

## DAFTAR PUSTAKA

- [1] M. Universitas and M. Prof, “PENGARUH VOLUME PERDAGANGAN SAHAM DAN UKURAN PERUSAHAAN TERHADAP RETURN SAHAM PERUSAHAAN YANG TERDAFTAR PADA INDEKS LQ45,” *PENGARUH Vol. Perdagang. SAHAM DAN UKURAN Perusah. TERHADAP RETURN SAHAM Perusah. YANG TERDAFTAR PADA Indeks LQ45*, pp. 48–59, 2019.
- [2] N. Luh, N. Tika, E. Sujana, and I. M. P. Adiputra, “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 ),” no. 1, 2014.
- [3] M. Yusra, “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,” *PENGARUH FREKUENSI Perdagang. , TRADING Vol. NILAI Kap. PASAR, HARGA SAHAM, DAN TRADING DAY TERHADAP RETURN SAHAM PADA Perusah. Kosmet. DAN KEPERLUAN RUMAH TANGGA DI BURSA EFEK Indones.*, vol. 7, no. 1, p. 65, 2019, doi: 10.29103/jak.v7i1.1841.
- [4] R. Novianti and L. Chalid, “PARADOKS : JURNAL ILMU EKONOMI Volume 4 . No . 2 ( 2021 ); April Pengaruh Nilai Tukar Rupiah , Inflasi dan

Volume Perdagangan Terhadap Return Saham ( Studi Kasus Pada Perusahaan Perbankan yang Listing di IDX ),” *Pengaruh Nilai Tukar Rupiah, Inflasi dan Vol. Perdagang. Terhadap Return Saham (Studi Kasus Pada Perusah. Perbank. yang List. di IDX*, vol. 4, no. 2, 2021.

- [5] N. K. Suriyani and G. M. Sudiartha, “Pengaruh Tingkat Suku Bunga, Inflasi Dan Nilai Tukar Terhadap Return Saham Di Bursa Efek Indonesia,” *E-Jurnal Manaj. Univ. Udayana*, vol. 7, no. 6, p. 255328, 2018, doi: 10.24843/EJMUNUD.2018.v07.i06.p12.
- [6] E. D. Purnamasari and A. L. Desitama, “Analisis Return Saham Perusahaan Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Pada Masa Covid-19,” *J. Akunt. Netral, Akuntabel, Objekt.*, vol. 4, no. 1, pp. 630–639, 2021.
- [7] S. Sutopo, B. S. Kefi, and A. Hariyanto, “Analisis Pola Return Saham Pada Masa Pandemi Covid-19 Di Bursa Efek Indonesia,” *J. Ekon. Manaj. dan Akunt.*, no. 50, 2021.
- [8] M. Yang, T. Di, and B. E. I. Periode, “Vol 8 No. 1 Tahun 2021,” *PENGARUH FREKUENSI PERDAGANGAN, Vol. PERDAGANGAN, DAN Kap. PASAR TERHADAP RETURN SAHAM Perusah. MANUFAKTUR YANG TERDAFTAR DI BEI PERIODE 2016-2019 Bila*, vol. 8, no. 1, pp. 122–138, 2021.
- [9] P. Saham, K. Pasar, and D. A. N. Jumlah, “PERDAGANGAN VOLUME,” *PENGARUH FREKUENSI Perdagang. SAHAM, Vol. Perdagang. SAHAM, Kap. PASAR DAN JUMLAH HARI Perdagang. TERHADAP RETURN*

*SAHAM Ahmad*, vol. 5, no. 1, pp. 1–6, 2016.

- [10] F. Ekonomi, “Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui seberapa besar pengaruh frekuensi 1) perdagangan, volume perdagangan, dan kapitalisasi pasar baik secara parsial maupun simultan terhadap return saham pada sektor pariwisata yang terdaftar di BEI,” vol. 2, no. 1, pp. 73–84, 2021.
- [11] A. S. R. I. Wahyudi, “ANALISIS PENGARUH KAPITALISASI PASAR DAN RASIO KEUANGAN,” *Anal. PENGARUH Kap. PASAR DAN RASIO Keuang. TERHADAP RETURN SAHAM*, vol. 12, no. 1, pp. 9–16, 2020.
- [12] I. Iswajuni, A. Manasikana, and S. Soetedjo, “The effect of enterprise risk management ( ERM ) on firm value in manufacturing companies listed on Indonesian Stock Exchange year 2010-2013,” vol. 3, no. 2, pp. 224–235, 2018, doi: 10.1108/AJAR-06-2018-0006.
- [13] E. Yang, T. Di, and B. E. I. Periode, “PENGARUH GROWTH OPPORTUNITY , PROFITABILITY , BUSINESS RISK DAN SIZE TERHADAP STRUKTUR MODAL ( Studi Pada Perusahaan Property dan Real BUSINESS RISK DAN SIZE TERHADAP STRUKTUR MODAL ( Studi Pada Perusahaan Property dan Real Estate Yang Terdaftar Di BEI,” no. January, 2020, doi: 10.32493/frkm.v2i3.3401.
- [14] U. A. Dahlan, W. A. Darussalam, V. Herawaty, and U. Trisakti, “PERUSAHAAN DENGAN GOOD CORPORATE,” vol. 1, no. 1, pp. 313–324, 2019.

- [15] P. Profitabilitas, R. Bisnis, D. A. N. Tingkat, S. Ketut, and S. Dewi, “BUNGA TERHADAP STRUKTUR MODAL ( Perusahaan Transportasi Periode 2012-2015 ) Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Udayana , Bali , Indonesia Email : puspitaira6@gmail.com ABSTRAK Modal merupakan bagian yang penting dalam mendukung aktivitas yang terjadi,” vol. 8, no. 4, pp. 2152–2179, 2019.
- [16] “The 12,” pp. 1–22.
- [17] I. Zuhroh, “The Effects of Liquidity , Firm Size , and Profitability on the Firm Value with Mediating Leverage,” vol. 2019, pp. 203–230, 2019, doi: 10.18502/kss.v3i13.4206.
- [18] L. Li and S. Z. Islam, “Firm and industry specific determinants of capital structure: Evidence from the Australian market,” *Int. Rev. Econ. Financ.*, 2018, doi: 10.1016/j.iref.2018.10.007.
- [19] F. Krisdayanti and T. Zakiyah, “Pengaruh Harga Saham , Return Saham , Volume Perdagangan , dan Risiko Return Saham Terhadap Bid Ask Spread pada Perusahaan di Indeks LQ45,” *Pengaruh Harga Saham, Return Saham, Vol. Perdagangan, dan Risiko Return Saham Terhadap Bid Ask Spread pada Perusah. di Indeks LQ45*, vol. 3, no. April, pp. 275–289, 2021.
- [20] N. Oliveira, P. Cortez, and N. Areal, “Impact of data microblogging for stock market prediction,” 2016.
- [21] R. N. Khoirayanti and H. Sulistiyo, “Pengaruh Harga Saham, Volume Perdagangan, Dan Frekuensi Perdagangan Terhadap Bid-Ask Spread,”

- JIAFE (Jurnal Ilm. Akunt. Fak. Ekon.,* vol. 6, no. 2, pp. 231–240, 2020, doi: 10.34204/jiafe.v6i2.2305.
- [22] L. Maknun, “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,” *Diponegoro Univ. Institutional Repos.*, pp. 51–56, 2010.
- [23] W. Jung and M. Kang, “The short-term mean reversion of stock price and the change in trading volume,” *J. Deriv. Quant. Stud. 선물연구*, vol. 29, no. 3, pp. 190–214, 2021, doi: 10.1108/jdqs-01-2021-0003.
- [24] E. A. U. Udayana, “Pengaruh Profitabilitas, Pertumbuhan Perusahaan, Kapitalisasi Pasar Dan Kepemilikan Saham Publik Pada Tingkat Pengungkapan Csr,” *E-Jurnal Akunt.*, vol. 20, no. 2, pp. 1219–1248, 2017, doi: 10.24843/EJA.2017.v20.i02.p13.
- [25] J. Stie, S. Vol, and E. Februari, “No Title,” vol. 9, no. 1, pp. 72–80, 2017.
- [26] P. K. Yadav, K. Paudyal, and P. F. Pope, “Non-linear dependence in stock returns: Does trading frequency matter?,” *J. Bus. Financ. Account.*, vol. 26, no. 5–6, pp. 651–679, 1999, doi: 10.1111/1468-5957.00270.
- [27] D. Achjari, “Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia Vol 14 No . 1 Tahun 1999,” *J. Ekon. dan Bisnis Indones.*, vol. 14, no. 1, p. 15, 1999.
- [28] N. Indriastuti, Ariyani dan Zumrotun, “134235-ID-pengaruh-volume-perdagangan-kurs-dan-ris.pdf,” vol. 9, no. 1, pp. 72–80, 2017.

- [29] F. Ekonomi and U. Pamulang, "PENGARUH VOLUME PERDAGANGAN , DIVIDEN PAYOUT RATIO , DAN INFLASI TERHADAP VOLATILITAS HARGA SAHAM PADA," pp. 167–178, 2018.
- [30] S. L. Andes, Z. Puspitaningtyas, and D. A. Prakoso, "8-16 Dokumen diterima pada Sabtu," *J. Akunt. Keuang. dan Bisnis*, vol. 10, no. 2, pp. 8–16, 2017, [Online]. Available: <http://jurnal.pcr.ac.id>.
- [31] N. Indriastuti, "Pengaruh Volume Perdagangan, Kurs Dan Risiko Pasar Terhadap Return Saham," *J. Chem. Inf. Model.*, vol. 53, no. 9, pp. 1689–1699, 2017.
- [32] J. Jefri, E. S. Siregar, and D. Kurnianti, "Pengaruh ROE, BVPS, dan Volume Perdagangan Saham Terhadap Return Saham," *J. PROFIT Kaji. Pendidik. Ekon. dan Ilmu Ekon.*, vol. 7, no. 2, pp. 101–112, 2020, doi: 10.36706/jp.v7i2.11875.
- [33] R. Handayani and N. R. Zulyanti, "Pengaruh Earning Per Share (Eps), Debt To Equity Ratio, (Der), Dan Return on Assets (Roa) Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Manufaktur Yang Terdaftar Di Bei," *J. Manaj.*, vol. 3, no. 1, p. 615, 2018, doi: 10.30736/jpim.v3i1.143.
- [34] N. L. Suryani, "Pengaruh Lingkungan Kerja Non Fisik Dan Komunikasi Terhadap Kinerja Karyawan Pada PT. Bangkit Maju Bersama Di Jakarta," *JENIUS (Jurnal Ilm. Manaj. Sumber Daya Manusia)*, vol. 2, no. 3, p. 419, 2019, doi: 10.32493/jjsdm.v2i3.3017.

- [35] M. Yusra, “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,” *J. Akunt. dan Keuang.*, vol. 7, no. 1, p. 65, 2019, doi: 10.29103/jak.v7i1.1841.
- [36] A. T. Ratnawati, “The Effect of Trading Volume Activities , Earning Per Share and Stock Returns on Market Value Added ( Empirical Study on LQ45 Companies ),” vol. 8, no. 2, pp. 79–82, 2021, doi: 10.14445/23939125/IJEMS-V8I2P111.
- [37] Sugiyono, “Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif dan R&D. Bandung: PT Alfabet.,” *Sugiyono. (2017). Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif dan R&D. Bandung: PT Alfabet.*, vol. 53, no. 9. pp. 1689–1699, 2017, doi: 10.1017/CBO9781107415324.004.
- [38] “2), 3),” no. Idx, 2019.
- [39] C. Apriyanti and M. Z. Hamzah, “Pengaruh Kinerja Keuangan, Ukuran Perusahaan, Dan Struktur Aktiva Terhadap Struktur Modal Perusahaan (Studi Kasus pada Perusahaan Manufaktur Sektor Industri Barang Konsumsi yang Terdaftar di BEI Tahun 2010-2015),” *J. Econ. Bus. Indones.*, vol. 12, no. 1, pp. 82–101, 2017.
- [40] A. R. Dharmawan, P. Studi, E. Pembangunan, F. Ekonomi, D. A. N. Bisnis, and U. M. Surakarta, “Analisis penyerapan tenaga kerja pada industri kecil di kabupaten ngawi,” pp. 1–8, 2019.

- [41] K. Konsumen and B. Autoworks, "Pendapatan Best Autoworks."
- [42] R. R. Fahlevi, S. Asmapane, and B. Oktavianti, "Pengaruh kinerja keuangan terhadap harga saham pada perusahaan perbankan yang terdaftar di bursa efek indonesia The effect of financial performance on stock prices on banking companies listed on the stock exchange of Indonesia," *Akuntabel*, vol. 15, no. 1, pp. 39–48, 2018.
- [43] A. T. Basuki and N. Prawoto, "Analisis Regresi dalam Penelitian Ekonomi dan Bisnis," *Depok PT Rajagrafindo Persada*, pp. 1–239, 2015.
- [44] N. Wulandari, "Analisis Faktor-faktor yang Mempengaruhi Inflasi pada Kota Metropolitan di Indonesia dengan Menggunakan Analisis Data Panel," *J. Sains Mat. dan Stat.*, vol. 3, no. 2, pp. 34–42, 2017.
- [45] I. Ghozali, *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS 25*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro, 2018.
- [46] B. Niawaradila, G. Wiyono, and A. Maulida, "Pengaruh Frekuensi Perdagangan, Volume Perdagangan, Dan Kapitalisasi Pasar Terhadap Return Saham Perusahaan Manufaktur Yang Terdaftar Di Bei Periode 2016-2019," *Ecobisma (Jurnal Ekon. Bisnis Dan Manajemen)*, vol. 8, no. 1, pp. 122–138, 2021, doi: 10.36987/ecobi.v8i1.2078.
- [47] T. I. Sari and S. Susilawati, "Analisis Monday Effect, Weekend Effect Dan Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham Pada Kelompok Saham Indeks Lq 45 Di Bursa Efek Indonesia Periode Februari 2017 - Januari 2018," *J. Profiet*, vol. 2, no. 46, pp. 141–147, 2018.