagangan, Volume Perdagangan, Kapitalisasi Pasar, dan Trading Day Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI Periode Tahun 2006-2008." Diakses dari <https://core.ac.uk/download/pdf/11722139.pdf>
- Mardawani. (2020). *Praktis Penelitian Kualitatif Teori Dasar dan Analisis Data Dalam Perspektif Kualitatif*. Yogyakarta. Diakses dari https://www.google.co.id/books/edition/Praktis_Penelitian_Kualitatif_Teori_Dasa/nn0GEAAAQBAJ?hl=en&gbpv=0

- Mar'ati Fudji Sri. (2013). "Pengaruh Firm Size Terhadap Return Saham pada Perusahaan Manufaktur yang Tercatat di Bursa Efek Indonesia Periode 2004-2009. Among Makarti Vol.6 No.12." Diakses dari <https://jurnal.stieama.ac.id/index.php/ama/article/view/89>
- Nuir, Rikko Sajjad dan Marwan Asri. (2019). "Bowman's Paradox: Prospect-Theory-Based Risk-Return Relationship (Some Recent Evidences in Indonesia). Indonesian Capital Market Review 11 (2019) 1-14." Diakses dari <http://www.ijil.ui.ac.id/index.php/icmr/article/viewFile/11173/67546509>
- Otoritas Jasa Keuangan. Diakses dari <https://ojk.go.id>
- Patel, Pankaj C, Mingxiang Li, dan Haemin Dennis Park. (2017). "A Replication of Bowman's Paradox Phenomenon Across 28 Countries. Journal of Innovation and Knowledge." Diakses dari <https://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S2444569X17300033>
- Pracanda, Desak Gede Sinta Putri dan Nyoman Abundanti. (2017). "Pembentukan Portofolio Optimal Dengan Menggunakan Model Markowitz Pada Saham Indeks IDX30 di Bursa Efek Indonesia. E-Jurnal Manajemen Unud, Vol.6, No.2, 2017: 802-829" Diakses dari <https://media.neliti.com/media/publications/245912-none-Offa9364.pdf>
- Ramadhan, Rahardian Dwi, Siti Ragil Handayani, dan Maria Goretti Wi Endang. (2014). "Analisis Pemilihan Portofolio Optimal Dengan Model Dan Pengembangan Dari Portofolio Markowitz." Diakses dari <https://media.neliti.com/media/publications/84303-ID-analisis-pemilihan-portofolio-optimal-de.pdf>
- RE, Ramel Yanuarta. (2012). "Anomali Size Effect di Bursa Efek Indonesia. Jurnal Kajian Manajemen Bisnis, Volume 1, Nomor 1, Maret 2012, halaman 39-58." Diakses dari <http://ejournal.unp.ac.id/index.php/jkmb/article/view/4769>
- Ruefli, Timothy W. (1990). "Mean-Variance Approaches to Risk-Return Relationship in Strategy: Paradox Lost. Management Science, Volume 36, Issue 3, 368-380." Diakses dari <https://www.jstor.org/stable/2631956>
- Sari, Asni Cahya Permata. (2017). Kandungan Informasi Pada Sesi Pra Pembukaan dan Volume Perdagangan Serta Pengaruh Terhadap Return Saham. Semarang: Unika Soegijapranata Semarang <http://repository.unika.ac.id/14821/>
- Sari, Ni Kadek Ari Puspa dan Made Gede Wirakusuma. (2016). "Pengaruh Adverse Selection dan Negative Framing Pada Kecenderungan Eskalasi Komitmen. E-Jurnal Ekonomi dan Bisnis Universitas Udayana, Hal 573-600." Diakses dari <https://media.neliti.com/media/publications/44795-ID-pengaruh-adverse-selection-dan-negative-framing-pada-kecenderungan-eskalasi-komi.pdf>

- Sekaran, Uma dan Roger Bougie. (2017). *Metode Penelitian untuk Bisnis ed.6, buku 2*. Jakarta: Salemba Empat.
- Sinaga, Nobert Steven dan Prasetiono (2014). “Analisis Pengaruh Corporate Governance Terhadap Kinerja Keuangan Perusahaan Dengan Variabel Kontrol Ukuran Perusahaan dan Growth Opportunity.” Diakses dari <https://ejournal3.undip.ac.id/index.php/djom/article/view/12935/12538>
- Sumampow, Susan dan Sri Murni. (2016). “Pengaruh Return Saham, Price Book Value dan Return On Asset Terhadap Dividend Payout Ratio Pada Perusahaan yang Terdaftar di BEI (Studi Pada Perusahaan Telekomunikasi). Jurnal EMBA, Vol. 4, No.2, Juni 2016, Hal. 795-805.” Diakses dari <https://media.neliti.com/media/publications/132483-ID-none.pdf>
- Sutarso, Augustina Kurniasih, dan Luna Haningsih. (2016). “Analisis Pengaruh Multifaktor Terhadap Return Saham di Indonesia. Jurnal Manajemen, Volume XX No. 03.” Diakses dari <https://media.neliti.com/media/publications/114188-ID-none.pdf>
- Wahyuni, Komang Tri. (2019). “Studi Perbandingan Kinerja Portofolio Saham Berdasarkan Kapitalisasi Pasar di Bursa Efek Indonesia Dengan Risk Adjusted Return. Diakses dari <https://ejournal.unmas.ac.id/index.php/juima/article/download/475/459/>