

## DAFTAR PUSTAKA

- Ali, Ruhani, Zamri Ahmad, dan Shangkari V. Anusakumar. 2013. Intra-Sector Return Reversals In The Malaysian Stock Market. *International Journal of Business and Society*. Vol. 14, No. 3, hal. 496-513.
- Apriyono, Ali dan Abdullah Taman. 2013. Analisis Overreaction Pada Saham Perusahaan Manufaktur di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2005-2009. *Jurnal Nomina*. Vol. II, No. II. Tahun 2013, hal. 76-96.
- Atkins, Allen B dan Edward A. Dyl. 1990. Price Reversals, Bid-Ask Spreads, and Market Efficiency. *Journal of Financial and Quantitative Analysis*. Vol. 25, No. 4, hal 545.
- Bursa Efek Indonesia. 2010. *Buku Panduan Indeks Harga Saham Bursa Efek Indonesia*. Jakarta: Indonesia Stock Exchange.
- Cox, Don R dan David Peterson. 1994. Stock Returns Following Large One Day Declines: Evidence on Short-Term Reversals and Long-Term Performance. *The Journal of Finance*. Vol. XLIL, No. 1. Maret, hal. 255-267.
- Da, Zhi, Qianqiu Liu, dan Ernst Schaumburg. 2011. Decomposing Short-Term Return Reversal. *Journal of Financial Market*. Agustus, hal. 1-43.
- De Bond, W.F.M., dan R.H. Thaler. 1985. Does the Stock Market Overreact?. *The Journal of Finance*. Vol. XL, No. 3. Juli 1985. Hal. 793-805.
- Dinawan, M. Rizkada. Analisis Overreaction Hypothesis, Dan Pengaruh Firm Size, Likuiditas, dan Bid-Ask Spread Terhadap Fenomena Price Reversal di Bursa Efek Jakarta. Tesis. Semarang: Program Pasca Sarjana Universitas Diponegoro, 2007.
- Hendrayati, Heny. 2014. Pengaruh Ukuran Perusahaan (Firm Size), Dan Likuiditas Saham Terhadap Fenomena Price Reversal, *Jurnal IMAGE*, Vol.III No.1, hal. 30-44.
- Kusumawardhani, Srihartati. Analisis Reaksi Berlebihan, Efek Bid-Ask Firm Size dan Likuiditas dalam Fenomena Price Reversal di Bursa Efek Jakarta. Tesis. Semarang: Program Pasca Sarjana Universitas Diponegoro. 2011.
- Lasmana, Eko Budi. Pengujian Price Reversal Jangka Panjang dari Penurunan Besar Harga Saham Pada Saham-Saham LQ 45 Bursa Efek Jakarta. Tesis. Jakarta: Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia. 2005
- Latjuba, Rismaeka Purnamasari dan Rowland Bismark Fernando Pasaribu. 2013. Efek Bid-Ask, Firm Size, dan Likuiditas Dalam Fenomena Price Reversal Saham Winner dan Loser Kelompok Entitas Indeks LQ45 Periode 2009-2011 di Bursa Efek Indonesia. *PESAT*. Vol. 5. Oktober 2013, hal. 8-15.

- Ma, Yulong, Alex P. Tang, dan Tanweer Hasan. 2005. The Stock Price Overreaction Effect Evidence on Nasdaq Stocks. *Journal of Business and Economics*. Vol. 44, No. 3 dan 4, hal. 125.
- Permana, Pondra Nala. Analisis Overreaction Pada Saham-Saham Yang Tergabung Dalam Perhitungan Indeks LQ 45 di Bursa Efek Jakarta Periode Tahun 2002-2005. Tesis. Jakarta: Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia. 2005.
- Lobe, Sebastian dan Johannes Rieks, 2011. Short-Term Market Overreaction on the Frankfurt Stock Exchange. *Quarterly Review of Economics and Finance*. Vol. 51. Mei 2011. hal. 113-123.
- Yuba, Todd M. 2006. Stock Price Reversals Following Extreme Weekly Return. Tesis. California: Faculty of California State University Fullerton
- Ulfah, Maria. Uji Overreaction Pada Saham LQ45 Di Bursa Efek Jakarta Periode Februari 2002-Juli 2002 Hingga Agustus 2004-Januari 2005. Tesis. Jakarta: Fakultas Ekonomi Universitas Negeri Indonesia. 2005
- Wibowo, Agus dan Agus Sukarno. 2004. Reaksi Pasar Berlebihan dan Pengaruh Ukuran Perusahaan Terhadap Pembalikan Harga Saham di Bursa Efek Jakarta. *Wahana*. Vol. 7, No 1., Februari, hal. 57-73.
- Winarno, W. Wing. *Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan Eviews*. 2011. Edisi Ketiga. Yogyakarta: Penerbit UPP STIM YKPN.
- Yuli, Elline dan Kirmizi. 2012. Analisis Overreaction Hypothesis Dan Ukuran Perusahaan, Bid-Ask Spread dan Likuiditas Saham Terhadap Fenomena Price Reversal: (Studi Empiris pada Perusahaan Yang Terdaftar di BEI). *Pekbis Jurnal*. Vol. 4, No. 1. Maret 2012, hal. 1-16.
- Zarowin, Paul. 1990. Size, Seasonality and Stock Market Overreaction. *Journal of Financial and Quantitative Analysis*. Vol. 25, No. 1. Maret, hal. 113-125.