

DAFTAR PUSTAKA

- Adisetia, Lukman Dwi. 2013. Pengaruh Harga, Volume Perdagangan, Volatility Saham Terhadap Bid-ask Spread Saham pada Indeks LQ45. *Jurnal Kindai*, 9(2), 287-299.
- Ambarwati, Sri Dwi Ari. 2008. Pengaruh Return Saham, Volume Perdagangan Saham dan Varian Return Saham Terhadap Bid-ask Spread Saham pada Perusahaan Manufaktur yang Tergabung Dalam Indeks LQ45 Periode Tahun 2003-2005. *Jurnal Siasat Bisnis*, 12(1), 27-38.
- Anggraeni, N. L. Putu Nia, I. G. B. Wiksuana, dan L. P. Wiagustini. 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*, Vo.15, No.7.
- Author's Guide. 2013. *Stock Market Investing for Beginners (Essentials to Start Investing Successfully)*. California: Tycho Press.
- Bessembinder, Hendrik dan Kumar Venkataraman. 2009. Bid-ask Spread: Measuring Trade Execution Costs in Financial Markets. *Journal Encyclopedia of Quantitative Finance*.
- Chen, Xiaohong., Oliver Linton, Stefan Schneeberger, Yanping Yi. 2018. Semiparametric Estimation of the Bid-Ask Spread in Extended Roll Models. *Journal of Econometrics*.
- Febrianti, Noerita. 2014. Analisis Perbedaan Bid-ask Spread dan Volatilitas Saham Sebelum dan Sesudah Pengumuman Stock Split. *Jurnal Bisnis dan Manajemen (BISMA)*, 7 (1), 17-25.
- Finansialku.com. 2018. Mengenal Bursa Efek Indonesia dan Sejarahnya. <https://www.finansialku.com/mengenal-sejarah-bursa-efek-indonesia-idx/> (Di akses pada tanggal 3 Februari 2019, pada pukul 11:26)
- Ghozali, Imam. 2016. *Aplikasi Analisis Multivariat dengan Program IBM SPSS 23*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Gerace, Dionigi., Ciorstan Smark, dan Timothy Freestone. 2012. Impact of Reduced Tick Size on the Hongkong Stong Exchange. *Journal of New Business Ideas and Trends*, 10(2), 54-71.

- Hagstromer, Bjorn, Richard Henricsson dan Lars Norden. 2016. Components of the Bid-ask Spread and Variance: A Unified Approach. *Wiley Periodicals, Inc. Jrl Fut. Mark* 36:545-563.
- Hamid, Agustini. 2016. Tick Size Implementation of Kompas 100 Index at Indonesia Stock Exchange. *Binus Business Review*, 7(3), 289-295
- Hamidah, Sarah Maryadi dan Gatot Nazir Ahmad. 2018. Pengaruh Harga Saham, Volatilitas Harga Saham, dan Volume Perdagangan Saham terhadap Bid-ask Spread Saham pada Perusahaan Sektor Pertambangan yang Terdaftar di Indeks Saham Syariah Indonesia (ISSI) Periode Juni 2016 – Juni 2017. *Jurnal Riset Manajemen Sains Indonesia Vol 9, No.1.*
- Hussain, Syed Mujahid. 2011. The Intraday Behaviour of Bid-Ask Spreads, Trading Volume and Return Volatility: Evidence from DAX30. *International Journal of Economics and Finance*, Vol.3, No.1.
- Jannah, Raudhatul, dan Musfiari Haridhi. 2016. Pengaruh Kebijakan Dividen, Earning Volatility dan Leverage Terhadap Volatilitas Harga Saham pada Perusahaan Non-Financing yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2010-2014. *Jurnal Ilmiah Mahasiswa Ekonomi Akuntansi*, Vol.1, No.1.
- Nainggolan, Ruminsar dan Donalson Silalahi. 2016. Pengaruh Volume Perdagangan Saham dan Harga Saham Terhadap Bid-ask Spread (Studi pada Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia). *Jurnal Manajemen dan Bisnis*, Vol.16, No.2.
- Napitupulu, Veronica, dan Syahyunan. 2013. Pengaruh Return Saham, Volume Perdagangan Saham dan Volatilitas Harga Saham terhadap Bid-ask Spread pada Perusahaan yang Melakukan Stock Split di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Media Informasi Manajemen*, 1 (2).
- Narayan, Paresh Kumar., Sagarika Mishra, dan Seema Narayan. 2015. New Empirical Evidence on the Bid-ask Spread. *Applied Economics by: Taylor & Francis.*
- Natalia, M. Mulyono, dan Kurnianingrum D. 2016. Impact of Changing Price Fraction to the Stock Trading Indicators in Indonesian Stock Exchange. *BINUS Journal*, Vol.7, No.3.
- Ningsih, Titik Rahayu dan Nadia Asandimitra. 2017. Pengaruh Bid-ask Spread,

Market Value dan Variance Return Terhadap Holding Period Saham Sektor Pertambangan yang Listing di Bursa Efek Indonesia Tahun 2011 – 2015. *Jurnal Ilmu Manajemen, Volume 5, No.3.*

- O'Hara M., Saar G., dan Zhong Z. 2014. Relative Tick Size and the Trading Environment. *Working paper, Cornell University.*
- Okezone Finance. 2017. Ambisi Dirut BEI Bawa Pasar Modal RI Terbesar Se-Wilayah Asia Tenggara. <https://economy.okezone.com/read/2017/07/14/278/1736149/ambisi-dirut-bei-bawa-pasar-modal-ri-terbesar-se-wilayah-asia-tenggara>. (Di akses tanggal 2 Oktober 2018, pukul 17.46)
- Shobriati, Ikrima., Darminto, dan M. G. Wi Endang. 2013. Pengaruh Harga Saham, Volume Perdagangan Saham dan Varian Return Saham terhadap Bid-ask Spread di Seputar Pengumuman Stock Split. *E-journal UNESA, Vo.3, No.2.*
- Siswoyo, Damper Dwijo, dan Endang Sri Utami. 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.*
- Sudirman. 2015. *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Gorontalo: Sultai Amai Press.
- Sugiyono. 2014. *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif dan Kombinasi (Mixed Method's)*. Edisi 5. Bandung: Alfabeta.
- Sutyanto, David., Nunung Nuryartono, dan Trias Andati. 2015. Analysis the Effect of Tick Size Simplification to Trade and Stock Return in Indonesia Stock Exchange. *Finance and Banking Journal, 17(1), 24-39. ISSN: 1410-8623.*
- Szylar, Christian. 2014. *Handbook of Market Risk*. Canada: John Wiley & Son's, Inc.
- Wenda, Nindia Aristri, Nur Diana, dan M. Cholid Mawardi. 2018. Perbandingan Likuiditas Saham Sebelum dan Sesudah Perubahan Fraksi Harga. *Jurnal Riset Akuntansi, Vol.7, No.11.*
- Widhyawati, I Gusti A. M., dan I. G. A. Eka Damayanthi. 2015. Pengaruh Trading Volume, Market Value dan Return Variance terhadap Bid-ask Spread. *E-jurnal Akuntansi Universitas Udayana, Volume 10, 863-777. ISSN: 2302-8556.*
- Winarno, Wing Wahyu. 2015. *Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan Eviews*. Edisi 4. Yogyakarta: Penerbit UPP STIM YKPN.

Wu, Yu., Tim Krehbiel, dan B. Wade Brorsen. 2011. Impacts of Tick Size Reduction on Transaction Cost. *Journal of Economics Literature (JEL)*.

Yusuf, A. Muri. 2014. *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif, dan Penelitian Gabungan*. Jakarta: Prenada Media.