

DAFTAR PUSTAKA

Buku :

Amihud, Yakov, Mendelson, Haim, dan Lasse Heje Pedersen. *Market Liquidity: Asset Pricing, Risk, and Crises*. New York: Cambridge University Press, 2013.

Anoraga, Pandji dan Piji Pakarti. *Pengantar Pasar Modal Edisi Revisi*. Jakarta: PT Rineka Cipta, 2006.

Baker, H. Kent dan John R. Nofsinger. *Behavioral Finance: Investors, Corporations, and Markets*. New Jersey: John Wiley & Sons, Inc, 2010.

Bodie, Zvi, Kane, Alex, dan Alan J. Marcus. *Investasi*. Jilid 2 Edisi 6. Jakarta: Penerbit Salembat Empat, 2006.

Brigham, Eugene F. dan Joel F. Houston. *Dasar-Dasar Manajemen Keuangan*. Jilid 1 Edisi 11. Jakarta: Penerbit Salemba Empat, 2013.

Darmadji, Tjiptono dan Hendry M. Fakhruddin. *Pasar Modal di Indonesia: Pendekatan Tanya Jawab*. Jakarta: Penerbit Salemba Empat, 2001.

Elton, Edwin J., et al. *Modern Portfolio Theory and Investment Analysis*. 8th Edition. New Jersey: John Wiley & Sons, Inc, 2011.

Fabozzi, Frank J. *Manajemen Investasi*. Jakarta: Penerbit Salemba Empat, 1999.

Fabozzi, Frank J. *Managing Credit Risk In Corporate Bonds Portfolios: A Practitioner's Guide*. New Jersey: John Wiley & Sons, Inc, 2004.

- Gandevani, Ned. *Winning Edge Trading: Successful and Profitable Short-and Long-Term Trading Systems and Strategies*. New Jersey: John Wiley & Sons, Inc, 2010.
- Glau, Kathrin dan Marthias Schere. *Innovations In Quantitative Risk Management*. Editor Rudi Zagst. New York: Springer Cham, 2015.
- Gup, Benton dan Rawley Thomas. *The Valuation Hand Book: Valuation Techniques From Today's Top Practitioners*. New Jersey: John Wiley & Sons, Inc, 2010.
- Halim, Abdul. *Analisis Investasi*. Jakarta: Penerbit Salemba Empat, 2005.
- Hartono, Jogyanto. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFE UGM, 2009.
- Hasan, M. Iqbal. *Pokok-Pokok Materi Statistik 2: Statistik Inferensif*. Jakarta: PT Bumi Aksara, 2008.
- Husnan, Suad. *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan Sekolah Tinggi Ilmu Manajemen YKPN, 2005.
- Jones, Charles P. *Investments: Analysis and Management*. New Jersey: John Wiley & Sons, Inc, 2004.
- Khalwaty, Tajul. *Inflasi dan Solusinya*. Jakarta: PT Gramedia Pustaka Utama, 2000.
- Mayo, Herbert. *Basic Investments*. South Western: Thomson, 2006.

- Moix, Pierre Yves. *The Measurement of Market Risk: Modelling of Risk Factors, Asset Pricing, and Approximation of Portfolio Distributions*. New York: Springer, 2001.
- Pedersen, Lasse Heje. *Efficiently Inefficient: How Smart Money Invests & Market Prices are Determined*. New Jersey: Princeton University Press, 2015.
- Petit, Barbara, Pinto, Jerald E., dan Wendy L. Pirie. *Fixed Income Analysis*. 3th Edition. New Jersey: John Wiley & Sons, Inc, 2015.
- Reilly, Frank K. dan Keith C. Brown. *Investments Analysis & Portfolio Management*. 10th Edition. South Western: Cengage Learning, 2012.
- Rodoni, Ahmad dan Herni Ali. *Manajemen Keuangan*. Jakarta: Penerbit Mitra Wacana Media, 2010.
- Ross, Stephen A., Westerfield, Randolph W., dan Jeffrey Jaffey. *Corporate Finance*. 6th Edition. Boston: Mc Graw-Hill, 2002.
- Samsul, Mohamad. *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Penerbit Erlangga, 2006.
- Santoso, Singgih. *Statistik Nonparametrik: Konsep dan Aplikasi dengan SPSS*. Jakarta: PT Elex Media Komputindo, 2010.
- Sarwoko. *Dasar-Dasar Ekonometrika*. Yogyakarta: Penerbit Andi Offset, 2005.
- Shapiro, Alan C. *Multinational Financial Management*. 4th Edition. Boston: Allyn and Bacon, 1992.

- Sharpe, William F., Alexander, Gordon J., dan Jeffery V. Bailey. *Investasi*. Jakarta: Prenhallindo, 1997.
- Solow, Kenneth R. *Buy and Hold Is Dead (Again): The Case For Active Portfolio Management In Dumerous Markets*. New York: Morgan James Publishing, 2009.
- Sugiyono. *Metode Penelitian Administrasi*. Bandung: Penerbit Afabeta, 2008.
- Suharyadi dan Purwanto S.K. *Statistika: Untuk Ekonomi & Keuangan Modern*. Jakarta: Penerbit Salemba Empat, 2004.
- Sunariyah. *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*. Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan Sekolah Tinggi Ilmu Manajemen YKPN, 2006.
- Suryabrata, Sumadi. *Metodologi Penelitian*. Jakarta: Rajawali Pers, 2009.
- Thaler, Richard H. *Advances In Behavioral Finance*. Vol II. New Jersey: Princeton University Press, 2005.
- Van Horne, James C. dan John M. Wachowicz. *Prinsip-Prinsip Manajemen Keuangan*. Jilid 1 Edisi 12. Jakarta: Penerbit Salemba Empat, 2005.
- Van Horne, James C. dan John M. Wachowicz. *Prinsip-Prinsip Manajemen Keuangan*. Jilid 2 Edisi 12. Jakarta: Penerbit Salemba Empat, 1998.
- Vishwanath, S.R. *Investment Management: A Modern Guide to Security Analysis and Stock Selection*. Editor Chandrasekhar. Berlin: Springer, 2009.

Weston, J. Fred. dan Eudgen F. Brigham. *Dasar-Dasar Manajemen Keuangan*. Jilid 1 Edisi Kesembilan. Diterjemahkan Oleh Alfonsus Sirait. Jakarta: Penerbit Erlangga, 1998.

Widoatmodjo, Sawidji. *Cara Sehat Investasi di Pasar Modal*. Jakarta: Penerbit PT Elex Media Komputindo, 2008.

Winarno, Wing Wahyu. *Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan Eviews Edisi Kedua*. Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan Sekolah Tinggi Ilmu Manajemen YKPN, 2009.

Jurnal :

Amihud, Yakov and Haim Menedelson. "Asset Pricing and The Bid Ask Spread", *Journal of Financial Economics*, Vol. 17, 1986, p. 223-249.

Arma, Visita Yales. "Faktor Penentu *Holding Period* Saham LQ-45 di Bursa Efek Indonesia", *Journal of Business and Banking*, Vol 3, Nomor 2, November 2013, p. 201-212.

Arifin, Agus Zainul dan Tan Grace Tanzil. "Biaya Transaksi dan Periode Pemegangan Saham Biasa yang Terdaftar di Bursa Efek Jakarta Periode 2002-2004", *Jurnal Siasat Bisnis*, Vol. 12, No.3, Desember 2008, p. 161-173.

Arozzy, Susanti M.F. dan I. Roni Setyawan. "Pengaruh Harga, Volume Perdagangan, dan Volatilitas Harga Saham Pada *Bid Ask Spread* Perusahaan yang Melakukan *Stock Split* ", *Manajemen Usahawan Indonesia*, No. 10, Tahun XXXIV, Oktober 2005, p. 36-45.

Atkins, Allen B. and Edward A. Dyl. “*Transaction Costs and Holding Period for Common Stocks*”, *The Journal of Finance*, Vol. 52, No.1, March 1997, p. 309-325.

Chung Shifei and Peihwang Wei. “*The Relationship Between Bid Ask Spreads and Holding Periods: The Case of Chinese A and B Shares*”, *Global Journal Finance*, Vol. 15, 2005, p. 239-249.

Ekaputra, Irwan Adi. “*Determinan Intraday Bid Ask Spread Saham di Bursa Efek Jakarta*”, *Manajemen Usahawan Indonesia*, No. 5, Tahun XXXV, Mei 2006, p. 8-12.

Margareta, Kadek Aryati dan Ni Nyoman Ayu Diantini. “*Variabel-Variabel Penentu Holding Period Saham*”, *Jurnal Manajemen, Strategi Bisnis, dan Kewirausahaan*, Vol. 9, No.1, Februari 2015, p. 57-64.

Maulina, Vinus, Sumiati, dan Iwan Triyuwono. “*Analisis Faktor yang Mempengaruhi Holding Period Saham Biasa Pada Perusahaan GO PUBLIC yang Tercatat Dalam Indeks LQ-45*”, *Jurnal Wacana*, Vol 13, Nomor 3, Juli 2010, p. 398-416.

Maulina, Vinus dan M. Syafi’i Idrus. “*Informasi Asimetri dan Periode Menahan Kepemilikan Saham LQ 45 di Bursa Efek Indonesia*”, *Jurnal Aplikasi Manajemen*, Vol. 10, No. 4, Desember 2012, p. 741-752.

Miapuspita, Yenny Ayu., Iramani, dan Linda Purnamasari. “*Analisis Pengaruh Bid Ask Spread, Market Value, dan Risk of Return Saham Terhadap Holding Period Pada Saham Teraktif yang Tercatat di Bursa Efek Jakarta*

Periode 2001-2002”, *Jurnal Ekonomi Bisnis dan Akuntansi Ventura*, Vol 6, Nomor 2, Agustus 2003, p. 117-126.

Nany, Magdalena. “Analisis Pengaruh Harga Saham, *Return* Saham, Varian *Return* Saham, *Earnings*, dan Volume Perdagangan Saham Terhadap *Bid Ask Spread* Sebelum dan Sesudah Pengumuman Laporan Keuangan”, *Jurnal Ekonomi Pembangunan, Manajemen, dan Akuntansi Perspektif*, Vol. 9, No. 1, Juni 2004, p. 23-31.

Nurwani, Dinar Ayu., Dzulkirom, Moch., dan Topowijono. “*Pengaruh Bid Ask Sprread, Market Value, Risk of Return, dan Dividend Payout Ratio Terhadap Holding Period Saham Biasa*”, *Jurnal Universitas Brawijaya*, 2011, p. 1-11.

Nuswantara, Dian Anita., dan Yane Kartikasari. “*The Effect of Bid Ask Spread, Market Value, and Risk of Return on The Holding Period of The LQ-45 Stocks*”, *Simposium Riset Ekonomi II*, Surabaya, 23-24 November 2005, p. 1-19.

Purwanto, Agus. “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 & Auditing*, Vol. 1, No. 1, November 2004, p. 66-82.

Ratnasari, Desy dan Dewi Astuti. “Pengaruh *Bid Ask Spread, Market Value, dan Variance Return* Terhadap *Holding Period*”, *Jurnal Finesta*, Vol. 2, Nomor 1, 2014, p. 99-102.

Santoso, Eko Budi. "Analisis Pengaruh *Transaction Cost* Terhadap *Holding Period Saham Biasa*", *Jurnal Riset Akuntansi dan Keuangan*, Vol 4, Nomor 2, Agustus 2008, p. 116-131.

Setyawan, I. Roni. "Pengaruh *Bid Ask Spread*, *Market Value*, dan Volatilitas Harga Terhadap *Holding Period Saham-Saham LQ-45 Tahun 2003-2005*", *Manajemen Usahawan Indonesia*, No. 1, Tahun XXXVII, Januari 2008, p. 9-13.

Stoll, Hans R. & Robert Whaley. "*Transaction Cost and The Small Firm Effect*", *Journal of Finance Economics*, Vol. 12, 1983, p. 57-80.

Stoll, Hans R. "*Infering The Components of Bid Ask Spread: Theory and Empirical Test*", *Journal of Finance*, Vol. XLIV, No. 1, March 1989, p. 115-134.

Wisayang, Vinsensia Retno. "Analisis Pengaruh *Bid Ask Spread*, *Market Value*, dan Varian *Return Saham* Terhadap *Holding Period* Pada Saham LQ 45", *Jurnal Universitas Diponegoro*, 2009, p. 1-15.

Internet :

_____. *BEI: Revisi Fraksi Saham Tingkatkan Likuiditas*. 2015.
<http://id.beritasatu.com>. (Diakses tanggal 20 Oktober 2015).

_____. *Bursa Efek Akui Komposisi Investor di Pasar Modal Tak Ideal*.
2015. <http://www.cnnindonesia.com>. (Diakses tanggal 22 November 2015).

_____. *Jejak Positif Pasar Saham 2013*. 2015. <http://investar.idx.co.id>.

(Diakses tanggal 27 Juni 2015).

_____. *Jelang Akhir Tahun BEI Bukukan Kenaikan Transaksi Saham*.

2015. <http://vibiznews.com>. (Diakses tanggal 27 Juni 2015).

_____. *Perdagangan Saham 2013 Resmi ditutup, IHSG Menguat Ke*

Level 4274. 2015. <http://www.kemenkeu.go.id>. (Diakses tanggal 27 Juni 2015).

_____. *Saham dan Ekonomi Lesu, Investor Pilih Investasi Jangka*

Panjang. 2015. <http://market.bisnis.com>. (Diakses tanggal 22 November 2015).

_____. *Tahun 2013, BEI Mencatatkan Rekor 31 Emiten Baru dan*

Peningkatan Likuiditas Sebesar 37,68%. 2015. <http://www.idx.co.id>.
(Diakses tanggal 25 Juni 2015).

_____. *Triwulan IV, Kepemilikan Saham Masih Didominasi Investor*

Asing. 2015. <http://www.ksei.co.id>. (Diakses tanggal 19 November 2015).

www.idx.co.id