

DAFTAR PUSTAKA

- Afriyadi, Achmad Dwi. 2016. *BEI dan OJK Sepakat Soal Perubahan Fraksi Harga Saham*. <http://bisnis.liputan6.com/read/2469192/bei-dan-ojk-sepakat-soal-perubahan-fraksi-harga-saham>, diakses tanggal 3 Oktober 2016.
- Ambarwati, Sri Dewi Ari. 2008. Pengaruh Return Saham, Volume Perdagangan Saham, dan Varians Return Saham terhadap Bid-Ask Spread Saham pada Perusahaan Manufaktur yang Tergabung dalam Indeks LQ45 Periode Tahun 2003-2005. *Jurnal Siasat Bisnis*, Vol. 12.
- Andriyani, Nadia P. 2016. *Analisis Dampak Stock Split terhadap Abnormal Return, Tingkat Volume Perdagangan, dan Bid-Ask Spread pada Perusahaan yang Terdaftar di BEI Tahun 2012 – 2014*. Universitas Jenderal Soedirman. Purwokerto.
- Ang, Robert. 1997. *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia*. Jakarta: Media Staf Indonesia.
- Anwar, Fahrizal dan Nadia Asandimitra. 2014. Analisis Perbandingan Abnormal Return, Trading Volume Activity, dan Bid-Ask Spread Sebelum dan Sesudah Stock Split. *Jurnal Ilmu Manajemen*. Vol. 2, No.3.
- Bodie, Kane and Marcus. 2006. *Investment* (6th edition). United States of America: Mc. Graww Hill.
- Budiyanto, Aris., Ismani dan Ngadirin. 2006. Analisis Trading Volume Activity dan Abnormal Return pada Saham Perusahaan yang Tercatat dalam Jakarta Islamic Index (JII) Sebelum dan Sesudah Bergabung dengan JII. *Jurnal Pendidikan Akuntansi Indonesia*. Volume V, No. 1, Hal. 42-54.
- Chandra, Permana. 2015. Analisis Pengaruh Kebijakan Perubahan Lot Size dan Tick Price terhadap Abnormal Return, Bid-Ask Spread, Depth, dan Trading Volume. *Jurnal Manajemen*, Volume 15, Nomor 1. Universitas Sebelas Maret. Surakarta.
- Chung, Kee H, Jung S. Shin. 2005. Tick Size and Trading Cost on the Korea Stock Exchange. *Journal of Financial Research* 1-28.

- Darma, I Kadek Dony dan I Gusti Ngurah A. S. 2016. Perbandingan Likuiditas Saham Sebelum dan Sesudah Perubahan Fraksi Harga dan Satuan Perdagangan. *E-Jurnal Ekonomi dan Bisnis Universitas Udayana* 14.2 Februari (2016). 1298-1325, ISSN: 2302-8556
- Ekaputra, I. A. and Ahmad, B. 2007. The Impact of Tick Size Reduction on Liquidity and Order Strategy: Evidence from the Jakarta Stock Exchange (JSX). *Economics and Finance in Indonesia* 55 (1): 89-104.
- Ghozali, Imam. 2011. *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS 19*. Semarang: Bidang Penerbit Universitas Diponegoro.
- Harris, L. E. 1997. Decimalization: A Review of The Arguments and Evidence. *Unpublished Working Paper*, Marshal School of Business at University of Southern California.
- _____. Trading and Exchange: Market Microstructure for Practitioners. *Draft Copy*. Oxford University Press.
- Husnan, Suad. 2005. *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta, UPP AMP YKPM.
- Iswan, Muhammad Raja. 2011. Analisis Abnormal Return pada Perusahaan Peraih Penghargaan Indonesian CSR Awards 2011. *Jurnal Manajemen*, Volume 15, Nomor 1. Universitas Telkom. Bandung.
- Jogiyanto, H. M. 2007. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi, Edisi Kelima*. Yogyakarta: BPFE.
- _____. 2013. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi, Edisi Ketujuh*. Yogyakarta: BPFE.
- Libert, E. T. 2014. Dampak Perubahan Fraksi Harga dan Satuan Perdagangan Saham pada Variabel Bid-ask Spread, Depth, dan Volume Perdagangan Studi pada Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Manajemen Bisnis*, Volume 2, Nomor 1.
- Martono. 2013. *Bank dan Lembaga Keuangan Lain*. Yogyakarta: Ekonisia.
- Nia, Ni Luh Putu, dkk (2016). Kondisi Bursa Efek Indonesia Akibat Penetapan Surat Keputusan Direksi PT Bursa Efek Indonesia Nomor Kep-00071/BEI/11-2013. *E-Jurnal Ekonomi dan Bisnis Universitas Udayana* 5.7: 2037-2062, ISSN : 2337-3067.

- Nugroho, Bayu A. 2006. Pengaruh Perbedaan Hubungan Fraksi Harga Saham Baru terhadap Variabel Bid-Ask Spread, Depth, dan Volume Perdagangan (Studi pada Fraksi Harga Rp 5, Rp 10, Rp 25 dan Rp 50 di Bursa Efek Jakarta). *Diponegoro Journal of Management*, Volume 2, Nomor 2.
- O'Hara, M. 1995. *Market Microstructure Theory*. Blackwell Business.
- Rusliati dan Farida E. N. 2010. Pemecahan Saham terhadap Likuiditas dan Return Saham. *Jurnal Bisnis dan Akuntansi*, Volume 12, Nomor 3, halaman 161-174.
- Satiari, F. 2009. Analisis Perbedaan Sistem Fraksi Harga Saham Terhadap Variabel Bid-Ask Spread, Depth, dan Volume Perdagangan (Studi pada fraksi harga Rp. 10, Rp. 25, Rp. 50 di Bursa Efek Indonesia). *Diponegoro Journal of Management*, Volume 1, Nomor 2, November 2009.
- Siswoyo, Damper D., dkk. 2015. Reaksi Pasar atas Perubahan Satuan Perdagangan dan Fraksi Harga di Bursa Efek Indonesia pada Tahun 2014 (Studi pada Sepuluh Sektor Industri di BEI tahun 2014). *Jurnal Riset Akuntansi Mercu Buana*, Volume 1 No. 2, November 2015.
- Sugiyono. 2016. *Statistika untuk Penelitian*. Bandung: Alfabeta.
- Purwoto, L. and Tandelilin, E. 2004. The Impact of the Tick Size Reduction on Liquidity: Empirical Evidence from the Jakarta Stock Exchange. *Gadjah Mada International Journal of Business* 6 (2): 225-249.
- Tandelilin, Eduardus. 2014. *Portofolio dan Investasi, Teori dan Aplikasi*. Yogyakarta: Kanisius.
- Trihendradi, Cornelius. 2009. *Statistik Inferen menggunakan SPSS*. Yogyakarta: Andi Offset.
- Yurizon. 2009. *Analisis Rata-rata Abnormal Return Saham LQ-45 pada Pemilihan dan Pelantikan Presiden Barack Hussein Obama*. Universitas Jenderal Soedirman. Purwokerto.
- www.idx.com diakses pada tanggal 16 Januari 2017.
- www.yahoofinance.com diakses pada tanggal 16 Januari 2017.