

DAFTAR PUSTAKA

- Adams, Greg., McQueen, Grant and Wood, Robert, 2004, “*The Effects of Inflation News on High Frequency Stock Returns*”, **The Journal of Business**, Jul 2004, pp. 547-574
- Adhitama, W., Sudaryono, E.A, 2005, “Faktor-Faktor yang Mempengaruhi *Price Earning Ratio* pada Perusahaan Perbankan yang Terdaftar di Bursa Efek Jakarta”, **Jurnal Bisnis & Manajemen**, Vol, 5, No, 2, hal, 211-222.
- Almalia, Luciana Spica, 2004, “Analisis Faktor-faktor yang Mempengaruhi Kondisi Financial Distress Suatu Perusahaan yang Terdaftar di Bursa Efek Jakarta”, **Simposium Nasional Akuntansi**, Ke-VI, Hal. 546-564
- Ang, R, 1997, **Buku Pintar Pasar Modal Indonesia**, Mediasoft, Jakarta
- Beaver, W; Kettler P and Scholes. M, 1970, “ The Association Between Market Determined and Accounting Determined Risk Measures”, **The Accounting Review**, October, pp. 654-682
- Boediono, 1991, Seri Sinopsis Pengantar Ilmu Ekonomi No.2: **Ekonomi Makro**, Edisi Kesepuluh, BPFE Yogyakarta, Yogyakarta
- Budi, Ichsan Setiyo dan Nurhatmini, Erni, 2003, “Pengaruh Hari Perdagangan dan *Exchange Rate* terhadap *Return Saham* di Bursa Efek Jakarta”, **Jurnal Manajemen dan Bisnis**, Vol. 5, No 1
- Chan, K.C and Chen, Nai-Fu, 1991, “*Structural and Return Characteristics of Small and Large Firms*”, **The Journal of Finance**, Vol. XLVI, No. 4, p.1467-1484
- Chan, L.K.C, Hamao, Y dan Lakonishok, J, 1991, “Fundamentals and Stock Return in Japan”, **Journal of Finance**, 1739-1764
- Cinca, C Serrano; Mollinero, C. Mar; Larraz, J L Gallizo, 2005, “Country and Size Effects in Financial Ratios: a European Perspective”, **Global Finance Journal**, Vol. 16, Iss: 1, P. 26
- Daniati, Ninna dan Suhairi, 2006, “Pengaruh Kandungan Informasi Komponen Laporan Arus Kas, Laba Kotor, dan Size Perusahaan Terhadap Expected Return Saham (Survey Pada Industri Textile dan Automotive yang Terdaftar Di BEJ)”, **Simposium Nasional Akuntansi 9 Padang**

- Elfakhani, Said; Lockwood, Larry. J; Zaher, Tarek S, 1998, “Small Firm and Value Effects in the Canadian Stock Market”, **Journal of Financial Research**, Vol. 21, Iss: 3. pp 277-291
- Ghozali, Imam, 2001, **Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS**, edisi kedua, BP Undip, Semarang
- Gudono, 1999, “Penilaian Pasar Modal terhadap Fluktuasi Bisnis Real-Estate”. **Kelola** No. 20/ VIII/ 1999.
- Hardiningsih, Pancawati., Suryanto, L dan Chariri, Anis, 2002, “Pengaruh Faktor Fundamental Dan Risiko Ekonomi Terhadap *Return* Saham Pada Perusahaan Di Bursa Efek Jakarta Studi Kasus *Basic Industry* dan *Chemical*”, **Jurnal Strategi Bisnis**, Vol. 8
- Harianto, Farid dan Siswanto Sudomo, 1998, **Perangkat dan Tehnik Analisis Investasi**, PT. Bursa Efek Jakarta, Edisi pertama, Jakarta
- Isnowati, Sri, 2002, “Analisis Faktor-faktor yang Mempengaruhi Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dollar Amerika: Pendekatan Moneter 1987.2 - 1999.1”, **Jurnal Bisnis dan Ekonomi**, Maret
- Maski, Ghozali dan Widyastuti, Yulreni Endah, 2003, “Efektivitas Kebijakan Suku Bunga Dalam Mencapai Keseimbangan Nilai Tukar”, **Tema**, Vol. IV, No. 1
- Natarsyah, Syahid 2000, “Analisis Pengaruh Beberapa Faktor Fundamental dan Risiko Sistematis terhadap Harga Saham”, **Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia**, Vol. 15, No. 3, p.294-31
- Nopirin, 2000, **Ekonomi Moneter**, Edisi Pertama, BPFE Yogyakarta, Yogyakarta
- Panjaitan, Yunia., Dewinta, Oky dan Desinta K, Sri, 2004, ”Analisis Harga Saham, Ukuran Perusahaan, dan Risiko Terhadap *Return* yang Diharapkan Investor Pada Perusahaan-Perusahaan Saham Aktif”, **Balance**, Vol. 1, pp. 56-72
- Prasetya, T, 2000, “Analisa Rasio Keuangan dan Nilai Kapitalisasi Pasar sebagai Prediksi Harga Saham di BEJ pada Periode Bullish dan Bearish”, **Simposium Nasional Akuntansi III**.

- 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).
- Sulimin, 2004, **Pengaruh Debt to Equity Ratio, Price to Earning Ratio, Net Profit Margin, dan Dividend Payout Ratio terhadap Return Saham (Studi Kasus pada Saham-Saham Perusahaan Sektor Industri Manufaktur di Bursa Efek Jakarta)**, Tesis Program Pasca Sarjana Magister Manajemen Universitas Diponegoro (tidak dipublikasikan).
- Sunariyah, 2000, **Pengantar Pengetahuan Pasar Modal**, UPP AMP YKPN, Yogyakarta
- Tandelin, Eduardus, 1997, "*Determinant of Systematic Risk, The Experience of Some Indonesian Common Stock*", **Kelola: Gajah Mada University Business Riview**, No. 16/IV
- 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
- Tauhid, Ahmad, 2002, "Dinamika Nilai Tukar dan Inflasi serta Dampaknya terhadap Kestabilan Moneter", **TEMA**, Vol. III, No. 1.
- Ulupui. (2005). Analisis Pengaruh Rasio Likuiditas, Leverage, Aktivitas, Dan Profitabilitas Terhadap Return Saham (Studi Pada Perusahaan Makanan Dan Minuman Dengan Kategori Industri Barang Konsumsi Di BEJ), **Jurnal Fakultas Ekonomi Universitas Udayana**, jurnal, dalam wibesite
- Utami, M dan Rahayu M., 2003, "Peranan Profitabilitas, Suku Bunga, Inflasi dan Nilai Tukar Dalam Mempengaruhi Pasar Modal Indonesia Selama Krisis Ekonomi", **Jurnal Manajemen dan Kewirausahaan**, Vol. 5, No. 2
- Wahyudi, Sugeng, 2003. "Pengaruh Rasio Harga Nilai Buku dan Rasio Hutang Modal Sendiri terhadap Return", **Media Ekonomi dan Bisnis**, Vol. XV, No. 2, Desember. FE-Undip, Semarang
- Zulhawati, 2000, "Aktivitas Volume Perdagangan di Pasar Modal Indonesia Tahun Laporan Keuangan 1996", **KOMPAK**, No. 22, Januari, hal. 505-520.