

DAFTAR PUSTAKA

- Ashraf, Cherie, 2005, *Pengaruh Resiko Sistematis, Bid-Ask Spread, Volume Perdagangan terhadap Return Saham*, Universitas Indonusa Esa Unggul.
- Asnawi, Said Kelana dan Chandra, 2006, *Metodologi Penelitian Keuangan: Prosedur, Ide dan Kontrol*, edisi pertama, Graha Ilmu, Yogyakarta.
- Arifin, Ali, 2004, *Membaca Saham: Panduan Dasar Seni Berinvestasi dan Teori Permainan Saham*, edisi kedua, Andi Offset Yogyakarta.
- Basir, Saleh dan Hendy, 2005, *Aksi Korporasi*, Salemba Empat.
- Brigham, Weston, 1993, *Dasar-Dasar Manajemen Keuangan*, Erlangga, Jakarta
- Copeland, TE and JF, Weston, 1994, *Managerial Finance*, McGraw Hill
- Darmadji, Tjiptono dan Hendy, 2006, *Pasar Modal Indonesia: Pendekatan Tanya Jawab*, Edisi kedua, Salemba Empat.
- Dewiyani, Leola, 2006, *Pengaruh Beta, Size, Market to Book Value, PER terhadap Expected Return Saham di Bursa Efek Jakarta*. Tesis Magister Manajemen, Universitas Indonesia, Jakarta.
- Elton, E.J, Gruber, M.J, 2003, *Modern Portfolio Theory and Investment Analysis*, Sixth Edition, John Wiley and Sons, Inc, p. 131-132.
- Frino, Alex, Jarnecic and Lepone, A, 2007, *The Determinants of the Price Impact of Block Trades*, ABACUS, Vol. 43, No 1, 2007, Journal Compilation, Accountng Foundation :University of Sydney
- Halim, Abdul, 2003, *Analisis Investasi*, Edisi Pertama, Salemba Empat, Jakarta.
- Husnan, Suad, 2001, *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*, Edisi Ketiga, UPP-AMP YKPN, Yogyakarta.
- Gujarati, Damodar N, 2003, *Basic Econometrics*. McGraw-Hill, New York, USA.
- Indonesian Capital Market Directory, 2002-2006, Bursa Efek Jakarta.
- Jakarta Stock Exchange, Inc., *JSX Monthly Statistic Tahun 2004-2006*.

- Jauhari, B.R dan Wibowo, B, 2007, *Analisis Fundamental terhadap Return Saham pada Periode Bullish dan Bearish IHSG*, www.skripsi-tesis.com, 22 Januari 2008.
- Jogiyanto, 2003, *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, edisi ketiga, BPEF Yogyakarta.
- Jones, Charles P, 2004, *Investments: Analysis and Management*, eight edition, John Wiley & Sons, Inc.
- Jorion, P, 2003, *Financial Risk Manager Handbook*, John Wiley & Sons, Inc., New Jersey, p. 327-331.
- Karim. Kornelius Edita, 2004, *Analisa Faktor-Faktor Eksternal Emite yang Mempengaruhi IHSG di BEJ*, Universitas Indonusa Esa Unggul.
- Koetin, E.A, 1997, *Analisis Pasar Modal Indonesia*, Pustaka Sinar Harapan, Jakarta.
- Krinsky, dan Jason Lee, 1996, *Earning Announcements and the Components of the Bid-Ask Spread*, The Journal of Finance, Vol. LI No 4, September
- Manurung, Adler Haymans, 2006, *Cara Menilai Perusahaan*, cetakan pertama, PT. Elex Media Komputindo.
- Manurung, Adler Haymans, 2006, *Strategi: Memenangkan Transaksi Saham di Bursa*, cetakan kedua, PT. Elex Media Komputindo.
- Mubarak, Zaki, 2002, *Perubahan Bid-Ask Spread dan Analisis Faktor yang Mempengaruhinya Disekitar Pengumuman Laba (Studi Empiris pada LQ 45)*, Tesis Magister Akuntansi, Universitas Diponegoro, Semarang.
- Nachrowi, Nachrowi Djalal, 2006, *Pendekatan Populer dan Praktis Ekonometrika untuk Analisis Ekonomi dan Keuangan*, Lembaga Penerbit FE UI.
- Nasution, Mustafa Edwin dan Usman, Hardius, 2007, *Proses Penelitian Kuantitatif*, Lembaga Penerbit FE UI.
- Pass, Christopher and Lowes, Bryan, 1994, *Kamus Lengkap Ekonomi*, Edisi Kedua, Erlangga (Judul Asli: *Dictionary of Economics*, HarperCollins Publishing Ltd, 1988)
- Pramesti, Ika Yuniati, 2006, *Pengaruh Kinerja Keuangan dan Ukuran Perusahaan terhadap Return Saham pada Perusahaan Industri*

- Manufaktur di BEJ*, Tesis Magister Manajemen Universitas Airlangga, Sumatera Barat.
- Prasetiowati, Rr, 2002, *Return Pasar Saham dan Kebijakan Moneter*, Tesis Magister Manajemen, Universitas Indonesia, Jakarta.
- 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 & Audit, Vol. 01 N0. 01, November.
- Ross, Westerfield, 2002, *Corporate Finance*, International Edition, MC.Graw Hill Comp, Inc, New York.
- Santoso, Purbayu Budi, 2005, *Analisis Statistik dengan Microsoft Excel dan SPSS*, Penerbit Andi Offset.
- Sarwoko, 2005, *Dasar-Dasar Ekonometrika*, Andi Offset Yogyakarta.
- Sharpe, William, 1963, *A Simplified Model for Portofolio Analysis*, Management Science.
- Siegel, Joel, Jae, and Stephen, 2006, *Kamus Bisnis*, Canary (Judul Asli: *Business Formulas: 201 Decision Making Tools for Business Finance and Accounting Students*, MC.Graw Hill Comp, Inc, 1998).
- Singgih, Santoso, 2003, *SPSS Versi 10 Mengolah Data Statistik secara Profesional*, PT. Elex Media Komputindo, Jakarta.
- Subekti, Surono, 2006, *Kiat Bermain Saham*, PT. Gramedia Pustaka Utama.
- Sugiyono, 2001, *Metode Penelitian Bisnis*, Penerbit Alfabeta, Bandung.
- Sulistyastuti, Dyah Ratih, 2002, *Saham dan Obligasi: Ringkasan Teori dan Soal Jawab*, Andi Offset Yogyakarta.
- Tambunan, Andy Porman, 2007, *Menilai Harga Wajar Saham (Stock Valuation)*, Edisi Kedua, PT, Elex Media Komputindo.
- Tandelilin, Eduardus, 2001, *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*, edisi pertama, PT BPFE Yogyakarta.
- Tunggal, Amin Widjaja dan Miranda, 2005, *A to Z Manajemen Keuangan*, Harvarindo
- Umar, Husein, 2002, *Metode Riset Bisnis*, PT Gramedia Pustaka Utama.

Watts and Zimmerman, 1978, *Toward a Positive Theory of the Determination of Accounting Standards*.

www.bi.go.id, Website Bank Indonesia, Oktober, 2007

www.bps.go.id, Website Biro Pusat Statistik Indonesia, Juli, 2007

www.jsx.co.id, Website Jakarta Stock Exchange, Juli 2007

Yuliati, Anik, 2002, *Analisis Pengaruh Beberapa Faktor Fundamental terhadap Harga Saham Perusahaan Rokok di BEJ*, Jurnal Penelitian Ilmu Ekonomi