

DAFTAR PUSTAKA

- Ambarwati, Sri Dwi Ari. 2008. "Pengaruh Return Saham, Volume Perdagangan Saham, dan Varians Returns Saham terhadap Bid Ask Spread Saham pada Perusahaan Manufaktur yang tergabung dalam Indeks LQ45 Periode Tahun 2003-2005". *Jurnal Administrasi Bisnis*. Vol 33 No 1: 31-40.
- Ang, Robert. 1997. *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia*. Jakarta : Media Staf Indonesia.
- Bodie, Kane dan Marcus. 2006. *Investment* (6th edition). United States of America: Mc Graww Hill.
- Brigham, Eugene dan Joel F. Houston. 2001. "Manajemen Keuangan". Edisi Delapan. Jakarta: Erlangga.
- 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.
- Cleary, Sean and Charles P. Jones. 2011. *Investments : Analysis and Management*. North Carolina State University, United States of America : Wiley.
- Cox, Don R and David Peterson. 1994. "Stock Returns Following Large One Day Declines: Evidence on Short-Term Reversals and Longer-Term Performance". *The Journal of Finance*. Vol. XLIL, No. 1, 255-267
- Cressy, Robert and Hisham Farag. 2010. "Do unobservable factors explain the disposition effect in emerging stock markets?,". *Applied Financial Economics, Taylor & Francis Journals*. Vol. 20 : 1173-1183.
- DeBondt, W., and R.H. Thaler, 1985. "Does the Stock Market Overreact?". *The Journal of Finance*, Vol 40, 739-805.
- Fama, Eugene F., May 1970. "Efficient market: A Review of Theory and Empirical Work". *Journal of Finance*, Vol 25 (2): 383-417.
- Febriyanti, Emma dan Nadia Asandimitra. 2014. "Pengaruh Likuiditas, *Bid-Ask Spread*, *Earning* dan *Firm Size* terhadap Fenomena *Price Reversal* pada Saham *Winner-Loser*". *Jurnal Ilmu Manajemen*. Vol. 2 No. 2 April 2014.
- Ghozali, Imam. 2006. *Aplikasi Analisis Multivariate Dengan Program SPSS*. Cetakan Keempat. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.

- Ghozali, Imam. 2011. *Aplikasi Analisis Multivariate Dengan Program IBM SPSS 19*. Edisi Kelima. Semarang: Universitas Diponegoro.
- Gumanti, A. E., dan Elok Sri Utami. 2002. “Bentuk Pasar Efisien dan Pengujiannya”. *Jurnal Akuntansi & Keuangan*. Vol. 4, No. 1, Mei 2002: 54 – 68.
- Husnan, Suad. 2005. *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: UPP AMP YKPM.
- Iramani, dan Farida Umaiyaniti. 2002. “Analisis Return Pasca Terjadinya Perubahan Harga Ekstrem Pada Saham LQ 45”. *VENTURA*. Vol. 5 , No. 1, April 2002.
- Jogiyanto, H.M. 2008. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi* Edisi Ketiga. Yogyakarta: Badan Penerbit Fakultas Ekonomi Universitas Gadjah Mada.
- Kusumawardhani, Srihartati. 2001. “Analisis Reaksi Berlebihan, Efek *Bid Ask Spread*, *Firm Size*, dan Likuiditas Dalam Fenomena *Price Reversal* di Bursa Efek Jakarta. *Diponegoro Journal of Management*. Vol 1 No. 2.
- Meidawati dan Harimawan, M. 2004. “Pengaruh Pemilihan Umum Legislatif Indonesia Tahun 2004 Terhadap Return Saham dan Volume Perdagangan Saham LQ45 di PT Bursa Efek Jakarta”. *Kajian Bisnis dan Manajemen*. Vol 7 Nomor 1 : 89-101. ISSN: 1440-9018.
- Park, Jinwoo. 1995. “A Market Microstructure Explanation for Predictable Variations in Stock Returns Following Large Price Changes”. *Journal of Financial and Quantitative Analysis*. June, Vol. 32, No2: 241 – 256
- Santosa, Perdana Wahyu. 2010. Memahami Overreaction di Pasar Modal. <http://ekonomi.kompasiana.com>. Akses 3 Maret 2010.
- Satiari, F. 2009. “Analisis Perbedaan Sistem Fraksi Harga Saham Terhadap Variabel Bid Ask Spread, Depth, dan Volume Perdagangan”. *Diponegoro Journal of Management*. Vol 1 No. 2, November 2009.
- Stoll. 1989. “Inferring the Components of the Bid-Ask Spread: Theory and Empirical Test”. *Journal of Finance*. Vol 44: 115-134.
- Sugiyono. 2012. *Metode Penelitian Bisnis*. Bandung : Alfabeta
- Suliyanto. 2011. *Ekonometrika Terapan: Teori dan Aplikasi dengan SPSS*. Yogyakarta: Andi.

Titman, Sheridan and Roberto Wessels. 1998. "The Determinants of Capital Structure Choice". *The Journal of Finance*. Vol. XLIII, NO. 1.

Tandelilin, Eduardus. 2010. *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi*. Edisi Pertama. Yogyakarta: Kanisius.

Yuli, E., dan Kirmizi. 2012. "Analisis Overreaction Hypothesis dan pengaruh Ukuran Perusahaan, Bid-ask Spread, dan Likuiditas Saham Terhadap Fenomena Price Reversal". *Pekbis Jurnal*. Vol 4(1), 1-16

Zarowin, Paul. 1990. "Size, Seasonality, and Stock Market Overreaction". *Journal of Financial and Quantitative Analysis*. March, Vol. 25, No. 1: 113 – 125.

www.finance.yahoo.com (diakses pada tanggal 27 Januari 2017)

www.idx.com (diakses pada tanggal 27 Januari 2017)

www.sahamok.com (diakses pada tanggal 27 Januari 2017)