

## DAFTAR PUSTAKA

- Abdul Halim, dan Nasuhi Hidayat. 2000. Studi Empiris Tentang Pengaruh Volume Perdagangan dan Return terhadap Bid-Ask Spread Saham Industri Rokok di Bursa Efek Jakarta Dengan Model Koreksi Kesalahan. *Jurnal Riset Akuntansi Indonesia*. Vol. 3. No. 1. Hal. 69 – 85.
- Amihud, Yakov dan Haim Mendelson. 1986. Asset Pricing and The Bid Ask Spread. *The Journal of Financial Economics* 17. Hal. 223-249.
- Amihud, Yakov dan Haim Mendelson. 1989. The Effects of Beta, Bid-ask Spread, Residual Risk, and Size on Stock Return. *The Journal of Finance*. Vol XLIV. No. 2. Hal. 479-486.
- Atkins, Allens B, dan Edward A Dyl. 1997. Transaction Cost and Holding Periods for Common Stocks. *The Journal of Finance*. Vol III, No. 1. Hal. 309-320.
- Collins, Bruce M, dan Frank J. Fabozzi. 1991. A Methology for Measuring Transaction Costs. *Financial Analysts Journal*. Hal. 27 – 36.
- Djarwanto. 2001. *Mengenal Beberapa Uji Statistik dalam Penelitian*. Edisi Dua. Yogyakarta : Penerbit Liberty
- Fabozzi, Frank J. 1995. *Investment Management*. New Jersey : Prentice Hall International Inc.
- Horngren, Charles T, et al. 1996. *Introduction to Financial Accounting*. Edisi Enam. New Jersey : Prentice Hall Upper Saddle River.
- Jogiyanto. 2000. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Dua. Yogyakarta : BPFE
- Jones, Charles P. 1996. *Investment Analysis and Management*. Edisi Lima. New York : John Wiley & Sons Inc.
- Keown., et al. 1996. *Basic Financial Management*. Edisi Ketujuh. Diterjemahkan oleh Chaerul D Djakman dan Dwi Sulistyorini. New Jersey: Prentice Hall Inc.
- Lenny dan Nur Indriantoro. 1999. “Analisa Pengaruh Transaction Cost Terhadap Lamanya Holding Period Saham Biasa”. *Jurnal bisnis dan akuntansi* , vol 1, No. 3. Hal. 209 – 220.
- Martono, dan Agus Harjito. 2002. *Manajemen Keuangan*. Yogyakarta : Penerbit Ekonisia Kampus Fakultas Ekonomi UII.

- Nachrowi Djalal Nachrowi, dan Hardius Usman. 2002. *Penggunaan Teknik Ekonometrika Pendekatan Populer & Praktis Dilengkapi Teknik Analisis & Pengolahan Data Dengan Menggunakan Paket Program SPSS*. Jakarta: PT Raja Grafindo Persada.
- Reilly, Frank K, dan Keith C Brown. 2000. *Investment Analysis and Portfolio Management*. Edisi Enam. USA : The Dryden Press.
- Sharpe, William F, et al. 1995. *Investments*. Fifth edition, New Jersey: Prentice Hall Inc.
- Singgih Santoso. 2001. *SPSS Versi 10; Mengolah Data Statistik Secara Profesional*. Edisi satu. Jakarta : PT Elex Media Komputindo.
- Stoll, Hans R, dan Robert Whaley. 1983. Transaction Cost and The Small Firm Effect, *Journal of Financial Economics*. No. 12, Hal. 57 – 80.
- Stoll, Hans R. 1989. Inferring The Component of The Bid-Ask Spread : Theory and Empirical Tests. *Journal of Finance*. Vol. XLIV. No. 1. Hal. 115 – 134.
- Sugiyono. 1999. *Statistika Untuk Penelitian*. Bandung : Penerbit CV. Alfabeta
- Watson., et al. 1993. *Statistics For Management and Economics*. Edisi Kelima. New Jersey: Prentice Hall Inc.
- Weston, J. Fred dan Thomas E. Copeland. 1992. *Managerial Finance*. Edisi Sembilan. Diterjemahkan oleh Jaka Wasana dan Kibandroko. Jakarta: Binarupa Aksara.
- Winger, Bernard J, dan Ralph R Fraska. 1995. *Investment, Introduction to Analysis and Planning*. Edisi Tiga. New Jersey : Prentice Hall Inc.