DAFTAR PUSTAKA

Abdul Halim. 2005. Analisis Investasi. Jakarta: Salemba Empat.

Agus Sartono. 2001. *Manajemen Keuangan, Teori dan Aplikasi*. Yogyakarta: BPFE.

Ali Arifin. 2002. *Membaca Saham.* Edisi Kedua. Yogyakarta: BPFE.

Ang, Robert. 1997. *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia*. Jakarta: Mediasoft.

Asep Muhammad Saepul Islam. 2013. Rencana akuisisi Pertamina atas PT. Perusahaan Gas Negara (PGAS) dinilai positif karena bisa meningkatkan efisiensi distribusi gas perseroan. Diakses pada tanggal 25 Juni 2015 dari http://www.pasarmodal.inilah.com/read/detail/2064967/diakuisisi-pertamina-inilah-prospek-saham-pgas.

Azuar Juliandi, Irfan dan Saprinal Manurung. 2014. *Metodologi Penelitian Bisnis: Konsep dan Aplikasi.* Medan: UMSU PRESS.

Brigham, Eugene F., dan Joel F Houston. 2006. *Dasar-dasar Manajemen Keuangan.* Terjemahan: Yulianto, Ali Akbar. Edisi 10. Buku 1.Jakarta: Salemba Empat.

Brigham, Eugene F. dan Joel F. Houston. 2010. *Dasar-dasar Manajemen Keuangan: Essentials of Financial Management*. Jakarta: Salemba Empat.

Budi Rusman Jauhari & Basuki Wibowo. 2004. *Analisis Fundamental Terhadap Return Saham Pada Periode Bullish dan Bearish Indeks Harga Saham Gabungan.* Jurnal Akuntansi dan Keuangan. Volume 9 Nomor 2, Juli 2004. ISSN:1410-1831. Halaman 17 s.d 32.

Budi Setiadharma. 2012. *Analisa Informasi Saham PT. Astra International Tbk (ASII)* diakses pada 24 Maret 2015. dari: http://idsaham.com/saham-ASII-informasi-saham-analisa-saham.html.

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

Darmadji, Tjiptono, Fakhruddin. 2011. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Bandung: Gramedia Pustaka.

Deden Mulyana. 2011. *Analisis Likuiditas Saham serta Pengaruhnya terhadap Harga Saham Perusahaan yang Berada pada Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2008-2009.* Jurnal Magister Manajemen. Volume 4 Nomor 1. Halaman 77-96.

Dheni Wahyu Fuadi . 2012. *Analisis Pengaruh Suku Bunga, Volume Perdagangan dan Kurs terhadap Return Saham Sektor Properti yang Listed di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2003-2007*. Program Studi Magister Manajemen. Universitas Diponogoro: Tesis.

E.A. Koetin. 2000, *Suatu Pedoman Invetasi Indonesia.* Jakarta: Sinar Harapan.

Eduardus, Tandelilin. 2001. *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio.* Edisi Pertama. Yogyakarta: BPFE.

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

Elto, Gruber, Brown, Goetzman. 2007. *Modern Portofolio Theory and Invesment Analysis.* 7^{th} Edition. Singapore Pte.Ltd: John Wiley & Sons, Inc.

Gurajati. 2003. *Ekonometrika Dasar*. Edisi keenam. Jakarta: Erlangga.

Harris, Larry. 2003. *Trading and Exchanges:Market Microstructure for Practitioners*. Inc New York: Oxford University Press.

Hartono M., Jogiyanto. 2000. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi.* Yogjakarta: BPFE.

Hartono M., Jogiyanto. 2008. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFT.

Hendy M, Fakhruddin. 2008. *Istilah Pasar Modal A-Z.* Jakarta: Elex Media Komputindo.

Horne, James C. Van dan John M. Machowicz, 2005. *Prinsip-prinsip Manajemen Keuangan*, Edisi 1. Terjemah: Fitri, Dewi Asari dan Deno A. Kwary. 2005. Jakarta:Salemba Empat.

Horne, James C. Van dan John M. Machowicz. 2012. *Fundamentals of Financial Management*. Edisi 13. Buku 1.Terjemah: Quratul'ain Mubarakah. Jakarta: Salemba Empat.

http://www.academia.edu/5513111/Data

http://www.idx.co.id/Portals/0/StaticData/ListedCcompanies/PerformanceSummary/KodeEmiten.pdf

http://www.ift.co.id/posts/nilai-kapitalisasi-saham-bumi-resources-keluar-dari-lima-besar

http://www.sahamok.com/laporan-keuangan/laporan-keuangan-Nama *Emiten*

Hutami, Rescyana Putri. 2012. *Pengaruh Dividend per Share, Return on Equity, dan Net Profit Margin terhadap Harga Saham Perusahaan Manufaktur yang Tercatat di Bursa Efek Indonesia Periode 2006-2010*. Jurnal Nominal Volume 1 Nomor 2. Halaman 105-124.

Ikatan Akuntansi Indonesia. 2009. *SAK-ETAP*. Jakarta: Salemba Empat.

Irham, Fahmi. 2013. *Rahasia Saham & Obligasi (Strategi Meraih Keuntungan Tak Terbatas dalam Bermain Saham dan Obligasi).* Bandung: Alfabeta.

Irham, Fahmi. 2012. *Pengantar Pasar Modal*. Bandung: Penerbit Alfabeta.

Ito Warsito. 2012. Penyebab Turunya Return Saham PT.Bumi Resources Tbk. Diakses pada 25 Maret 2015, dari hhtp://pasarmodal.inilah.com/read/detail/1908417/inilah-penyebab-turunnya-returnsaham-bumi diakses pada tanggal 25 Maret 2015.

Jones, C. 2002. *A Century of Stock Market Liquidity and Trading Costs.* Working Paper, Columbia University.

Jones, P Charles. 2014. *Investment Principles and Concepts.* 12^{th} *Edition.*. Singapore Pte.Ltd: John Wiley & Sons, Inc.

Kane Bodie, Marcus, Jain Ravi. 2006. *Investment.* Jakarta: Salemba Empat.

Kane Bodie, Marcus, Jain Ravi. 2014. *Investments, Asia Global Edition is an Asian Adaption of Investment,* 9^{th} *Edition.* Published by Arrangement With Mc.Graw-Hill Globa Education Holding, LLC.

Kasmir. 2013. *Analisis Laporan Keuangan.* Jakarta: PT. Raja Grafindo Persada.

Lo,A.W.,M.J.Wong. 2000. *Trading Volume:Definitions, Data Analisys, and Implication of Portofolio Theory*. The Review of Financial Studies.

Luvy Nurfinda Sari & Lintang Venusita. 2013. *Pengaruh Kinerja Keuangan terhadap Return Saham Perusahaan Property dan Real Estate*. Jurnal Ilmu Manajemen Volume 1 Nomor 3, Mei 2013. Halaman 774 s.d 785.

Madura, Jeff. 2003. *Financial Markets and Institutions*. 6^{th} Edition. United States of America (USA): South-Western, Thomson.

Madura, Jeff. 2015. *Financial Markets and Institutions*, 11^{th} Edition. United States of America (USA): Cengage Learning.

Malkiel, B. G. & Xu, Y. X. 2004. *Idiosyncratic Risk and Security Returns, Working Papers, The Annual Meetings of the American Finance Association.*

Mashuri dan M. Zainudin. 2009. *Metodologi Penelitian: Pendekatan Praktis dari Aplikasi*. Bandung: Reflika Aditama.

Moh. Nazir. 2003. *Metode Penelitian, Cetakan Kelima*, Jakarta: Ghalia Indonesia.

Moh. Nazir. 2009. *Metode Penelitian*. Jakarta: Ghalia Indonesia.

Mohamad Samsul. 2009. *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Erlangga.

Ni Luh Nonik Tika Silviyani, Edy Sujana, I Made Pradana Adiputra. 2014. *Pengaruh Likuiditas Pedagangan Saham dan Kapitalisasi Pasar terhadap Return Saham Perusahaan yang Berada pada Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia Periode Tahun 2009-2013 (Studi Empiris pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia).* e-Journal S1 Ak Universitas Pendidikan Ganesha. Volume 2 Nomor 1, 2014.

Nor Hadi. 2013. *Pasar Modal*. Bandung: Graha Ilmu.

Reilly, Frank K and Keith C.Brown. 2009. *Analysis of Investment & Management of Portofolio*. 9^{th}. United States of America (USA): South Western a division of Thomson Learning Ohio.

Rescyana Putri Hutami. 2012. *Pengaruh Dividend per Share, Return on Equity dan Net Profit Margin terhadap Harga Saham Perusahaaan Industri Manufaktur yang Tercatat di Bursa Efek Indonesia Periode 2006-2010.* Jurnal Nominal. Volume 1 Nomor 1, Halaman 104 s.d 23.

Rivail Davesta. 2013. *Pengaruh Risiko Sistematis dan Likuiditas Saham Terhadap Return Saham pada Industri Pertambangan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode Tahun 2010-2012*. Jurusan Manejemen, Fakultas Ekonomi. Skripsi.

Rowland Bismark Fernando Pasaribu. 2010. *Value At Risk Portofolio dan Likuiditas Saham.* Jurnal Akuntansi & Manajemen. Volume 21 Nomor 2, Agustus 2010. ISSN:0853 - 1269, Halaman 105 s.d 127.

Sharpe, Alexander dan Bailey. 1999. *Analisis Pengaruh Beberapa Faktor Fundamental dan Risiko Sistematik terhadap Harga Saham*. Volume 15 Nomor 3.

Singgih Santoso. 2002. *Statistik Parametik (Cetakan Ketiga).* Jakarta: PT. Gramedia Pustaka Utama.

Singgih Santoso. 2012. *Aplikasi SPSS pada Statistik Parametrik*. Jakarta: PT Elex Media Komputindo.

Sofyan Syafri Harahap. 2001. *Teori Akuntansi Edisi Revisi*. Jakarta: PT Raja Grafindo Persada.

Sofyan Syafri Harahap. 2009. *Analisis Kritis atas Laporan Keuangan.* Jakarta: PT.Raja Grafindo Persada.

S.R. Soemarso. 2009. *Akuntansi Suatu Pengantar.* Edisi Kelima. Jakarta: Salemba Empat.

Suad Husnan. 2010. *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas.* Edisi ketiga.Yogyakarta: AMP YKPN.

Sudana, I Made dan Nurul Intan. 2008. *Leverage Keuangna dan Likuiditas Saham Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Jakarta.* Jurnal Manajemen Teori dan Terapan.

Sugiyono. 2009. *Metode Penelitian Kuantitatif Kualitatif dan R&D.* Bandung: Alfabeta.

Sugiyono. 2012. *Metode Penelitian Kuantitatif Kualitatif dan R&D*. Bandung: Alfabeta.

Sugiyono. 2014. *Metode Penelitian Pendidikan (Pendekatan Kuantitatif, Kualitatif, dan R&D).* Bandung: Alfabeta.

Surya Wonowidjojo (Tjoa Ing Hwie) . 2012. Analisis Laporan Keuangan PT. Gudang Garam Tbk. Diakses pada tanggal 24 Maret 2015 dari http://www.inflasikeuangan.blogspot.com/2014/10/pt-gudang-garam-tbk.html

Toto Rusbianto . 2012. *Lima Saham Unggulan Indeks LQ45*. Diakses pada 10 February,2015 dari http://www.indonesiafinancetoday.com, 2012/Lima-saham-unggulan-indeksLQ45.

Ukie Jaya Mahendra. 2012. *Pergerakan LQ45 Menggungguli IHSG*. Diakses pada 25 February, 2015 dari http://www.inilah .com/pergerakan -harga-saham.

Uma Sekaran. 2006. *Metodologi Penelitian untuk Bisnis Buku Edisi 4.* Jakarta: Salemba Empat.

Umi Narimawati. 2007. *Riset Manajemen Sumber daya Manusia.* Jakarta: Restu Agung.

Umi Narimawati. 2010a. *Metodologi Penelitian: Dasar Penyusunan Penelitian Ekonomi.* Jakarta: Genesis.

Umi Narimawati. 2010b. *Penulisan Karya Ilmiah.* Bekasi: Genesis.

Werner R Murhadi. 2012. *Analisis Laporan Keuangan: Proyeksi dan Valuasi Saham*. Jakarta: Salemba Empat.

Werner R.Muhardi. 2013. *Pengaruh Idiosyncratic Risk dan Likuiditas Saham terhadap Return Saham.* Jurnal Manajemen dan Kewirausahaan. Volume 15, Nomor 1, Maret 2013. ISSN:1411 - 1438. Halaman 33 s.d 40.

William F Sharpe, Cordon J Alexander, Jefrey V Bailey. 1995. *Investmen*t. Prentice-Hall International Editions.

Yakov Amihud. 2002. *Liquidity and Stock Returns: Cross-Section and Time-Series Effects.* Journal of Financial Markets.

Yeye Susilowati & Tri Turyanto. 2011. *Reaksi Signal Rasio Profitabilitas dan Rasio Solvabilitas terhadap Return Saham Perusahaan*. Dinamika Keuangan dan Perbankan Volume 3 Nomor 1, Mei 2011. ISSN:1979-4878. Halaman 17 s.d 37.

Zalmi zubir. 2012. *Portofolio Obligasi*. Jakarta: Salemba Empat.