

## DAFTAR PUSTAKA

- Admati, A. and Pfleiderer, P. 1988. *A Theory of Intraday Patterns Volume and Price Variability*. Review of Financial Studies 1,3 – 40.
- Ang, Robert. 1997. *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia* : Mediasoft Indonesia
- Anton. 2006. *Analisis Model Volatilitas Return Saham (Studi Kasus pada Saham LQ45 di Bursa Efek Jakarta)*. Thesis. MM Undip
- Boedijoewono, Noegroho. 2007. *Pengantar Statistika*. Yogyakarta : UPP AMP YKPN
- Chae, Joon. 2005. *Trading Volume, Information Assymetry, and Timing Information*. Usahawan No. 03 TH XXXIV
- Chan, K. And Fong, W. 2000. *Trade size, Order imbalance, and The Volatility Volume Relation*. Journal of Financial Economics 57, 247 – 273.
- Dananti, Kristyana. 2004. *Pengujian Kausalitas Volume Perdagangan dan Perubahan Harga Saham di Bursa Efek Jakarta*. PERSPEKTIF Jurnal Ekonomi Pembangunan. Manajemen dan Akuntansi. Vol. 9 No. 2. Halaman 105 – 116
- Darmadji, Tjiptono, Hendy M. Fakhrudin. 2008. *Pasar Modal di Indonesia (Pendekatan Tanya Jawab)*. Jakarta : Salemba Empat
- Djarwanto. 1995. *Petunjuk Teknis Penyusunan Skripsi*. Yogyakarta : BPFE
- Dritsaki, Melina, Chaido Dritsaki. 2003. *Macroeconomic Determinants of Stock Price Movement: An Empirical Investigation of the Greek Stock Market*. University of Macedonia
- Firmansyah. 2006. *Analisis Volatilitas Harga Kopi Internasional*. Jakarta : Usahawan
- Ghozali, Imam. 2001. *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS*. Semarang : BP-UNDIP
- Hanafi, Mamduh. 2009. *Manajemen Risiko*. Yogyakarta : UPP STIM YKPN
- Handayani. 2007. *Pengaruh Tingkat Suku Bunga SBI, Nilai Kurs Dollar AS, dan Tingkat Inflasi terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) (Studi di Bursa Efek Jakarta)*, Tahun XXIX No. 1, Januari-Juni 2008. Hal. 55-67

- Hasan, Iqbal. *Pokok-Pokok Materi Statistik 2 (Statistik Inferensi)*. Jakarta ; Bumi Aksara.
- Huang, R.D dan R.W. Masulis. .2002. *Trading Activity And Stock Price Volatility: Evidence From The London Stock Exchange*
- Husnan, Suad. 2000. *Manajemen Keuangan Teori dan Penerapan (Keputusan Jangka Panjang)*. Yogyakarta : BPF
- Indriantoro, Nur dan Supomo, Bambang. 1999. *Metodologi Penelitian Bisnis*, Edisi 1. Yogyakarta : BPF
- Jogiyanto. 2007. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta:BPFE
- Jones, C., Kaul, G., Lipson, M. 1994. *Transaction, Volume, and Volatility*. Review of Financial Studies 7. 631 – 652.
- Kuncoro, Mudrajat. 2001. *Metode Kuantitatif*. Yogyakarta : UPP AMP YKPN
- Kholisoh, Luluk, Darmadi, Dennis V. 2008. *Perilaku Perdagangan Intrahari di Bursa Efek Jakarta*. Jurnal Ekonomi Bisnis No. 1 Vol. 13
- Mamoon, Dawood. 2007. *Macro Economic Uncertainty of 1990s and Volatility at Karachi Stock Exchange*. Munich Personal RePEc Archive Paper.
- Marcus, Brealey Myers. 2008. *Dasar – Dasar Manajemen Keuangan Perusahaan*. Jakarta : Penerbit Erlangga
- Nachrowi, Nachrowi Djalal, Hardius Usman. 2002. *Penggunaan Teknik Ekonometri*. Jakarta : PT. Raja Grafindo Persada
- Prastowo, Dwi dan Juliaty, Rifka. 2002. *Analisis Laporan Keuangan Konsep dan Aplikasi*. Edisi Revisi. Yogyakarta : UPP AMP YKPN
- Purwoto, Lukas, Eduardus Tandelillin. 2003. *Pengaruh Tick Size Terhadap Volatilitas : Investigasi Empiris di Bursa Efek Jakarta*. KOMPAK. No. 7, Hal. 54-67
- Riyanto, Bambang.1995. *Dasar-Dasar Pembelian Perusahaan*. Ed.4. Yogyakarta : BPF
- Samuelson, Paul A, Coleman, J.R. 1995. *Makroekonomi*. Jakarta : Erlangga
- Samsul, Muhammad. 2006. *Pasar Modal & Manajemen Portofolio*. Jakarta : Penerbit Erlangga

- Sari, Whida. 2004. *Hubungan antara Volatilitas Perdagangan dan Volatilitas Harga Intraday di Bursa Efek Jakarta*. Tesis S2 Tidak Dipublikasikan. Yogyakarta: Universitas Gadjah Mada.
- Schwert, G. William. 1989. *Why Does Stock Market Volatility Change Over Time?*. The Journal Of Finance. Vol. XLIV, No. 5
- Schwert, \_\_\_\_\_ 1992. *Empirical Research in Capital Market*. Mc Graw Hill
- Sudjana. 1997. *Statistika : untuk Ekonomi dan Niaga*. Bandung : Tarsito
- Sugiyono. 2004. *Metode Penelitian Bisnis*. Bandung : Alfabeta
- Sulaiman, Wahid. 2002. *Jalan Pintas Menguasai SPSS*. Yogyakarta : Andi
- Sunariyah. 2004. *Pengetahuan Pasar Modal*. Ed. 4. Yogyakarta : UPP AMP YKPN
- Van Horn , James C , John M Wachowicz. Jr. 2009. *Prinsip – Prinsip Manajemen Keuangan*. Jakarta : Salemba Empat
- Wiriandhi, Ario. 2006. *Analisis Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Volatilitas Imbal Hasil Saham Sektor Infrastruktur, Utilitas, dan Transportasi di Bursa Efek Jakarta (Periode Januari 1998-Desember 2005)*. Thesis. MM UI
- Wiyani, Wahyu dan Andi Wijayanto. 2005. *Pengaruh Nilai Tukar Rupiah, Tingkat Suku Bunga Deposito dan Volume Perdagangan Saham Terhadap Harga Saham*. Jurnal Keuangan dan Perbankan. Vol.9. No.3. Halaman 884 – 903
- Zan, Song, Chiou Wei. 2003. *The Macroeconomic Determinants of Stock Price Volatility: Evidence From Taiwan, South Korea, Singapore, and Hong Kong*. Department of Managerial Economics and Institute of Economics Nan-Hua University