

## DAFTAR PUSTAKA

### Buku

- Ajija, Shochrul Rohmatul, dkk. (2011). *Cara Cerdas Menguasai Eviews*. Jakarta: Selemba Empat.
- Aziz, Dr. Musdalifah, et al. (2015). *Manajemen Investasi Fundamental, Teknikal, Perilaku Investor, dan Return Saham*. Grup Penerbitan CV BUDI UTAMA. Yogyakarta.
- Ang, Robert. (2001). *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia*. Mediasoft.com.
- Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. J. (2008). *Investments* (7th Edition ed.). New York: McGraw-Hill.
- Darmadji, T dan Fakhrudin. (2006). *Pasar Modal di Indonesia Pendekatan Tanya Jawab*. Jakarta: Salemba Empat.
- Darmadji & Fakhrudin. (2011). *Pasar Modal Indonesia*. Edisi Ketiga, Jakarta, PT. Salemba Empat.
- Elliyana, Ela. (2020). *Lembaga Keuangan Dan Pasar Modal*. Cetakan Pertama, Oktober 2020. Malang.
- Frank J. Fabozzi. (2009). *Finance: Capital Markets, Financial Management, and Investment Management*. Frank J. Fabozzi Series. Wiley Publisher. New Jersey.
- Ghozali, Imam. (2011). *Aplikasi Analisis Multivariate Dengan Program SPSS*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Ghozali, Imam. (2016). *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS*. Edisi 8. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Ghozali, I. (2017). *Model Persamaan Struktural Konsep Dan Aplikasi Program AMOS 24*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Hidayat, Dr. Wastam Wahyu. (2018). *Dasar-dasar Analisa Laporan Keuangan. Uwais Inspirasi Indonesia*. Cetakan Pertama, November 2018. Ds. Sidoharjo, Kec. Pulung, Kab. Ponogoro.
- Indonesia Stock Exchange. (2010). *Buku Panduan Indeks Harga Saham Bursa Efek Indonesia*.
- Jogiyanto. (2003). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Ketiga, Cetakan Pertama, Yogyakarta: BPFY-Yogyakarta.

- Putra, Andika Sutoro. (2018). *Anak Muda Miliarder Saham*. PT. Elex Media Komputindo. Jakarta.
- Rahardjo, Adisasmita. (2006). *Pembangunan Pedesaan dan Perkotaan*. Graha ilmu. Yogyakarta.
- Sheperis, C.J., Young, J.S., Daniels, M.H. (2010). *Counseling Research: Quantitative, Qualitative, and Mixed Methods*. 1st ed. Pearson Education, Inc.
- Sujarweni, W (2015). *Metodelogi Penelitian Bisnis dan Ekonomi*. Pustaka baru press. Yogyakarta.
- Sugiyono (2013). *Metode Penelitian Pendidikan Pendekatan Kuantitatif, Kualitatif dan R&D*. Bandung : Alfabeta.
- Sugiyono (2019). *Statistika untuk Penelitian*. Bandung : CV Alfabeta.
- Sugiyono (2002). *Metode Penelitian Administrasi R&D*. Bandung: Alfabeta.
- Sugiyono. (2017). *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif, dan R&D*. Bandung: Alfabeta.
- Sudijono, Anas. (2010). *Pengantar Statistik Pendidikan*. Jakarta: PT Raja Grafindo Persada.

## **Jurnal**

- Andiani, Ni Wayan Sekar, dan Gayatri. (2018). *Pengaruh Volume Perdagangan Saham, Volatilitas Laba, Dividend Yield, Dan Ukuran Perusahaan Pada Volatilitas Harga Saham*. E-Jurnal Akuntansi 24: 2148.
- Cecen, A. Aydin, et al. (2021). *High Frequency Trading And Stock Index Returns: A Nonlinear Dynamic Analysis*. <https://doi.org/10.1016/j.cnsns.2021.105710>.
- Febrianti, Sukma. (2018). *Analisis Perbandingan Kinerja Indeks Saham Syariah Dengan Indeks Saham Konvensional Periode 2015-2017 (Studi Kasus Pada JII dan LQ45)*. ISBN: 978-979-3649-99-3.
- Ginting, Suriani. (2018). *Pengaruh Likuiditas, Profitabilitas, Dan Leverage Terhadap Kebijakan Dividen Pada Perusahaan LQ45 Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2012-2016*. ISSN 2622-6421 Vol.8.
- Ma, Rui, et al. (2018). *Market Volatility, Liquidity Shocks, And Stock Returns: Worldwide Evidence*. Pacific-Basin Finance Journal 49 (2018) 164-199. <https://doi.org/10.1016/j.pacfin.2018.04.008>.

- Maknun, Lu'luil. (2010). *Analisis Pengaruh Frekuensi Perdagangan, Volume Perdagangan, Kapitalisasi Pasar, dan Trading Day terhadap Return saham Pada Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar Di BEI Periode Tahun 2006-2008*. Skripsi. Semarang: Fakultas Ekonomi Universitas Diponegoro.
- Nanda, Kumar Sudipta dan Barai, Parama (2020). *Effect Of Insider Trading On Stock Characteristics*. Asian Journal of Accounting Research. Vol. 6 No. 2,2021. DOI 10.1108/AJAR-09-2020-0089.
- Na'afi, Septiana. 2020. *Efektifitas Kebijakan OJK Terkait Buyback Saham Terhadap Perubahan IHSG di Masa Pandemi Covid-19*. Aghniya Jurnal Ekonomi Islam Vol. 2 No. 2.
- Niawaradila, Bila, et al. (2021). *Pengaruh Frekuensi Perdagangan, volume Perdagangan, Dan Kapitalisasi Pasar Terhadap Return Saham Perusahaan Manufaktur Yang Terdaftar Di BEI Periode 2016-2019*. E-Jurnal ECO BISMA (Jurnal Ekonomi, Bisnis, Dan Manajemen). Vol 8 No.1 Tahun 2021.
- Pratama, Ika Agustin Ayu dan Susetyo, Aris (2020). *Closing Price, Trading Volume Activity, Dan Volatilitas Return Saham Terhadap Bid-Ask Spread Pada Perusahaan LQ45 Tahun 2017*. Jurnal Ilmiah Mahasiswa Manajemen, Bisnis dan Akuntansi. Volume 2, No. 1, 2020.
- Pousette, Anders, et al. (2014). *The Effect of Trading Frequency, Trading Volume Activity, Market Capitalization on Stock Return*. Journal Of Implementation Science 39(1): 1-15.
- Rachmawati, H. (2017). *Pengaruh ROA, EPS, dan Harga Saham Terhadap Return Saham*. Jurnal Ilmu dan Riset Manajemen, Sekolah Tinggi Ilmu Ekonomi Indonesia (STIESIA). Surabaya, Vol 6 no.9 hal. 1-16.
- Rahmawati, Novia (2019). *Pengaruh Frekuensi Perdagangan Saham, Volume Perdagangan Saham, Suku Bunga, Dan Kurs Terhadap Return Saham (Studi Kasus Perusahaan Makanan Dan Minuman Yang Terdaftar Di BEI Tahun 2016-2018)*. Skripsi thesis, Universitas Muhammadiyah Surakarta.
- Rupande, Lorraine, et al. (2019). *Investor Sentiment And Stock Return Volatility: Evidence From The Johannesburg Stock Exchange*. Cogent Economics & Finance (2019), 7: 160233. <https://doi.org/10.1080/23322039.2019.1600233>.
- Tandelilin, E. (2017). *Pasar Modal Manajemen Portofolio & Investasi*. Depok: Kanisius.

- Wang, Zijun et al. (2018). *Dynamic Trading Volume and Stock Return Relation: Does It Hold out of Sample?*. International Review of Financial Analysis. Volume 58, July 2018, Pages 195-210. <https://doi.org/10.1016/j.irfa.2017.10.003>.
- Wibowo, Ari Rian, dan Hendratno. (2019). *Pengaruh Frekuensi Perdagangan Saham, Volume Perdagangan Saham, Dan Kapitalisasi Pasar Terhadap Return Saham Perusahaan Yang Berada Pada Indeks LQ45 Di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2013-2017*. e-Proceeding of Management. Vol.6, No.1 April 2019. ISSN : 2355-9357.
- Wirajaya, I. G. A. (2017). *Pengaruh Current Ratio, Debt To Equity Ratio, dan Return On Assets Pada Harga Saham*. E-Jurnal Akuntansi, 21(2), 1317-1345. <https://doi.org/10.24843/eja.2017.v21.i02.p17>.
- Yusra, Muhammad. (2019). *Pengaruh Frekuensi Perdagangan, Trading Volume Activity, Nilai Kapitalisasi Pasar, Harga Saham, Dan Trading Day Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Kosmetik Dan Keperluan Rumah Tangga Di Bursa Efek Indonesia*. Jurnal Akuntansi Dan Keuangan. Volume 7, Nomor 1, Februari 2019. ISSN : 230 1-4717.
- Qosi, Umul Baety. (2018). *Pengaruh Price Earning Ratio (PER), Debt To Equity Ratio (DER), Dan Return On Asset (ROA) Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Foods And Beverages Yang Terdaftar Di BEI Periode 2012-2016*. Skripsi (S1) thesis, Universitas Muhammadiyah Ponorogo.

### **Internet**

- Kristiano, Imanuel. 2022. “*Kenali Apa Itu Market Cap Beserta Jenis-jenis dan Cara Menghitungnya*”. <https://bmoney.id/blog/apa-itu-market-cap-117597>, diakses pada 28 September 2022.
- Lyman, Cornelia. 2021. “*Pengertian, Rumus, dan Cara Menghitung Trading Volume Activity (TVA)*”. <https://pintu.co.id/blog/cara-menghitung-trading-volume-activity-adalah>, diakses pada 10 Agustus 2021.

[www.idx.co.id](http://www.idx.co.id)