

DAFTAR PUSTAKA

- Agus Sartono dan Sri Zulaihati, 1998, Rasionalitas Investor Terhadap Pemilihan Saham dan Penentuan Portofolio Optimal dengan Model Indeks Tunggal di BEJ, *Kelola*, No. 17/VII
- Andreas N, 2004, Analisis Pengukuran Portofolio Optimal Saham LQ-45 di BEJ, *Tesis* (tidak dipublikasikan), Magister Manajemen Universitas Diponegoro, Semarang.
- Ang, Robert, 1997, *The Intelligent Guide To Indonesian Capital Market*, Edisi 1, Mediasoft Indonesia, Jakarta.
- Anindya Ardiansyah, 2007, Analisis Pengaruh Pengumuman Annual Report Award pada Good Corporate Governance Terhadap Trading Volume Activity dan Abnormal Return: Studi Kasus Pada Perusahaan yang Listing di Bursa Efek Jakarta, *Tesis* (tidak dipublikasikan), Magister Manajemen Universitas Diponegoro, Semarang.
- Anwar Nasution, 2008, *Krisis Keuangan Global dan Indonesia*, Makalah Kuliah Umum Program Pasca Sarjana UNDIP Semarang.
- Arif Budiarto dan Zaki Baridwan, 1999, Pengaruh pengumuman Right Issue terhadap tingkat keuntungan dan likuiditas saham periode 1994-1996, *Jurnal Riset Akuntansi Indonesia*, Vol.2 No.1, Januari.
- Bishara, Halim I, 1998, Stock Splits, Stock Returns and Trading Benefits on Canadian Stock Market's, *Akron Business and Economic Review*, Hal. 57-65
- Budi Wibowo, 2004, Analisis dampak Informasi Antar-hari serta Pola Antar-hari Return dan Volatilitas Saham-saham Dual Listing di Bursa Efek Jakarta (BEJ) dan NYSE, *Usahawan*, Januari.
- Chalimah, 1997, Pengaruh Informasi Laporan Keuangan Yang dipublikasikan Terhadap Fluktuasi Harga Saham, *Jurnal Bisnis Strategi*, Vol. 1 Tahun I
- Dekiawan, Hermada dan Jaya, Wihana. K, 1999, Price Fluctuation in Bank Shares: A Backward and Forward Looking Approach, *Gajah Mada International Journal and Business*, Vol.I No.1, May, p.107-120.
- Elton. E.J dan M. Gruber, 1995, *Modern Portfolio Theory and Investment Analysis*, Ed.5, John Willy and Sons Inc, Toronto.

- Fama F. Eugene, 1991, Efficient Capital Market II, *Journal of Finance*, Vol. XLVI No. 5, December.
- Hadiahti Utami, 2008, Analisis Pengaruh Faktor Fundamental Mikro dan Kondisi Ekonomi Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Manufaktur Yang Listed Di Bursa Efek Jakarta dengan Metode Intervaling Periode 2003-2006, *Tesis* (tidak dipublikasikan), Magister Manajemen Universitas Diponegoro, Semarang.
- Hastuti W. Ambar dan Sudiby, Bambang, 1998, “Pengaruh Publikasi-publikasi Laporan Arus Kas Terhadap Volume Perdagangan Saham Perusahaan di BEJ”, *Jurnal Riset Akuntansi Indonesia*, Vol. 1, No.2.
- Hendy, M Fakhruddin, 2008, *Istilah Pasar Modal A-Z*, Elex Media Komputindo, Jakarta.
- Imam Ghazali, 2007, *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS*, Badan Penerbit Universitas Diponegoro, Semarang.
- Jogiyanto Hartono, 2008, *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, BPFE-Yogyakarta, Edisi Kelima, Yogyakarta.
- Jogiyanto Hartono, 2005, *Pasar Efisien secara Keputusan*, PT Gramedia Pustaka Utama, Jakarta.
- Mackinlay, A. Craig, 1997, Event Studies in Economics and Finance, *Journal of Economic Literature*, Vol.XXXV (March), p.13-39.
- Manullang, Timbul L.A, 2004, Analisis Reaksi Harga Saham di Bursa Efek Jakarta Terhadap Peristiwa Politik dan Ekonomi, *Draft Disertasi*, Universitas Persada Indonesia YAI.
- Marwan Asri Suryawijaya dan Faizal Arief Setiawan, 1998, Reaksi Pasar Modal Indonesia Terhadap Peristiwa Politik dalam Negeri (Event Study pada Peristiwa 27 Juli 1996), *Kelola*, No. 18/VII.
- Mochamad Zaqi 2006, Reaksi Pasar Modal Indonesia Terhadap Peristiwa-Peristiwa Ekonomi dan Peristiwa-peristiwa Sosial-Politik Dalam Negeri (Studi Kasus Saham LQ-45 di Bursa Efek Jakarta Periode 1999-2003), *Tesis* (tidak dipublikasikan), Magister Manajemen Universitas Diponegoro, Semarang.
- Mudrajad Kuntoro, 2001, *Metode Kuantitatif (Teori dan Aplikasi untuk Bisnis dan Ekonomi)*, Unit dan Percetakan AMP YKPN, Yogyakarta.

- Muhammad Fendi Susiyanto, 1999, "The Impact of Bank Restructuring Announcements on The Banking Stock Prices: The Cases of Indonesia's Bonds on May 28, 1999", *Gajah Mada International Journal of Business*, Vol.I No.2, p.37-61.
- Neni Meidawati dan Mahendra Harimawan, 2004, Pengaruh Pemilihan Umum Legislatif Indonesia Tahun 2004 Terhadap Return Saham dan Volume Perdagangan Saham LQ-45 di PT. Bursa Efek Jakarta (BEJ). *Sinergi Kajian Bisnis dan Manajemen*, Vol. 7, No. 1, hal. 89-101
- Peterson, Pamela. P, 1998, Event Studies: A Review of Issues and Methodology, Quarterly, *Journal of Business and Economics*, Vol.28, No.3, Summer.
- Prasetiono, 2000, Pengaruh Pengumuman Dividen Terhadap Abnormal Return Saham di BEJ: Study Tentang Efisiensi BEJ tahun 1997' *Media Ekonomi dan Bisnis*, Vol. XII No.1, Juni.
- Treisy Arience Lamasigi, 2002, Reaksi Pasar Modal Terhadap Peristiwa Pergantian Presiden Republik Indonesia 23 Juli 2001: Kajian Terhadap Return Saham LQ-45 di PT. Bursa efek Jakarta, *Simposium Nasional Akuntansi IV*, 5-6 September, Semarang.
- Tri Adi Setyawan, 2006, Analisis Reaksi Pasar Modal Terhadap Kenaikan Harga BBM (Studi Kasus Di Bursa Efek Jakarta untuk Saham-Saham LQ-45), *Tesis* (tidak dipublikasikan), Magister Manajemen Universitas Diponegoro, Semarang.
- Rina Rachmawati, 2005, Pengaruh Hari Libur Tahun Baru dan Libur Lebaran terhadap *abnormal return* pada perusahaan sektor industry barang konsumsi (Studi Kasus Di Bursa Efek Jakarta Kurun Waktu Tahun 1998-2003 Periode Setelah Krisis Moneter), *Tesis* (tidak dipublikasikan), Magister Manajemen Universitas Diponegoro, Semarang.
- Rini Mahgianti, 2001, Perilaku Harga dan Volume Perdagangan: Studi Peristiwa Dampak Penundaan Pencairan Bantuan IMF pada Saham Dominasi Asing dengan Pendekatan Koreksi Beta, *Simposium Nasional Akuntansi IV*, Surabaya.
- Sant, Rajiv dan Ferris, Stephen, 1994, Seasoned Equity Offering: The Cases of All Equity Firm, *Journal of Business Finance and Accounting (JBFA)*, 21 (3), April, p.429-444.
- Sri Fatmawati dan Marwan Asri, 1999, Pengaruh Stock Split Terhadap Liquiditas Saham yang diukur dengan Besarnya Bid Ask Spread di Bursa Efek Jakarta, *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia*, Vol. 14, No. 4, Hal. 93-110

Suad Husnan, Mamduh M dan Amin Wibowo, 1996, Dampak Pengumuman Laporan Keuangan Terhadap Kegiatan Perdagangan Saham dan Variabilitas Tingkat Keuntungan, *Kelola* Vol. V No. 11, Universitas Gajah Mada, Yogyakarta.

Tarun Chordia and Bhaskaran, 2000, Trading Volume and Cross Autocorrelation In Stock Return, *The Journal of Finance*, vol .4

Harian Jawa Pos, 8 Oktober 2008.

www.idx.co.id, Daftar Saham Perusahaan Tercatat yang Masuk Dalam Penghitungan Indeks LQ-45 Periode Agustus 2007 s/d Januari 2008

www.idx.co.id, Daftar Saham Perusahaan Tercatat yang Masuk Dalam Penghitungan Indeks LQ-45 Periode Februari 2008 s/d Juli 2008

www.idx.co.id, Daftar Saham Perusahaan Tercatat yang Masuk Dalam Penghitungan Indeks LQ-45 Periode Agustus 2008 s/d Januari 2009