

DAFTAR PUSTAKA

- Alteza, M. (2007). Efek Hari Perdagangan Terhadap Return Saham : Suatu Telaah atas Anomali Pasar Efisien. *Jurnal Ilmu Manajemen, Vol 3 No. 1* , 31-43.
- Ariefianto, M. D. (2012). *EKONOMETRIKA : Esensi dan Aplikasi dengan Menggunakan EVIEWS*. Penerbit Erlangga.
- Atkins, A. B., & Dyl, E. A. (1990). Price Reversal, Bid-Ask Spreads and Market Efficiency. *Journal of Financial and Quantitative Analysis, Vol.25* , 535-547.
- Aulia, N. N., Topowijono, & Sulasmiyati, S. (2016). Analisis Abnormal Return Saham Winner dan Saham Loser untuk mengidentifikasi Price Reversal. *Jurnal Administrasi Bisnis* , 32-40.
- Banz, R. (1981). The Relationship between Return and Market Value of Common Stocks. *Journal of Financial Economics* , 3-18.
- Cholid, & Achmadi, A. (1991). *Metode Penelitian*. Jakarta: Bumi Aksara.
- Cox, D. R., & Peterson, D. (1994). Stock Returns Following Large One Day Declines : Evidence on Short Term Reversals and Longer Term Performance. *Journal of Finance* , 255-267.
- De Bondt, W., & Thaler, R. (1985). Does The Stock Market Overreact? *Journal of Finance* , 793-805.
- Dinawan, M. R. (2007). Analisis Overreaction Hypothesis dan Pengaruh Firm Size, Likuiditas dan Bid-Ask Spread terhadap Fenomena Price Reversal di Bursa Efek Jakarta. *Tesis* .
- Dissanaike, G. (1997). Do Stock Market Investors Overreact? *Journal of Business and Accounting* , 27-49.
- Endri, D. (tanpa tahun). *Model Regresi Data Panel dan Aplikasi Eviews*. Retrieved April 21, 2018
- Fama, E. (1970). Efficient Capital Market : A Review of Theory and Empirical Work. *Journal of Finance* , 383-417.
- Fama, E. (1991). Efficient Capital Markets : II. *The Journal of Finance* , 1575-1617.

- Febryanti, E., & Asandimitra, N. (2014). Pengaruh Likuiditas, Bid-Ask Spread, Earning dan Firm Size terhadap Fenomena Price Reversal pada Saham Winner-Loser. *Jurnal Ilmu Manajemen Vol. 2* , 502-512.
- Gujarati, D. (2004). *Ekonometrika Dasar (Edisi Alih Bahasa Terjemahan)*. Jakarta: Erlangga.
- Heryana, T. (2016). Analisis Pembalikan Harga Saham di Indonesia Berbasis Overreaction Hypothesis, Ukuran Perusahaan, Likuiditas Saham dan Bid-Ask Spread. *Jurnal Riset Akuntansi dan Keuangan, Vol.4, No.3* , 125-144.
- Jogiyanto. (2014). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: Badan Penerbit Fakultas Ekonomi Universitas Gadjah Mada.
- Jogiyanto. (2008). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi. Edisi Ketiga*. Yogyakarta: Badan Penerbit Fakultas Ekonomi Universitas Gadjah Mada.
- Jones, C. P. (2014). *Investment : Principles and Concept, 12th Edition*. New York: John Wiley & Sons.
- Latjuba, R. P., & Pasaribu, R. B. (2013). Efek Bid-Ask, Firm Size, dan Likuiditas dalam Fenomena Price Reversal Saham Winner dan Loser Kelompok Entitas Indeks LQ-45 Periode 2009-2011 di Bursa Efek Indonesia. *Proceeding PESAT (Psikologi, Ekonomi, Sastra, Arsitektur & Teknik Sipil)*, (pp. 308-315). Bandung.
- Mutamimah. (2003). Analisis Struktur Modal pada Perusahaan-Perusahaan Non Finansial yang Go Public di Pasar Modal Indonesia. *Jurnal Bisnis Strategi, Vol 11* , 60-71.
- Park, J. (1995). A Market Microstructure Explanation for Predictable Variations in Stock Return Following Large Price Changes. *Journal of Financial and Quantitative Analysis* , 241-256.
- Pasaribu. (2011). Anomali Overreaction di Bursa Efek Indonesia : Penelitian Saham LQ-45. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis* , 87-115.
- Pratama, I. G., Purbawangsa, I. A., & Artini, I. G. (2016). Analisis Overreaction Pasar pada Saham Winner dan Loser di Bursa Efek Indonesia. *E-Jurnal Ekonomi dan Bisnis Universitas Udayana 5.12* , 4387-4414.
- Saputri, I. (2013). Pengaruh Firm Size, Bid-Ask Spread, dan Likuiditas Terhadap Fenomena Pembalikan Harga Saham di Bursa Efek Indonesia (Studi Empiris pada Emiten Indeks Kompas 100 di Bursa Efek Indonesia Periode 2008-2012. *Gunadarma University*. Depok.
- Sianipar, F., Riswan, & Widiastuti, E. (2017). Pengaruh Ukuran Perusahaan, Bid-Ask Spread dan Volume Perdagangan terhadap Price Reversal. 46-57.

Stoll. (1989). Inferring the Components of The Bid-Ask Spread : Theory of Empirical Tests. *Journal of Finance*, 44 , 115-134.

Suciningtyas, S. A. (2011). Gejala Overreaction pada Saham-Saham yang Tergabung dalam Jakarta Islamic Index di Bursa Efek Jakarta. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis*, Vol.12, No.1 , 58-76.

Sugiyono. (2013). *Statistika untuk Penelitian*. Bandung: Alfabeta.

Tandelilin, E. (2001). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Yogyakarta: Badan Penerbit Fakultas Ekonomi Universitas Gadjah Mada.

-----, <<http://www.idx.co.id>> [07/09/2017]

-----, <<http://www.idx.co.id>> [07/22/2018]

-----, <<http://www.sahamsyariah.com>> [07/09/2017]

-----, <<http://www.finance.yahoo.com>> [01/02/2018]