

DAFTAR PUSTAKA

- Ang, Robert. (1997). *“Buku Pintar: Pasar Modal Indonesia”*. Mediasoft Indonesia.
- Fama, E.F and French, K.R. (1992), *“The Cross-section of Expected Stock Returns”*, The Journal of Finance, vol. 47, pp. 427-465.
- . (1996), *“Multifactor Explanation of Asset-Pricing Anomalies”*, The Journal of Finance, vol.51, pp. 55-84.
- Hartono, Jogyanto. (2003), *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, BPFE Yogyakarta
- Husnan, Suad, (1996), *Dampak Pengumuman Laporan Keuangan Terhadap Kegiatan Perdagangan Saham dan Variabilitas Tingkat Keuntungan*, Kelola No. 11/V/1996.
- . (2003), *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*, Edisi kedua, BPFE Yogyakarta.
- Indonesia Stock Exchange, 2005, 2006, 2007, 2008, 2009, 2010. *IDX Monthly Statistics Review*.
- Putri, Maharani, *Empirical Evidence of Firm Size Effect on Stock’s Returns: Jakarta Stock Exchange year 2003-2007*, Institut Teknologi Bandung.
- Sekaran, Uma. (2006). *Metodologi Penelitian untuk Bisnis*, edisi 4 buku 1, Penerbit Salemba Empat, Jakarta.
- . (2006). *Metodologi Penelitian untuk Bisnis*, edisi 4 buku 2, Penerbit Salemba Empat, Jakarta.
- Setyadharma, Andryan. (2010). *Uji Asumsi Klasik dengan SPSS 16.0*, Fakultas Ekonomi UNNES, Semarang.

- Sugiyono, 2007. *Metode Penelitian Bisnis*, Penerbit CV Alpa Beta, Bandung.
- Tandelilin, Eduardus. (2001). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*, edisi 1, Yogyakarta: BPFU UGM.
- Uyanto, Stanislaus. (2006). *Pedoman Analisis Data dengan SPSS*, edisi 2, buku 1, penerbit Graha Ilmu, Jakarta.
- Wibowo, Experina, *Analisis Market Capitalization terhadap Return Saham tahun 2003-2009*, Institut Manajemen Telkom
- Yusof, Rohana. (2004). **Penyelidikan Sains Sosial**, PTS Publications & Distributors Sdn Bhd.

Website:

www.bi.go.id

www.e-bursa.com

www.finance.yahoo.com

www.google.com

www.idx.co.id

www.indofinanz.com