

DAFTAR PUSTAKA

- Ahmed, Huson Joher Ali, Ali Hasan dan Annuar M.D Nasir. 2015. The Relationship between Trading Volume, Volatility and Stock Market Return: A test of Mixed Distribution Hypothesis for A Pre-and Post Crisis on Kuala Lumpur Stock Exchange. *Investment Management and Financial Innovations*, Vol. 3 No. 1. Hal. 146-158.
- Alma, Buchari dan Donni Juni Priansa. 2014. *Manajemen Bisnis Syariah*. Bandung: Alfabeta.
- Arikunto, Suharsimi, 2015. *Prosedur Penelitian; Suatu Pendekatan Praktik*. Jakarta: Rineka Cipta.
- Beaver, W. H., J. Emeritus., M. McNichols., dan Z. Z Wang. 2015. We Thank Paul Reist and Nora Richardson for Their Assistance in Data Collection: We Assume Responsibility for Any Remaining Errors. *Jurnal Graduate School of Business*, Stanford University, Stanford, CA, USA.
- Fauziah, Rica. 2018. Analisis *Right Issue* terhadap *Abnormal Return* dan *Trading Volume Activity* (Studi kasus Bursa Efek Indonesia periode 2013-2017). *Skripsi*: UIN Yogyakarta.
- Ghozali, Imam. 2016. *Aplikasi Analisis Multivariete dengan Program IBM SPSS 21*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Hamidah, Sarah Maryadi dan Gatot Nazir Ahmad. 2018. Pengaruh Harga Saham, Volatilitas Harga Saham, dan Volume Perdagangan Saham terhadap *Bid-Ask Spread* Saham pada Perusahaan Sektor Pertambangan yang Terdaftar di ISSI Periode Juni 2016–Juni 2017. *Jurnal Riset Manajemen Sains Indonesia (JRMSI)*, Vol. 9 No. 1. hal. 147-169.
- Hasan, Syed Shabib-ul, Sumair Farooq dan Muhammad Muddassir. 2015. Stock Returns Indicators: Debt to Equity, Market Capitalization, Firm Size and Sales to Price. *Journal of Poverty, Investment and Development*, Vol. 16 No. 1. Hal. 25-33.
- Indriantoro, Nur dan Supomo Bambang. 2015. *Metodologi Penelitian Bisnis untuk Akuntansi dan Manajemen Edisi Pertama*. Yogyakarta: BPFE.
- Jiranyakul dan Komain. 2019. Dynamic relationship between stock return, trading volume, and volatility in the Stock Exchange of Thailand: does the US subprime crisis matter?. *Munich Personal RePEc Archive Paper* no. 73791. page. 1-13.
- Kasmir. 2014. *Analisis Laporan Keuangan*. Jakarta: Rajawali Pers.

- Khairudin dan Wandita. 2017. Analisis Pengaruh Rasio Profitabilitas, *Debt To Equity Ratio* (DER) dan *Price To Book Value* (PBV) terhadap Harga Saham Perusahaan Pertambangan di Indonesia. *Jurnal Akuntansi dan Keuangan*, Vol. 8 No. 1. hal. 68-84.
- Koesoemasari, Dian Safitri, Kunderu Hadiyanto, Sri Sundari dan Harsuti. 2017. Hubungan antara Volatilitas Harga Saham dan Volume Perdagangan Saham di Bursa Efek Indonesia. *Sustainable Competitive Advantage-7*. hal. 423-434.
- Milas, A. 2010. Reaksi Pasar Atas Secondary Right Issue pada Perusahaan yang Go Public di Indonesia. *Jurnal EMBA*, Vol. 1 No. 3. Hal. 10-25.
- Nasution, Latif Zubaidah dan Sulistyio. 2017. Pengaruh Volume Perdagangan Saham, Frekuensi Perdagangan Saham, Volatilitas Harga Saham, dan Kapitalsiasi Pasar terhadap *Return* Saham Perusahaan Makanan dan Minuman yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *Journal Riset Mahasiswa (JRMx)* 3, no. 5. hal. 1-28.
- Otieno, O.D., dan Dr. D.E Ochieng. 2015. The effects of Rights Issue Announcements on Stock Returns for Firms Listed at the Nairobi Securities Exchange. *International Journal of Education and Research*, Vol. 3 No. 9. Hal. 1-25.
- Salamat, Wasfi A, Al dan Heneen H.H. Mustafa. 2016. The Impact of Capital Structure on Stock Return: Empirical Evidence from Amman Stock Exchange. *International Journal of Business and Social Science*, Vol. 7 No. 9. Hal. 183-196.
- Samman, Hazem Al dan Mohamed Khaled al-Jafari. 2015. Trading Volume and Stock Returns Volatility: Evidence from Industrial Firms of Oman. *Asian Social Science*, Vol. 11, No. 24. Hal. 139-146.
- Sari, Linda Karlina, Noer Azam Achsani dan Bagus Sartono. 2017. Pemodelan Volatilitas *Return* Saham: Studi Kasus Pasar Saham Asia *Modelling Volatility of Return Stock Index: Evidence from Asian Countries*. *Jurnal Ekonomi dan Pembangunan Indonesia* 18, no. 1. hal. 35-52.
- Selpiana, Komang Ria dan Ida Bagus Badjra. 2018. Pengaruh Kebijakan Dividen, Nilai Tukar, *Leverage*, dan *Firm Size* terhadap Volatilitas Harga Saham. *E-Jurnal Manajemen* 7, no. 3. hal. 1682-1712.
- Silviyani, Ni Luh Nonik Tika, Edy Sujana dan I Made Pradana Adiputra. 2014. Pengaruh Likuiditas Perdagangan Saham dan Kapitalisasi Pasar terhadap *Return* Saham Perusahaan yang Berada pada Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia periode Tahun 2009-2013 (Studi Empiris pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia). *E-Journal S1 Ak Universitas Pendidikan Ganesha* 2, no. 1. hal. 1-11.

- Situmeang, Santa dan Harjum Muharam. 2015. Analisis Pengaruh Volatilitas Harga, Likuiditas Saham, EPS, *Size Firm*, *Momentum Overnight* terhadap *Return* Saham (Studi Kasus Perusahaan yang Terdaftar dalam Indeks LQ45 Periode 2009-2013). *Diponegoro Journal Of Management* 4, no. 3. hal. 1-12.
- Sugiyono. 2015. *Metode Penelitian Bisnis*. Bandung: Alfabeta.
- Sunyoto, Danang dan Fathonah Eka Susanti. 2015. *Manajemen Keuangan untuk Perusahaan*. Yogyakarta: CAPS (Center of Academic Publishing Service).
- Taslim, Ahmad dan Andhi Wijayanto. 2016. Pengaruh Frekuensi Perdagangan Saham, Volume Perdagangan Saham, Kapitalisasi Pasar dan Jumlah Hari Perdagangan terhadap *Return* Saham. *Management Analysis Journal* 5, no. 1. hal. 1-6.
- 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* 6, no. 1. hal. 336-40.
- Yusra, Muhammad. 2019. Pengaruh Frekuensi Perdagangan, Trading Volume, 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* 7, no. 1.