

DAFTAR PUSTAKA

- Agus Tri Basuki and Prawoto, N. (2017). *Analisis Regresi Dalam Penelitian Ekonomi & Bisnis : Dilengkapi Aplikasi SPSS & EVIEWS*. Depok: PT Rajagrafindo Persada.
- Ahmad Taslim, A. W. (2016). Pengaruh Frekuensi Perdagangan Saham, Volume Perdagangan Saham, Kapitalisasi Pasar Dan Jumlah Hari Perdagangan Terhadap Return Saham. *Management Analysis Journal*, 5. No. 1.
- Aini, N. F. (2019). Pengaruh Ukuran Perusahaan, Earning Per Share Dan Leverage Terhadap Return Saham. *Artikel Ilmiah*.
- Aldi Kosasi, P. (2017). Analisis Pengaruh Book To Market Equity, Firm Size, Market Value Added (Mva), Momentum, Dan Trading Volume Terhadap Return saham (Studi Kasus Perusahaan Yang Terdaftar Dalam Indeks LQ-45 Periode 2012 - 2016). *E-Jurnal Undip*.
- Alex Tumpal Hutajulu, E. P. (2019). Analisis Pengaruh Camp Beta, Firm Size, Book To Market Ratio, Dan Momentum Terhadap Return Saham. *Journals.Telkomuniversity.Ac.Id*.
- Amaliya Rizqiyana, E. D. A. (2019). Pengaruh Ambiguity, Market Risk Premium, Market To Book, Size, Dan Momentum Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Yang Terdaftar Dalam Indeks LQ45 Periode 2017-2018. *Diponegoro Journal of Management*.
- Anton Astakhov, Tomas Havranek, and J. N. (2019). Firm Size And Stock Returns: A Quantitative Survey. *Institute of Economic Studies, Faculty of Social Sciences Charles University in Prague*.
- Brigham, Eugene F dan Houston, J. F. (2010). *Dasar-Dasar Manajemen Keuangan* (II. Buku 2). Jakarta: Salemba Empat.
- Dasuki, T. M. S. (2020). Pengaruh Arus Kas Operasi, Firm Size, Dan Momentum Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Yang Terdaftar Dalam Indeks LQ 45 Periode 2014–2018 Di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Akuntansi Keuangan*

Dan Sistem Informasi (JAKSI), Vol 1.

Dedi Setiawan. (2016). Pengaruh Volume Perdagangan Terhadap Return Saham Dengan Trading Day Sebagai Variabel Moderating Pada Perusahaan Property Dan Realestate Di Bursa Efek Indonesia periode 2010-2014. *Universitas Syiah Kuala.*

Desi Kurniyati, dan H. B. (2016). Pengaruh Financial Leverage, Volume Perdagangan Saham, Laba Perusahaan, Dan Arus Kas Operasi Terhadap Return Saham pada perusahaan manufaktur di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Akuntansi Dan Keuangan.*

Devaki, A. Faktor-faktor yang Mempengaruhi Return Saham pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia. 2017, No. 2.

Dian Purwandari. (2018). Pengaruh Price Earning Ratio, Dividend Yield, Market To Book Ratio, Return On Equity, Dan Earning Per Share Terhadap Return Saham Pada Industri Manufaktur Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia. *Buana Akuntansi, 3.* No 2.

Dimaranty, O. (2019). Analysis Of The Effect Of Curency Exchange, Profitability, Debt, And Company Size On Stock Retrurns (Case Study Of Companies Listed On Idx In Plantation Sub Sector). *Jurnal Ilmiah Manajemen,* No. 7.

Edwin Moyo, Antony Gichuhi Waititu, A. N. (2018). Modelling the Effects of Trading Volume on Stock Return Volatility Using Conditional Heteroskedastic Models. *Journal of Finance and Economics,* Vol. 6.

Eisenhardt, K. (1989). Agency Theory: An Assesment and Review. *Academy of Management Review,* No. 14.

Erdianza Septian Efendi, S. B. H. (2017). Pengaruh Volume Perdagangan Saham Dan Ukuran Perusahaan Terhadap Return Saham Perusahaan Yang Terdaftar Pada Indeks LQ45. *Jurnal Ilmu Dan Riset Akuntansi,* Vol. 6.

Erwin Dyah Astawinetu, S. H. (2020). *Teori Portofolio dan Pasar Modal Indonesia.* Scopindo Media Pustaka.

- Evi Suryani. (2019). Pengaruh Volume Perdagangan Saham Terhadap Return Saham Syariah Pada Perusahaan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia. *Uinbanten.ac.id*.
- Fahrhun Rizaldi. (2019). Pengaruh ROA, Ukuran Perusahaan, Dan Volume Perdagangan Saham Terhadap Return Saham (Studi Kasus Pada Perusahaan Food and Beverage Yang Terdapat di Bursa Efek Indonesia Tahun 2013-2017). *Repository.Mercubuana.ac.id*.
- Ferhat Husein, M. K. M. (2015). Analisis pengaruh distress risk, firm size, book to market ratio, return on assets, dan debt equity ratio terhadap return saham. *Diponegoro Journal of Management*, No. 4.
- Ghozali, I. (2016). *Aplikasi Analisis Multivariate Dengan Program IBM SPSS 23* (8. Cetakan). Semarang: Universitas Diponegoro.
- Habsari, A. (2017). Ukuran Perusahaan, Profitabilitas dan Nilai Perusahaan: Studi Empirik: Perusahaan Sektor Pertambangan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2011 sampai dengan 2015). In *Tirtayasa EKONOMIKA*.
- Hery. (2017). *Kajian Riset Akuntansi*. Jakarta: Grasindo.
- Ivan Alexander Nanlohy, Putu Anom Mahadwartha, A. H. (2018). Pengaruh Karakteristik Saham Terhadap Return Pada Perusahaan Industri Barang Konsumen. *Journal of Management and Business*, Vol. 17.
- Jensen, M. C. dan W. H. M. (1976). Theory of the firm: Managerial behavior, agency cost and ownership structure. *Journal of Finance Economic*, 3:305-360.
- Jiranyakul, K. (2016). Dynamic relationship between stock return, trading volume, and volatility in the Stock Exchange of Thailand. *Munich Personal RePEc Archive*.
- Jogiyanto, H. (2016). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFY-Yogyakarta.
- Jogiyanto, H. (2017). *Teori Portofolio Dan Analisis Investasi* (Edisi 10). Yogyakarta: BPFY.

- Justice Kyei-Mensah. (2019). Stock liquidity, firm size and return persistence around mergers and acquisitions announcements. *Investment Management and Financial Innovations*, Vol 16.
- Justina, D. (2017). Pengaruh Firm Size dan Market to Book Ratio terhadap Return Portofolio. *Jurnal Manajemen Dan Bisnis Sriwijaya*, 15.
- Kasmir. (2016). *Pengantar Manajemen Keuangan (II)*. Jakarta: Prenada Media.
- Kosasi, A. (2017). Prasetiono Analisis Pengaruh Book To Market Equity, Firm Size, Market Value Added (Mva), Momentum, Dan Trading Volume Terhadap Return Saham (Studi Kasus Perusahaan Yang Terdaftar Dalam Indeks Lq-45 Periode 2012 S/D 2016). *Diponegoro Journal of Management*, 6 (4).
- Kristanto, M. E., & Idris. (2016). Analisis Pengaruh Inflasi, Kurs, Dan Suku Bunga Terhadap Pergerakan Bersama Return saham IHSG Dan Volume Perdagangan Periode Januari 2006 – Desember 2015. *DIPONEGORO Journal of Management*, 5(3), 1–15.
- Marcelo Bianconi, J. A. Y. 2017. (2017). *Valuation of the Worldwide Commodities Sector: The Role of Market-To-Book and Return on Equity*.
- Nasution, L. Z. (2016). 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. *Fakultas Ekonomika Dan Bisnis Universitas Kanjuruhan Malang*.
- Ni Luh Putu Suryani Ulan Dewi, I. G. M. S. (2019). Pengaruh Profitabilitas, Likuiditas, Leverage, Dan Ukuran Perusahaan Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Food And Beverage. *E-Jurnal Manajemen*, Vol. 8.
- Ningsih, V. S. (2016). Pengaruh Price Earning Ratio, Dividend Yield, Book to Market Ratio Dan Audit Quality Terhadap Return Saham. *Journal Riset Mahasiswa Akuntansi (JRMA)*, xx.
- Noor, J. (2017). *Metodologi Penelitian: Skripsi, Tesis, Disertasi & Karya Ilmiah*

(Edisi 7.). Jakarta: Kencana.

- Novirman, A. A. (2019). Pengaruh Volume Perdagangan, Frekuensi Perdagangan, Kapitalisasi Pasar, Dan Dividend Payout Ratio Terhadap Return Saham Jakarta Islamic Index. *Skripsi*.
- Nur Mahfudh Febriansyah, Ronny Malavia Mardan, A. A. P. (2018). Pengujian Fama French Three Factor Model's Dalam Mempengaruhi Return Saham Studi Kasus Pada Saham LQ45 Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2015-2016. *E – Jurnal Riset Manajemen*.
- Phuoc, N. T. D. and N. P. H. (2016). The Relationship between Firm Sizes and Stock Returns of Service Sector in Ho Chi Minh City Stock Exchange. *Review of European Studies*, Vol. 8.
- Pramudya, W., & Zahro, N. I. (2018). Analisis Pengaruh Earning Quality dan Market to Book Ratio terhadap Return Saham (Studi pada Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar pada Bursa Efek Indonesia). *Wahana*, 17(1), 43–50.
- Putra, I. M. G. D., & Dana, I. M. (2016). Pengaruh Profitabilitas, Leverage, Likuiditas Dan Ukuran Perusahaan Terhadap Return Saham Perusahaan Farmasi Di BEI. *E-Jurnal Manajemen Unud*, Vol. 5.
- Rahma, A. A. (2017). Analisis Perbandingan Return Saham Dan Volume Perdagangan Saham Sebelum Dan Sesudah Right Issue. *Majalah Ilmiah UPI YPTK*.
- Rebeca Cordeiro da Cunha Araújo. (2017). Book-To-Market Ratio, Return On Equity And Brazilian Stock Returns”. *RAUSP Management Journal*, Vol. 53
- Riesdiana, V. dan H. W. O. (2015). Pengaruh Rasio Keuangan dan Ukuran Perusahaan Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Farmasi Jurnal. *Ilmu Dan Riset Manajemen*.
- Rismansyah. (2016). Pengaruh Rasio Keuangan Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Property dan Real Estate Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI). 12(3), 18–32.

- Rohmah, R. (2019). Pengaruh Keputusan Investasi, Keputusan Pendanaan, Dan Kinerja Keuangan Terhadap Harga Saham (Studi pada Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di BEI). *Jurnal Kewiraan, Akuntansi, Dan Manajemen Tri Bisnis*.
- Sanjaya Yohanes. (2017). Pengaruh Kebijakan Dividen, Volume Perdagangan Saham, Leverage, Dan Profitabilitas Terhadap Return Saham.
- Sri maryana. (2019). *Pengaruh Book to Market Ratio Dan ROE Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Yang Terdaftar Di JII*.
- Suganda, T. R. (2018). *Teori dan Pembahasan Pasar Modal Indonesia* (Edisi I). Malang, Jawa Timur: Tim Seribu Bintang.
- Sugiharti, E. W. (2019). Analisis Pengaruh Inflasi, Suku Bunga, Dan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Manufaktur Di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Education and Economics*, Vol. 02.
- Sugiyono. (2017). *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif, dan R&D*. Bandung: Alfabeta, CV.
- Sustrianah. (2020). Pengaruh Volume Perdagangan Saham Dan Ukuran Perusahaan Terhadap Return Saham Perusahaan Yang Terdaftar Pada Indeks LQ45. *Ekonomi Dan Manajemen*, Vol. 6.
- Taunay, E. G. P. (2019). Analisis Pengaruh Nilai Tukar Rupiah, Inflasi, Volume Perdagangan, Suku Bunga Terhadap Return Saham (Studi Kasus Pada Saham di Bursa Efek Indonesia Periode Januari 2012 sampai Desember 2015). *Jurnal Penelitian Ekonomi Dan Akuntansi (JPENSI)*, Vol. 4.
- Vivi Seftya Ningsih, Abdul Halim, R. W. (2016). Pengaruh Price Earning Ratio, Dividend Yield, Book To Market Ratio Dan Audit Quality Terhadap Return Saham. *Journal Riset Mahasiswa Akuntansi (JRMA)*, xx.
- Wahyuliantini, N. M. (2016). Pengaruh Harga Saham, Volume Perdagangan Saham, Dan Volatilitas Return Saham Pada Bid-Ask Spread. *Jurnal Manajemen, Strategi Bisnis Dan Kewirausahaan*, 9 (2), 146–155.

Wasfi A. Al Salam, H. H. H. M. (2016). The Impact Of Capital Structure On Stock Return: Empirical Evidence From Amman Stock Exchange Following are the essential conclusions reached through the research empirical analysis. *International Journal of Business and Social Science*, Vol. 7

Winari, A. A. (2016). Pengaruh Trading Volume Activity, Cash Flow Operation, Return On Assets, Current Ratio Dan Debt To Equity Ratio Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Sektor Properti Dan Real Estate Di Bei Periode 2010–2014. *Diponegoro Journal of Management*, Vol. 5.

Winda Safitri Pramusinta, E. D. A. (2016). Analisis Pengaruh Distress Risk, Size, Book To Market, Dan Moementum Terhadap Return Saham (Studi pada Perusahaan Sektor Industri Dasar dan Industri Barang Konsumsi periode 2009-2014). *Diponegoro Journal of Management*, Vol. 5.

www.bursa.efek.indonesia.

www.bps.go.id 2019.

www.idx.co.id.

www.kontan.co.id

www.katadata.co.id.

www.sahamok.com.

Yangyi Yiu, Chuan Si, X. L. (2018). *Refined Book-to-Market Ratio and the Cross-Section of Stock Returns in China*.

Yusra, M. (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. *Akuntansi Dan Keuangan*, Vol 7.

Zulfikar. (2016). *Pengantar Pasar Modal Dengan Pendekatan Statistika*.(Edisi 1). Yogyakarta: Deepublish.