

## DAFTAR PUSTAKA

- Ambarwati, S. D. (2008). Pengaruh Return Saham, Volume Perdagangan Saham dan Varian Return Saham terhadap Bid-Ask Spread Saham Pada Perusahaan Manufaktur yang tergabung dalam Indeks LQ45 Periode 2003-2005. *Jurnal Siasat Bisnis* , 12 (1), 27-38.
- Amihud, Y. (2002). Illiquidity and Stock Returns : Cross-Section and Time-Series Effects. *Journal of Financial Markets* 5 , 31-56.
- Amihud, Y., & mendelson, H. (1986). Asset pricing and the bid-ask spread. *Journal of Financial Economics* , Economics.
- Asma, R. (2006, April). Cross Section Return Saham dan Kebijakan Moneter. *Jurnal Ekonomi dan Kewirausahaan Vol 6 no 1* , 22-35.
- Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. (2006). *Investment*. Jakarta: Salemba Empat.
- Brennan, M., & Subrahmanyam, A. (1996). Market microstructure and asset pricing: on the compensation for illiquidity in stock returns. *Journal of Financial Economics* 41 , 441-464.
- Chen, N.-F., & Kan, R. (1995). Expected Return and the Bid-Ask Spread. 1-17.
- Chordia, T., Subrahmanyam, A., Anshuman, & V.R. (2001). Trading activity and expected stock returns. *Journal of Financial Economics* 59 , 3-32.
- Darmadji, T., & Fakhrudin, H. M. (2006). *Pasar Modal di Indonesia*. Jakarta: Salemba Empat.
- Datar, V. T., Naik, N. Y., & Radcliffe, R. (1998). Liquidity and stock returns: An alternative test. *Journal of Financial Markets* , 1 (2), 203-219.
- Eleswarapu, V. (1997). Cost of transacting and expected returns in the NASDAQ market. *Journal of Finance* 52 , 2113-2127.
- Elly, K. A., & Leng, P. (2002). Pengaruh Risiko Sistematis dan Likuiditas Terhadap Tingkat Pengembalian Saham Badan-badan Usaha yang Go-Public di Bursa Efek Jakarta pada Tahun 1999. *Jurnal Manajemen dan Kewirausahaan Vol 4 no 1* , 15-25.
- Fama, E. F., & French, K. R. (1995). Size and Book-to-Market Factors in Earning and Returns. *Journal of Finance no 1* , L, 131-155.

- Fang, J., Sun, Q., & Wang, C. (2006). Illiquidity, Illiquidity Risk and Stock Return : Evidence from Japan. *Finance and Accounting* , 1-41.
- Fitriati, I. R. (2010). *Analisis Hubungan Distress Risk, Firm Size, dan Book to Market Ratio dengan Return Saham*. Skripsi dipublikasikan, Program sarjana Manajemen, Jurusan Manajemen Universitas Diponegoro. Semarang
- Frensidy, B. (2008). *Determinan Bid-Ask Spread Saham-Saham Dalam KOMPAS 100 Di Bursa Efek Indonesia*. Depok.
- Ghozali, I. (2006). *Aplikasi Analisis Multivariate Dengan Program SPSS*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Gujarati, D. N., & Porter, C. D. (2010). *Dasar-dasar Ekonometrika*. Jakarta: Salemba Empat.
- Hakim, A. R. (2008). *Analisis Perbedaan return dan volume perdagangan saham berdasarkan kelompok Fraksi saham pada perusahaan go public*. rangkuman skripsi, Sekolah Tinggi Ilmu Ekonomi Perbanas. Surabaya
- Halim, A. (2005). *Analisis Investasi*. Jakarta: Salemba Empat.
- Harris, L. (2003). *Trading and Exchanges: Market Microstructure for Practitioners*. Oxford University Press.
- Husnan, S. (2003). *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: UPP AMP YKPN.
- Indriantoro, N., & Supomo, B. (1999). *Metodologi Penelitian Bisnis*. Yogyakarta: BPFE.
- Jogiyanto. (2003). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFE.
- Jones, C. P. (2007). *Investment analysis and Management*. USA: John Wiley and Sons.
- Kirana, W. A. (2009, Agustus 10). *Kirana@Kontan*. Retrieved Juli 8, 2012, from Pengertian Dividend Yield:<http://kirana-kontan.blogspot.com/2009/08/dividend-yield.html>
- Martusa, R. (2007). Pengaruh Dividend Yield dan Price Earnings Ratio terhadap Return Saham dengan Investment Opportunity set sebagai variabel moderating. *Jurnal Bisnis dan Akuntansi* , 253-273.

- Nidar, S. R., & Adyatmika, I. G. (2006). Pengaruh Beta dan Likuditas Saham Terhadap Tingkat Pengembalian Saham Pada Saham LQ45 Di Bursa Efek Jakarta periode 2005-2006.
- OMRI, A., Zayani, M. B., & Loukil, N. (2010). Impact of Liquidity on Stock Returns : An Empirical Investigation of The Tunis Stock Market. *Macroeconomics and Finance in Emerging Market Economies* , Vol 3 (2), 261-283.
- Pastor, L., & Stambaugh, R. (2003). Liquidity risk and expected stock returns. *Journal of Political Economy* 111 , 642-685.
- Redding, L. (1997). Firm size and dividend payouts. *Journal of Financial Intermediation* 6 , 224–248.
- Rusdin. (2006). *Konsep Pasar Modal dalam Pasar Modal*. Bandung: Alfabeta.
- Sekaran, U. (2006). *Research Methods For Business*. (K. M. Yon, Trans.) Jakarta: Salemba Empat.
- Sharpe, W. F. (1999). *Investasi*. Jakarta: Prenhallindo.
- Siamat, D. (2001). *Manajemen Lembaga Keuangan*. Jakarta: Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia.
- Yuningsih, I., & Yudaruddin, R. (2007). Pengaruh Model 3 Faktor terhadap Return Saham. *Akuntabilitas* , 7 (1), 79-84.