

DAFTAR PUSTAKA

- Abraham, Abraham and Ikenberry, David. L, 1994, "*The Individual Investor and The Weekend Effect*", **Journal of Financial and Quantitative Analysis**, Vol. 29
- Ang, R, 1997, **Buku Pintar Pasar Modal Indonesia**, Mediasoft, Jakarta.
- Aruzzi, M. Iqbal dan Bandi, 2003, "Pengaruh Tingkat Suku Bunga, Rasio Profitabilitas, dan Beta Akuntansi Terhadap Beta Saham Syariah Di Bursa Efek Jakarta", **Proceeding Simposium Nasional Akuntansi**, VI, Surabaya
- Bachri, Syamsul, 1997, "Profitabilitas Dan Nilai Pasar Terhadap Perubahan Harga Saham Pada Perusahaan Go Public Di BEJ", **Jurnal Persepsi edisi khusus** Vol. 1
- Barker, Richard G, 1999, "*Survey and Market-based Evidence of Industry Dependence in Analysis Preferences Between The Dividend Yield and Price Earning Ratio valuation Models*", **Journal of Business Finance and Accounting**, 26(3) & (4), pp. 393 -416
- Budi, I.S dan Nurhatmini E, 2003, "Pengaruh Hari Perdagangan dan *Exchange Rate* terhadap *Return* Saham di Bursa Efek Jakarta", **Jurnal Manajemen & Bisnis**, Vol. 5, No. 1, Januari, hal. 47-62
- Budileksmana, Antariksa dan Gunawan, Barbara, 2003, "Pengaruh Indikator Rasio Keuangan Perusahaan *Price Earning Ratio* (PER) dan *Price toBook Value* (PBV) terhadap *Return* Saham di Bursa Efek Jakarta", **Jurnal Akuntansi dan Investasi**, Vol. 4, No. 2
- Cheng F. Lee., Gong Meng Chen and Oliver M Rui, 2001, "*Stock returns and Volatility on China's Stock Market*", **The Journal of Finance**, Vol. 24, pp. 523-543
- Chordia, Tarun and Bhaskaran, 2000, "*Trading Volume And Cross Auto Correlations In Stock Returns*", **The Journal of Finance**, Vol. IV
- Clara E.S., 2001, "**Analisis Kinerja Keuangan Perusahaan Yang Go Public Di Bursa Efek Jakarta : Studi Kasus Industri Tekstil Dan Garmen**", Tesis Magister Manajemen Universitas Diponegoro (tidak dipublikasikan)

- Claude et al., 1996, “*Political Risk, Economic Risk, and Financial Risk*”, **Financial Analysis Journal**, Nov-Dec, pp. 29-45
- Cox, Don R dan David Peterson, 1994, ”*Stock Return Following Large One Day Declines : Evidence on Short-Term Reversals and Longer-Term Performance*”, **The Journal of Finance**, March, Vol. XLII, No. 1, pp. 255-267
- French, Kenneth R, 1980, “*Stock Return and Weekend Effect*”, **Journal of Financial Economic**, No. 1
- Ghozali, Imam, 2001, **Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS**, edisi kedua, BP Undip, Semarang
- Gibbon, M and P. Hess, 1981, “*Day of The Week Effects and Asset Returns*”, **Journal of Bussiness**, Vol. 54, pp. 579-596
- Gibson, Charles H, 1992, **Financial Analysis**, Cincinnati, Ohio: South-Western Publishing Co.
- Gujarati, Damodar, 1995, **Ekonometrika Dasar**, Penerbit Erlangga, Jakarta
- Hardiningsih, Pancawati., Suryanto., Chariri, A, 2002, “Pengaruh Faktor Fundamental dan Resiko Ekonomi terhadap *Return* Saham pada Perusahaan di Bursa Efek Jakarta: Studi Kasus Basic Industry & Chemical”, **Jurnal Strategi Bisnis**, Vol, 8, Des. Tahun VI.
- Hendarsanto, Prastato, 2005, **Analisis Pengaruh MVA, Debt to Equity, Trading Day, Trading Volume, dan ROA Terhadap Return Saham pada Perusahaan Real Estate dan Properti di Bursa Efek Jakarta (Periode 1999-2003)**, Tesis Program Pasca Sarjana Magister Manajemen Universitas Diponegoro (tidak dipublikasikan)
- Husain, Fazal, 1998, ” A Seasonality in the Pakistani Equity Market : The Ramadhan Effect”, **The Pakistan Development Review**, Vol. 37, No. 1, pp. 77-81
- Husnan, Suad, 1998, **Dasar-dasar Teori Portfolio dan Analisis Sekuritas**, UPP AMP.YKPN
- Husnan, Suad, 1992, **Manajemen Keuangan Teori dan Penerapan (Keputusan Jangka Panjang)**, BPFE, Yogyakarta

- Jogiyanto H.M, 2000, **Teori Portfolio dan Analisa Investasi**, BPFE: Yogyakarta, Edisi 2
- Kertonegoro, Sentanoe, 1995, **Analisa dan Manajemen Investasi**. Jakarta: PT Widya Press Jakarta
- Liestyowati, 2002, “Faktor yang Mempengaruhi Keuntungan Saham di Bursa Efek Jakarta : Analisis Periode Sebelum dan Selama Krisis”, **Jurnal Manajemen Indonesia**, Vol, 1, No, 2.
- Marpaung, Elyzabeth Indrawati, 2003, “Perubahan Dividend Yield dan Perubahan Price Earning Ratio Berpengaruh Terhadap Perubahan Harga Saham”, **Jurnal Ilmiah Akuntansi**, Vol. 3, No. 1
- Mondigliani and Miller, 1958, “The Cost of Capital, Corporation Finance and The Theory of Investment”, **American Economic Review**, Vol. 47, p. 261-297
- Mustafa, Khalid and Nishat, Muhammad, 2002, “*Trading Volume and Serial Correlation in Stock Returns in Pakistan*”, www.pide.org.pk, 31 Desember 2007
- Nassir, A. Md., dan Shamsheer, M., 1996, “**Stock Pricing in Malaysia**”, Longman Singapore Publisher Ltd., Singapore
- Natarysyah, Syahib, 2000, “Analisis Pengaruh Beberapa Faktor Fundamental dan Risiko Sistematis terhadap Harga Saham (Kasus Industri Barang Konsumsi ang *Go Public* di Pasar Modal Indonesia)”, **Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia**, Vol. 15, No. 3
- Nusantara, Agung, 2004, “Pasar Modal Islami antara Harapan dan Kenyataan”, **Fokus Ekonomi**, Vol. 3, No. 2
- Prasetio, J.E dan Sutoyo, 2003, “Analisis Pengaruh Interaksi Laba Akuntansi dengan Arus Kas terhadap Harga Saham dan Volume Perdagangan Saham”, **Jurnal Manajemen & Bisnis**, Vol, 5, No, 3, September, hal, 239-252.
- Ronny, Sautma dan Basana, 1997, “Penggunaan PER Ekonometrika Dalam Penilaian Harga Saham (Kasus Harga Saham Perbankan *Go Public* di BEJ 1994-1995)”, **Ventura**, Vol. 1, No. 1

- Ratnasari, 2003, **Analisis Pengaruh Faktor Fundamental, Volume Perdagangan dan Nilai Kapitalisasi Pasar terhadap Return Saham di BEJ (Studi Kasus pada Perusahaan Manufaktur dan Perbankan)**, Tesis Program Pasca Sarjana Magister Manajemen Universitas Diponegoro (tidak dipublikasikan)
- Robiyanto, 2000, "Pengaruh Hari Perdagangan Saham Terhadap *Return* Harian Saham Di Bursa Efek Jakarta (Sebuah Studi Terhadap IHSG, Indeks Saham Sektorial dan Indeks Saham Unggulan (LQ45))", **Jurnal Bisnis Strategi**, Vol. 5, Th. III
- Rystrom, D. S and Earl, D. Benson, 1989, "*Investor Psychology and The Day of-The Week Effect*", **Financial Analysts Journal**, Vol. 45
- Santoso, Singgih, 1998, "Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham Sektor Manufaktur di Bursa Efek Jakarta", **Jurnal Bisnis dan Ekonomi**, Edisi 4, Th. III
- Sartono, Agus dan Munir, Mishabul, 1997, "Pengaruh Kategori Industri Terhadap *Price Earning Ratio* dan Faktor-faktor Penentunya **Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia**, Vol. 12, No. 3, hal. 83-98
- Sparta, 2000, "Pengaruh Faktor-faktor Fundamental Lembaga Keuangan Bank terhadap harga Sahamnya di Bursa Efek Jakarta", **Jurnal Akuntansi**, FE Untar, Th. IV
- Susilowati, Yeye, 2003, "Pengaruh *Price Earnings Ratio* (PER) terhadap Faktor Fundamental Perusahaan (*Dividend Payout Ratio*, *Earnings per Share*, dan Resiko) pada Perusahaan Publik di Bursa Efek Jakarta", **Jurnal Bisnis dan Ekonomi**, Vol, 10, No, 1, Maret, hal. 51-66.
- Tandelilin, Eduardus, 1999, "Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap *Return* Saham Di Bursa Efek Jakarta", **Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia**, Vol. 14, No. 4, Hal. 111-123
- Trisnawati, Rina, 1999, "Pengaruh Prospektus pada *Return* Saham Pasar Modal", **Simposium Nasional Akuntansi II**, Departemen Akuntan Pendidik, September, Hal. 1-13
- Weton and Copeland, 1995, **Manajemen Keuangan**, Binarupa Aksara, Jakarta
- Zulhawati, 2000, "Aktivitas Volume Perdagangan di Pasar Modal Indonesia Tahun Laporan Keuangan 1996", **KOMPAK**, No, 22, Januari, hal. 505-520.

-----, 2004, *Indonesian Capital Market Directory*

-----, 2005, *Indonesian Capital Market Directory*

-----, 2006, *Indonesian Capital Market Directory*

-----, (<http://www.jsx.co.id>)

-----, 2004, *JSX Statistic 1st – 4th Quarter*

-----, 2005, *JSX Statistic 1st – 4th Quarter*

-----, 2006, *JSX Statistic 1st – 4th Quarter*