

DAFTAR PUSTAKA

- Amihud, Yakov., Mandelson, dan Pedersen. 2005. "Liquidity and Asset Prices". USA. Now Publisher Inc.
- Ang, Robert. 1997. *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia Edisi I*, Media Soft, Indonesia.
- Achmad, Darmawan. 2007. Pengaruh Overnight Information Terhadap Return Saham Dual Listing. *Jurnal Ekonomi FE Untar* Th XII/01/Maret/2007 ISSN: 0854-9842. Universitas Tarumanegara.
- Adityo. 2012. Analisis Pengaruh Corporate Social Responsibility, Beta, Firm Size, dan Book to Market Ratio terhadap Return saham (studi kasus Perusahaan Manufaktur yang terdaftar di BEI periode 2010-2011).
- Algifari. 1999. Pengaruh Hari perdagangan terhadap return saham di Bursa Efek Jakarta. Tesis. Universitas Gajah Mada.
- Chandra, Rudy. 2010. Analisis Pemilihan saham oleh Investor Asing di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Bisnis&Birokrasi, Jurnal Ilmu Administrasi dan Organisasi*, Mei-Agustus 2010, Hlm. 101-113 ISSN 0854-3844.
- Choe, et al. 2005. Do Domestic Investor Have an Edge? The Trading Experience of Foreign Investor in Korea. *The Review of Financial studies* 1 v 18 n 3 2008
- Chung dan Wei. 2005. The Relationship between bid-ask spread and holding periods, *Global Finance Journal* 15, 239-249.
- Ciptaningsih, Agung NI. 2010. Analisis pengaruh harga saham, volume perdagangan, dan variansi return saham terhadap bid ask spread pada masa sebelum dan sesudah Stock split (studi kasus pada perusahaan Manufaktur yang listing di BEI periode 2003-2009). Skripsi. Universitas Diponegoro.
- Darusman, Dery. 2012. Analisis pengaruh Firm Size, Book to Market Ratio, Price Earning Ratio, dan Momentum terhadap Return Portofolio Saham. Skripsi. Universitas Diponegoro.
- Diastuti, Mey Ria. 2014. Pengaruh risiko pasar, Firm size, Book to Market Ratio dan Momentum terhadap Return saham (studi pada perusahaan LQ45 di BEI). Skripsi. Universitas Negeri Malang.
- Dimitriou dan Simos. 2011. The relationship between stock returns and Volatility the seventeen Largest Internasional stock market: A semi Parametric Approach. *Modern Economy*. (<http://www.SciRP.org/journal/me>).

- Fama, E.F. 1970. Efficient Capital Market: A review of theory and empirical work. *Journal of Finance*, vol 25 p. 383-417.
- Fama, E.F. 1992. Efficient Capital Market II. *Journal of Finance*, vol 46, pp 573-617.
- Fitriati, Ika Rosyada. 2010. Analisis Hubungan Distress Risk, Firm Size, dan Book to Market Ratio dengan Return Saham (pada perusahaan Manufaktur yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode Tahun 2005-2008). Skripsi. Universitas Diponegoro.
- Gabriel, et al. A Four-Factor Performance Attribution Model fo Equity Potfolios.
- Ghozali, Imam. 2006. *Analisis Multivariate dengan program SPSS*. Edisi ke 4. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Horowitz, Loughran, Savin. 2000. Three analysis of the firm size. Working papers the University of Iowa.
- Hugida, Lydianita. 2011. Analisis faktor-faktor yang mempengaruhi Volatilitas Harga Saham (Studi pada perusahaan yang terdaftar dalam Indeks LQ45 Periode 2006-2009). Skripsi. Universitas Diponegoro.
- Irawan dan Werner. Analisis Pengaruh Three Factor Model dan Persentase Kepemilikan Asing Terhadap Tingkat Return di Bursa Efek Indonesia.
- Jogiyanto. 2000. *Teori Portfolio dan Analisis Investasi*. Edisi Kedua. Yogyakarta: BPF.
- Karlina, Indriani, dkk. 2013. Capital flows di Indonesia: Perilaku, peran, dan optimalitas penggunaannya bagi perekonomian. *Buletin Ekonomi Moneter dan perbankan*, Januari 2013.
- Listiana, Nourma. 2011. Likuiditas pasar saham dan Asimetri informasi di seputar pengumuman laba triwulan. Skripsi. Universitas Diponegoro.
- Manurung, A.H. 1997. Portofolio Bursa Efek Jakarta (Kapitalisasi besar, kecil, dan campuran). *Jurnal Manajemen dan Usahawan* No. 12 th XXVI.
- Maulina dan Syafi'I. 2012. Informasi Asimetri dan Periode Menahan Kepemilikan Saham LQ45 di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal aplikasi manajemen* Volume 10 nomor 4. Desember 2012.
- Murdiati dan Khusfatun. 2011. Studi Komparatif harga, Likuiditas, dan risiko saham sebelum dan sesudah perusahaan melakukan Stock split dan Reverse Split di Bursa Efek Indonesia tahun 2004-2009. *Jurnal riset Manajemen Sains Indonesia (JRMSI)*-Vol. 2, No. 1, Tahun 2011.

- Prasetyo, Hari. 2006. Analisis pengaruh hari perdagangan terhadap return, abnormal return, dan volatilitas return saham (Studi pada LQ45 periode januari-desember 2005). Tesis. Universitas Diponegoro.
- Pudyastuti, Enny. 2000. Analisis pengaruh Return Pasar, Tingkat Inflasi, Tingkat suku bunga deposito terhadap Return Saham individu pada Industri Dasar & Kimia yang terdaftar di BEJ periode 1997-1999. Tesis. Universitas Diponegoro.
- Purwanto, Agus, 2004. Pengaruh Harga Saham, Volume Perdagangan, dan Varian Return Terhadap Bid-ask Spread pada masa sebelum dan sesudah Right Issue di Bursa Efek Jakarta Periode 2000-2002. *Jurnal Akuntansi & Auditing Volume 01/No. 01/Nopember 2004*. Universitas Diponegoro.
- Sandrasari, Wiedya Tri, 2010. Analisis Pengaruh Volume Perdagangan, Frekuensi Perdagangan, dan Order Imbalance Terhadap Volatilitas Harga saham pada perusahaan Go Public di Bursa Efek Indonesia. Skripsi. Universitas Sebelas Maret.
- Simatupang, Mangasa. 2010. *Pengrtahuan Praktis Investasi Saham dan Reksadana*. Jakarta: Penerbit Mitra Wacana Media.
- Sularso, R. Andi. 2003. Pengaruh Pengumuman Dividen terhadap Perubahan Harga Saham (Return) sebelum dan sesudah ex-Dividen Date di Bursa Efek Jakarta (BEJ). *Jurnal Akuntansi & Keuangan* Vol. 5, No.1, Mei 2003: 1-17. Universitas Kristen Petra.
- Sumani, Christine Suhari. 2013. Analisis pengaruh risiko sistematis dan likuiditas terhadap tingkat pengembalian saham dalam perusahaan non-keuangan LQ-45 periode 2007-2009. Volume 17, Nomor 1, Januari 2013.
- Suseno, Yustiantomo Budi. 2009. Analisis faktor-faktor yang mempengaruhi beta saham (studi kasus perbandingan perusahaan Finance dan Manufaktur Yang Listing di BEI pada tahun 2005-2007). Tesis. Universitas Diponegoro.
- Xiao, *et al.* 2012. An Empirical Study on the Relationship between Turnover Rate and Stock Returns in Chinese Stock Market. *Advances in Information Technology and Management (AITM)* Vol. 2, No. 1, 2012, ISSN 2167-6372.

www.IDX.co.id

IDX Fact book 2012

Indonesia Capital Market Directory (ICMD)