

## DAFTAR PUSTAKA

- Agustinus, Gumanti, T. A., Mufidah, A., & Tuhelelu, A. (2013). *Volume Perdagangan, Frekuensi Perdagangan, Order Imbalance dan Volatilitas Harga Saham*. Jurnal Universitas Paramadina, Vol. 10 No.
- Ang, Robert. (1997). *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia*. Edisi Pertama. Jakarta: Mediasoft Indonesia.
- Anoraga, P. 2003. *Pengantar Pasar Modal*. Jakarta: PT Rineka Cipta.
- Azura, S. N. A., Sofia, M., & Nurhasanah. (2018). Januari 2018. *Faktor - Faktor Yang Mempengaruhi Volatilitas Harga Saham Pada Perusahaan Manufaktur Yang Tercatat Di Bursa Efek Indonesia Tahun 2012-2016*, 1–20.
- Bailey, Warren, Jun Cai, Yan Leung Cheung, and Fenghua Wang. 2006. “*Stock Returns , Order Imbalances , and Commonality : Evidence on Individual , Institutional , and Proprietary Investors in China.*”
- Basuki, Agus Tri and Prawoto, Nano. 2016. *Analisis Regresi Dalam Penelitian Ekonomi & Bisnis : Dilengkapi Aplikasi SPSS & EVIEWS*. Depok : PT Rajagrafindo Persada
- Brigham, F dan Houston, J. 2001. *Dasar-Dasar Manajemen Keuangan*. Edisi 8, Buku 2. Jakarta: Salemba Empat.
- Buana, R. D. T., Tan, E. R., & Ferrinadewi, E. (2017). *Pengaruh Volume, Frekuensi Perdagangan, dan Interest Rate Terhadap Volatilitas Saham Sektor Properti LQ45 di BEI Periode 2016*. Applied Science National Seminar, 1(1), C16-1-C16-6.
- Chan, K., & Fong, W. M. (2000). *Trade size, order imbalance, and the volatility-volume relation*. Journal of Financial Economics, 57(2), 247–273.
- Chordia, T., & Subrahmanyam, A. (2004). *Order imbalance and individual stock returns: Theory and evidence*. Journal of Financial Economics, 72(3), 485–518.
- Darmadji, Tjiptono & Fakhruddin ,H. M.. (2001). *Pasar Modal di Indonesia*. Jakarta: Salemba Empat.
- Darmawan, Deni. (2014). *Metode Penelitian Kuantitatif*. Bandung: PT Remaja Rosdakarya.
- Dewi, S., & Paramita, R. A. S. (2019). *Pengaruh Kebijakan Dividen, Volume Perdagangan, Earning Volatility, Leverage, Dan Firm Size Terhadap Volatilitas Harga Saham Perusahaan Lq45*. Jurnal Ilmu Manajemen, 7, 761–771.
- Eduardus, Tandelilin. (2001). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Yogyakarta: PT. BPF.
- Fleming, J., & Kirby, C. (2011). *Long memory in volatility and trading volume*. Journal of Banking and Finance, 35(7), 1714–1726.
- Ghozali, I. (2016). *Aplikasi Analisis Multivariate SPSS 23 Edition: 8*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Ghozali, I., & Ratmono, D. (2013). *Analisis Multivariat dan Ekonometrika*. Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Gujarati, Damodar. 2003. *Ekonometrika Dasar*. Jakarta: Salemba Empat.

- Handani, Emrizal. 2002. *Analisis Pengaruh Stock Split Terhadap Likuiditas Saham Dilihat dari Volume Perdagangan Saham di Bursa Efek Jakarta*. Skripsi FE UNS (Tidak Dipublikasikan).
- Hugida, L. (2012). *Analisis Faktor - Faktor Yang Mempengaruhi Volatilitas Harga Saham (Studi pada Perusahaan yang Terdaftar dalam Indeks LQ45 Periode 2006 – 2009)*. 1–73.
- Idx.Co.Id. (2019). Laporan Keuangan Perusahaan Tercatat. Bursa Efek Indonesia.
- Iswandi, K. N. (2012). *Pengaruh Order Imbalance Terhadap Imbal Hasil Dan Volatilitas Harga Saham Teraktif Berdasarkan Volume Perdagangan Di Bursa Efek Indonesia Kuartal Kedua (April-Juni) Tahun 2011*. FISIP UI
- Iswandi, K. N.(2012). Pengaruh order..., Kamal Nurul Iswandi, FISIP UI, 2012.
- Jogiyanto, Hartono. (2013). “Teori Portofolio dan Analisis Investasi”. BPFE Yogyakarta, Edisi Kedelapan, Yogyakarta.
- Jones, C., Kaul, G., Lipson, M. (1994). Transaction, Volume, and Volatility. Review of Financial Studies 7, pp. 631 – 652
- Karproff, J. 1987. *The Relation Between Price Changes and Trading Volume : a Survey*. Journal of Financial and Quantitative Analysis 22, 109 – 126.
- Kartika, A., V, J. K., & Ngisor, B. (2010). di Indonesia dan Malaysia. 12(1), 17–26.
- Khasanah,N. (2019). *Pengaruh Dividend Policy, Trading Volume, dan Order Imbalance Terhadap Volatilitas Harga Saham*. Skripsi. IAIN Surakarta
- Koesoemasari, D. S., Hadiyanto, K., Sundari, S., & Harsuti. (2017). Hubungan Antara Volatilitas Harga Saham dan Volume Perdagangan Saham di Bursa Efek Indonesia. Sustainable Competitive Advantage Journal, 7(1), 423–434.
- Mobarak, R., & Mahfud, M. K. (2017). *Analisis Pengaruh Kebijakan Dividen, Bvps, Earning Volatility, Leverage, Per, Dan Volume Perdagangan Terhadap Volatilitas Harga Saham*. Diponegoro Journal of Management, 6(2), 1–13.
- Nasir, J. La, Diana, N., & Mawardi, M. cholid. (2018). *Analisis Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi Volatilitas Harga Saham (Studi Hasus Pada Perusahaan LQ 45 Yang Terdaftar Di Burs Efek Indonesia Periode 2012-2016)*. E-JRA Vol. 07 No. 09 Agustus 2018, 07(01), 32–45.
- Nugroho, R. B.(2018). *Fenomena The Monday Effect Di Bursa Efek Indonesia ( Studi Perusahaan Manufaktur di Bursa Efek Indonesia)*.
- Priana, I. W. K., & Rm, K. M. (2017). *Dividend Payout Ratio Pada Volatilitas Harga Saham*Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Udayana ( Unud ), Bali , Indonesia. 20, 1–29.
- Rahmawati, I (2017). *Pengaruh Volume Perdagangan, Devidend Payout Ratio, Ilflasi terhadap Volatilitas Harga Saham pada Perusahaan yang Terdaftar dalam Indeks LQ45 tahun 2011-2015*, Jurnal Pendidikan dan Ekonomi, Vol. 6, Nomor 1, Hal: 38-45.
- Reinhart, G. L. K. & C. (2001). *Regional and Global Capital Flows: Macroeconomic Causes and Consequences* (E. Takatoshi Ito and Anne O. Krueger (ed.); Issue November 2017). University of Chicago Press.

- Romli, H., Wulandari, M. F., & Pratiwi, T. S. (2017). *Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi Volatilitas Harga Saham Pada PT Waskita Karya Tbk*. *Ilmiah Ekonomi Global Masa Kini*, 8(01), 1–5.
- Sabri, N. R. (2011). *The Impact of Trading Volume on Stock Price Volatility in the Arab Economy*. *SSRN Electronic Journal*, 1–11.
- Sandrasari, Widya. (2010). *Analisis Pengaruh Volume Perdagangan, Frekuensi perdagangan, dan Order Imbalance terhadap Volatilitas Harga Saham pada Perusahaan go public Di Bursa Efek Indonesia*. Skripsi. UNS
- Sandrasri, W. (2010). Analisis pengaruh volume perdagangan, frekuensi perdagangan, dan *Order Imbalance* Terhadap Volatilitas Harga Saham Pada Perusahaan Go Public Di Bursa Efek Indonesia.
- Schwert, G. W. (1989). *Why Does Stock Market Volatility Change Over Time?* *The Journal of Finance*, 44(5), 1115–1153.
- Song, F. (Fengming), Tan, H., & Wu, Y. (2005). Trade size, trade frequency, and the volatility-volume relation. *Journal of Risk Finance*, 6(5), 424–437.
- Sugiyono. (2016). *Metode Penelitian Kualitatif, Kuantitatif, dan R&D*. Bandung: Alfabeta
- Sunariyah. (2004). *Pengetahuan Pasar Modal*. Edisi Keempat. Yogyakarta: UPP AMP YKPN
- Suniarti, L., & Program. (2013). *Analisis Faktor Fundamental Yang Mempengaruhi Volatilitas Harga Saham (Study Pada Perusahaan Yang Terdaftar Dalam Index Lq45 Periode Tahun 2008-2017)*. *Journal of Chemical Information and Modeling*, 53(9), 1689–1699.
- Sutrisno, B. (2017). *Hubungan Volatilitas dan Volume Perdagangan di Bursa Efek Indonesia*. *Esensi*, 7(1), 15–26.
- Sutrisno, B. (2020). The Determinants of Stock Price Volatility in Indonesia. *Eaj (Economics and Accounting Journal)*, 3(1), 73.
- Waluyo, W. (2016). Analisis Determinan Volatilitas Harga Saham.
- Wardiyah, M. L. (2017). *Manajemen Pasar Uang & Pasar Modal*. CV Pustaka Setia.
- Wayan, N., & Andiani, S. (2018). E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana *Pengaruh Volume Perdagangan Saham , Volatilitas Laba , Dividend Yield , Dan Ukuran Perusahaan Pada Volatilitas Harga Saham Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Udayana ( Unud )*, Bali , Indonesia email : andianisek. 24, 2148–2175.
- Widarjono, A. (2013). *Ekonometrika Pengantar dan Aplikasi Eviews*. UPP STIM YKPN.
- Widarjono, A. (2009). *Ekonometrika Pengantar dan Aplikasinya*. UPP STIM YKPN.
- Winarno, W. W. (2015). *Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan Eviews*. Yogyakarta: UPP STIM YKPN.
- Wooldridge, J. M. (2002). *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*. Hongkong: Massachusetts Institute of Technology