

DAFTAR PUSTAKA

- Ang, Robert. 1997. *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia*. Mediasoft Indonesia.
- Andry, Wydia. 2005. Analisis Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Prediksi Tingkat Obligasi. *Buletin Ekonomi Moneter dan Perbankan*. Vol. 8 No. 2. 239-258.
- Bharrdwaj, R.K. dan L.D. Books. 1992. *The January Anomaly Effects of Low Share Price, Transactions Costs, and Bid-ask*. *Journal of Finance*. 47.553-75.
- Bursa Efek Indonesia 2008*.
- Chan, Louis K.C., Yasushi Hamao dan Josef Lakonishok. 1991. *Fundamentals and Stock Returns in Japan*. *Journal of Finance*. 46. 1739-1789.
- Darmadji, T dan H.M. Fakhruddin. 2006. *Pasar Modal Indonesia: Pendekatan Tanya Jawab*. Jakarta: Salemba Empat.
- Davis, James L. dan A.S. Desai. 1998. *Stocks Returns, Beta and Firm Size: The Case of Bull, Bear and Flat Markets*. *Journal of Finance*. www.google.com. 25 November 2002.
- Fabozzi, Frank J. dan J.C. Francis. 1977. *Stability Tests For Alphas and Betas Over Bull and Bear Market Conditions*. *Journal of Finance*. Vol. XXXII. No. 4. September.
- Fama, Eugene dan Kenneth French. 1992. *The Cross Section of Expected Stock Returns*. *Journal of Finance*. Vol. XI. VII. No 2. Juni.
- Ghozali, Imam. 2006. *Aplikasi Analisis Multivariate Dengan Program SPSS*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Halim, Abdul. 2003. *Analisis Investasi*. Jakarta: Salemba Empat.

- Hasan, M. Iqbal. 2002. *Pokok-Pokok Materi Statistik 2 (Statistik Infernsif)*: Jakarta: Bumi Aksara.
- Husnan, Suad. 1998. *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Edisi 3. Yogyakarta: UPP AMP YKPN.
- Indrianto, N. dan B. Supomo. 1999. *Metodologi Penelitian Bisnis*. Yogyakarta: BPFE.
- Jauhari, Budi R. dan Basuki Wibowo. 2004. Analisis Fundamental Terhadap *Return Saham* pada Periode *Bullish* dan *Bearish* Indeks Harga Saham Gabungan. *Jurnal Akuntansi dan Keuangan*. Vol. 9 No. 2. 17-32.
- Jogiyanto. 2003. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi 3. BPFE. Yogyakarta.
- Jones, C.P. 1998. *Investment Analysis and Management*. 6th ed. John Willey & Sons. New York.
- Laksana, Yohanes P.J. 2005. Pengaruh Beberapa Faktor Fundamental Terhadap *Return Saham* pada Perusahaan-Perusahaan Otomotif dan Komponennya di PT. Bursa Efek Jakarta. *Tugas Akhir*. Semarang: Program Diploma III Pada Program Studi Keuangan dan Perbankan.
- Pramesti, Getut. 2006. *Panduan Lengkap SPSS 13.0*. Jakarta: PT. Elex Media Komputindo.
- Prayitno, Joko. 2007. Analisis Pengaruh *Price Earning Ratio*, *Price to Book Value* dan *Return On Equity* Terhadap *Return Saham* pada Industri *Real Estate* dan Properti di Bursa Efek Jakarta. *Tesis*. Jakarta: Program Pasca Sarjana Magister Manajemen Sekolah Tinggi Ilmu Ekonomi Ipwija.
- Rahina, Daniel Ngantu. 2003. Analisis Pengaruh Ukuran Perusahaan dan Beta Terhadap *Return Saham LQ-45* pada Pasar *Bullish* dan *Bearish* di Bursa Efek Jakarta Periode 1997-1999. *Tesis*. Semarang: Program Pasca Sarjana Magister Manajemen Universitas Diponegoro. Tidak Dipublikasikan.

- Samsul, Mohamad. 2006. *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Erlangga.
- Santoso, S dan F. Tjiptono. 2004. *Riset Pemasaran*. Jakarta: PT. Elex Media Komputindo.
- Santoso, Singgih. 2006. *Menggunakan SPSS untuk Stitistik Non Parametrik*. Jakarta: PT Elex Media Komputindo.
- Sulistiyastuti, Dyah R. 2002. *Saham dan Obligasi: Ringkasan Teori dan Soal Jawab*. Yogyakarta: UAJY.
- Sumekar, Kertati. 2003. Analisis Pengaruh *Size*, Beta, dan *Price to Book Value* Terhadap *Return* Saham (Studi pada Saham-Saham LQ45 di Bursa Efek Jakarta). *Tesis*. Semarang: Program Pasca Sarjana Magister Manajemen Universitas Diponegoro. Tidak Dipublikasikan.
- Tandelilin, Eduardus, 2001. Beta pada Pasar *Bullish* dan *Bearish* Studi Empiris di Bursa Efek Jakarta. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia*. Vol. 16 No. 3. 261-272.
- Wibowo, Ari. 2007. Perbandingan Kinerja Portofolio Saham LQ45 Periode *Bullish* dan *Bearish* (Studi di BEJ Periode Harian 1 Januari 2001-31 Desember 2007). *Tesis*. Semarang: Program Pasca Sarjana Magister Manajemen Universitas Diponegoro. Tidak Dipublikasikan.