

DAFTAR PUSTAKA

BUKU :

- Agus Widarjono. 2007. *Ekonometrika: Teori dan Aplikasi Untuk Ekonomi dan Bisnis*, edisi kedua. Yogyakarta: Ekonisia FE Universitas Islam Indonesia.
- Ananta W.T., Komang A.K.S., dan Diota P.V. 2014. *Metodologi Penelitian Bisnis*. Cetakan Pertama. Yogyakarta: Graha Ilmu.
- Ang, Robert. 1997. *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia (The Intelligent Guide To Indonesian Capital Market)*. Jakarta: Mediasoft Indonesia.
- Ari, Tatang Gumanti. 2011. *Manajemen Investasi- Konsep, Terori dan Aplikasi*. Jakarta: Mitra Wacana Media.
- Darmadji, T dan Hendy M. F. 2006. *Pasar Modal Di Indonesia: Pendekatan Tanya Jawab*. Edisi 2. Jakarta: Salemba-Empat.
- Dornbusch, Rudiger, dan Stanley Fischer. 1992. *Makroekonomi*, Edisi Keempat. Jakarta: Erlangga.
- Hadi, Nor. 2015. *Pasar Modal*. Edisi kedua, Cetakan Pertama. Yogyakarta: Graha Ilmu.
- Hanafi, Mamduh. 2014. *Manajemen Keuangan*, Edisi Pertama, Cetakan Kedelapan. Yogyakarta: BPFE.
- Hartono, Jogiyanto. 2016. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi kesepuluh, Cetakan Kedua. Yogyakarta: BPFE.
- Husein, Umar. 2008. *Metode Penelitian Untuk Skripsi dan Tesis Bisnis*. Jakarta: PT Rajagrafindo Persada.
- Husnan, Suad. 2005. *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas (Fundamental Of Finansial Management)*. Edisi 3. Yogyakarta: UPP-AMP YKPN.
- Kasmir. 2004. *Bank dan Lembaga Keuangan Lainnya*. Jakarta: PT Raja Grapindo Persada.
- Khalwaty, 2000: *6 Inflasi dan Solusinya*. Jakarta : PT. Gramedia Pustaka Utama
- Koetin, E A. 2002. *Suatu Pedoman Investasi Dalam Efek Indonesia*. Jakarta: US Agency.
- Krugman, Paul R. dan Maurice Obstfeld. 1994. *Ekonomi Internasional: Teori dan Kebijakan*. Jakarta: PT Raja Grafindo Persada
- Kuncoro, Mudrajat. 2013. *Metode Riset untuk Bisnis dan Ekonomi*. Edisi keempat. Jakarta: PT. Erlangga.

- Roos and R. W. Westerfield. 1998. *Coorporate Finance*. St. Louis: Times Mirror/Mosby. Collage Publishing.
- Sri Handaru dan Handoyo. 2005. *Dasar-dasar Manajemen Keuangan Internasional*. Yogyakarta: Andi.
- Sugiyono. 2014. "*Metode Penelitian Bisnis*". Bandung: ALFABETA.
- Sukirno, Sadono. 2013. *Makroekonomi Teori Pengantar*. Edisi Ketiga, Cetakan ke 22, Jakarta: Rajawali Pers.
- Suryabrata, Sumadi. 2014. *Metodologi Penelitian*. Cetakan Ke 25. Jakarta: PT Rajagrafindo Persada.
- Suta, Ary dan I Putu Gede. 2000. *Menuju Pasar Modal Modern*. Cetakan kedua. Jakarta: Yayasan SAD Satria Bakti.
- Tandelilin, Eduardus. 2010. *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Yogyakarta: BPFE.
- Weston, J. Fred., dan Thomas E. Copeland. 1995. *Manajemen Keuangan*. Edisi delapan, Jilid 1. Alihbahasa: Jaka Wasana dan Kirbrandoko. Jakarta: Gelora Aksara Pratama.

JURNAL :

- Alfred, Joan. 2005. *Pengaruh Risiko Sistematis (Beta) dan Likuiditas Terhadap Return Saham Perusahaan LQ-45 periode tahun 2001*. Jurnal Universitas Katolik Soegijapranata.
- Angeris W. 2014. *Pengaruh Kebijakan Dividen, Volume Perdagangan Saham dan Lverage Perusahaan terhadap Return Saham pada Perusahaan Manufaktur yang terdaftar di BEI Periode 2009-2013*. Jurnal Laporan Penelitian Universitas Negeri Yogyakarta.
- Azwir Nasir dan Achmad Mirza. 2011. *Pengaruh Nilai Kurs, Inflasi, Suku Bunga Deposito, Dan Volume Perdangan Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Perbankan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia*. Jurnal Ekonomi. Vol 19. No 04.
- Conroy, R. M, R. S. Harris dan B.A. Benet. 1990. *The Effect of Stock Splits on Bid-Ask Spread*. Journal of Finance 4:1288-1289.
- Elly dan Leng, Pwee. 2002. *Pengaruh Risiko Sistematis dan Likuiditas Terhadap Pengembalian Saham Badan-Badan Usaha yang GoPublic di Bursa Efek Jakarta pada Tahun 1999*. Jurnal Universitas Kristen Petra.
- Fuadi, Dheny Wahyu. 2009. *Analisis Pengaruh Suku Bunga, Volume Perdagangan Dan Kurs Terhadap Return Saham Sektor Properti Yang Listed Di Bei*. Jurnal Bisnis Strategi UNDIP. Volume 18. No 1.

- Jean Edouard Colliard dan Peter Hoffmann. 2017. *Financial Transaction Taxes, Market Composition, And Liquidity*. The Journal of Finance. The Journal of American Finance Association. 2685-2716.
- Ketut Arya Darmawan, I Wayan Suwendra, S.E., M.Si. ., Gede Putu Agus Jana Susila, S.E.,MBA. 2014 *Pengaruh ROI, EVA dan Likuiditas Saham terhadap Return Saham pada Sektor Keuangan yang Go Public*. Jurnal Jurusan Manajemen. e-Journal Bisma Universitas Pendidikan Ganesha Jurusan Manajemen Vol 02. No. 01
- Lu'luil Maknun. 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*. Jurnal Doctoral dissertation. Universitas Diponegoro
- Mulyana, Deden. 2011. *Analisis Likuiditas Saham Serta Pengaruhnya Terhadap Harga Saham Pada Perusahaan Yang Berada Pada Indeks LQ45 Di Bursa Efek Indonesia*. JURNAL Magister Manajemen Volume 4 Nomor 1 Maret 2011 halaman 77-96.
- Maryanne, Donna Menina Della. 2009. *Pengaruh Nilai Tukar Rupiah, Suku Bunga Sbi, Volume Perdagangan Saham, Inflasi Dan Beta Saham Terhadap Harga Saham*. Jurnal UNDIP.
- Nugroho, Inggit. 2015. *Pengaruh Risiko Sistematis Dan Likuiditas Terhadap Return Saham Pada Perusahaan Manufaktur Yang Terdaftar Di BEI*. Jurnal Akuntansi. Volume 3. No 2.
- Nidianti, Putu Imba. 2013. *Pengaruh Faktor Internal Dan Eksternal Perusahaan Terhadap Return Saham Food And Beverages Di Bursa Efek Indonesia*. Jurnal Akuntansi Universitas Udayana. Volume 05. No 1.
- Reza Ferdian. 2009. *Pengaruh Likuiditas Saham dan Return On Equity (ROE) Perusahaan Terhadap Tingkat Pengembalian Saham*. Jurnal Manajemen Universitas Widyatama.
- Rivail Davesta. 2014. *Pengaruh Risiko Sistematis dan Likuiditas Saham Terhadap Return Saham pada Industri Pertambangan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode Tahun 2010-2012*. Jurnal Manajemen Universitas Andalas
- Sumani, Suhari, Christine. 2013. *Analisis Pengaruh Risiko Sistematis Dan Likuiditas Terhadap Return Saham Dalam Perusahaan Non Keuangan LQ-45 Periode Tahun 2007-2009*. Jurnal Fakultas Ekonomi Unpar. Volume 17. Nomor 1.
- Tenriola Samsuar dan Akramunnas. 2017. *Pengaruh Faktor Fundamental Dan Teknikal Terhadap Harga Saham Industri Perhotelan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia*. Mashrafiyah. Jurnal Ekonomi, Keuangan dan Perbankan Syariah. Volume 1. No 1

Wahyu Wiyani dan Andi Wijayanto. 2005. *Pengaruh Nilai Tukar Rupiah, Tingkat Suku Bunga Deposito dan Volume Perdagangan Saham terhadap Harga Saham*. Jurnal Keuangan dan Perbankan.

Wenner R. Murhadi. 2013. *Pengaruh Idiosyncratic Risk Dan Likuiditas Saham Terhadap Return Saham*. Jurnal Manajemen Dan Kewirausahaan JMK, Hal: 33-34, Vol.15, No.1 ISSN 1411-1438

INTERNET:

Agus T. B. 2016. *Bahan Ajar Data Panel*.
<http://ekonometrikblog.files.wordpress.com/2016/04/data-panel.pdf&sa>.