

DAFTAR PUSTAKA

- Abdul Halim dan Eduardus Tandelilin., 2001, *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*, Edisi Pertama, BPFE, Yogyakarta.
- Admati, Anat R. And Paul Pfleiderer., 1988, "A Theory of Intraday Patterns: Volume and Price Variability", *Review of Financial Studies*, Vol. 1, No. 1, pp. 3-40.
- Agus Widarjono., 2007, *Ekonometrika Teori dan Aplikasi untuk Ekonomi dan Bisnis*, Edisi Kedua, Fakultas Ekonomi UII, Yogyakarta.
- Alexander, C., 2001, *Market models: A Guide to financial data analysis*, John Wiley & Sons, New York.
- Andi Budiharjo., 2005, "Volatilitas Saham Di Indonesia Periode Tahun 1995-2005", *Tesis. Program Studi Magister Manajemen Jurusan Ilmu-ilmu Sosial*, Universitas Gadjah Mada, Yogyakarta.
- Asteriou & Hall., 2007., *Applied Econometrics*. Palgrave Maemillan, New York.
- Barber dan Terrance., 2001, "Online Investors: Dp the Slow Die Firs?", *The Reviewing of Financial Stuydies*, 15 (2): 21.
- Bollerslev, T. 1986., "Generalized AutoRegressive Heteroscedastic Model", *Journal of Econometric*, 31:307-327.
- , "Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity". *Journal of Econometrics*.
- Booz Allen Hamilton., 2002., *The World's Most Effective policies for the Economy*, Allen Hamilton, London.
- Brigham dan Houston. 2004., *Dasar-dasar Manajemen Keuangan*, Edisi Kesepuluh Buku 1. Salemba Empat, Jakarta.
- Cheng, Ariff and Shamser., 2001, "Accounting Earnings and Share Revaluation: Further Exploration", *Capital Market Review*. Vol.9. pp. 21-48.
- Darmadji, Tjiptono., & Fakhruddin, Hendy M., 2011, *Pasar Modal di Indonesia*, Salemba Empat, Jakarta.
- Engle, R., 1982, "Autoregressive Conditional Heterocedasticity with Estimates of the Variance of United Kingdom Inflation", *Journal of Econometrics*.
- Erma Afriza Indrianna., 2004, "Pengaruh Frekuensi Perdagangan Terhadap Volatilitas Saham (Studi empiris pada Bursa Efek Jakarta)", *Tesis, Program Studi Magister Manajemen Jurusan Ilmu – Ilmu Sosial*, Universitas Gadjah Mada, Yogyakarta.

- Fakhruddin., 2001, *Pasar Modal di Indonesia*, Salemba Empat, Jakarta.
- Glosten, Lawrence and Paul R. Milgrom., 1985, "Bid-Ask and Transaction Prices In A Specialist Market With Heterogeneously Informed Traders", *Journal of Financial Economics*.
- Habib, Arief., 2008, *Kiat Jitu Peramalan Saham*, Andi Offset, Yogyakarta.
- Halim, Abdul., 2003, *Analisis Investasi*, Edisi Pertama, Penerbit Salemba Empat, Jakarta.
- Joesoef, J., R., 2002., "Analytic Hierarchy Process (AHP) dan Penentuan Produk", *Kinerja Jurnal Bisnis dan Ekonomi*, Volume 6.
- Jogiyanto., 2000, *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, Edisi Kedua, BPFE-UGM, Yogyakarta.
- Kyle, Albert S., 1985, "Continuous Auctions and Insider Trading", *Journal of Econometrica*, 53(6): 1.315-1.335.
- Nastiti, Khoiru., 2012, "Analisis Volatilitas Saham Perusahaan Go Public dengan Metode ARCH-GARCH", *Tugas Akhir*, Jurusan Statistika Fakultas Matematika dan Ilmu Pengetahuan Alam Institut Teknologi Sepuluh Nopember, Bandung.
- Rusdin., 2006, *Pasar Modal: Teori, Masalah, dan Kebijakan Dalam Praktik*. Gramedia Pustaka Utama, Jakarta
- Siamat, Dahlan., 2005, *Manajemen Lembaga Keuangan Kebijakan Moneter dan Perbankan*, Edisi Kelima. Penerbit Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia, Jakarta.
- Suad Husnan., 2003, *Manajemen Keuangan Teori dan Penerapan (Keputusan Jangka Pendek)*, Edisi keempat, BPFE, Yogyakarta.
- Suad, Husnan., 1998, *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*, Edisi Ketiga, UPP AMP YKPN, Yogyakarta.
- Sunariyah., 2004, *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*. UUP AMP YKPN, Yogyakarta.
- Syukma, Novia Handayani., 2011, "Analisis Faktor-Faktor Makroekonomi Yang Mempengaruhi Return Saham Batubara Dalam Kelompok Jakarta Islamic Index (JII)", *Tesis*, Departemen Ilmu Ekonomi Fakultas Ekonomi Dan Manajemen, Institut Pertanian Bogor, Bogor.
- Tandelilin, Eduardus., 2001, *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*, Edisi Pertama, BPFE, Yogyakarta.
- Trisetia Wijijayanti., 2009, "Analisis Pengaruh Minggu Perdagangan Terhadap Retur dan Volatilitas Saham Di Bursa Efek Indonesia (Dengan



Menggunakan Model Garch) ", Tesis, Fakultas Ekonomika dan Bisnis,
Universitas Gadjah Mada. Yogyakarta