

DAFTAR RUJUKAN

- Admati, Anat R, and Paul Pfleiderer. (1988). A Theory of Intraday Patterns Volume and Price Variability. *Review of Financial Studies* 1, pp 3 – 40.
- Agustinus, dkk. (2013). Volume Perdagangan, Frekuensi Perdagangan, Order Imbalance dan Volatilitas Harga Saham. *Jurnal Universitas Paramadina* Vol. 10.
- Amalia, I. N., Mubyart., & Nengsih. T. A. (2020). Pengaruh Volume Perdagangan, Frekuensi Perdagangan dan Aktivitas Perdagangan terhadap Volatilitas Harga Saham Pada PT. Telkom Indonesia, Tbk Periode 2015-2020. (Doctoral dissertation, UIN Sulthan Thaha Saifuddin Jambi)
- Amelia, S. N. (2021). Pengaruh Volume Perdagangan, Frekuensi Perdagangan, dan Order Imbalance Terhadap Volatilitas Harga Saham (Doctoral dissertation, UNISNU Jepara).
- Andiani, N. W. S., & Gayatri, G. (2018). Pengaruh volume perdagangan saham, volatilitas laba, dividend yield, dan ukuran perusahaan pada volatilitas harga saham. *E-Jurnal Akuntansi*, 24(3), 2148-2175.
- Ang, Robert. (1997). *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia*. Edisi Pertama. Jakarta: Mediasoft Indonesia.
- Anton. (2006). Analisis Model Volatilitas Return Saham (Studi Kasus pada Saham LQ45 di Bursa Efek Jakarta. Thesis. MM UNDIP
- Astuti, T., Ambarwati, S., & Shavira, M. (2021). Determinan Volatilitas Harga Saha Relevan: *Jurnal Riset Akuntansi*, 1(2), 73-82.
- Aviana Putri Iswanti, A. S. (2021). Analisis Perbandingan Harga Saham dan Volume Perdagangan Saham Sebelum dan Sesudah Pengumuman Covid-19 di Indonesia (Studi Pada Indeks Saham LQ-45 Di Bursa Efek Indonesia). *Jurnal Kajian Ilmu Manajemen*, I, 121-129.
- Baskin, J. (1989). Dividend Policy and the Volatility of Common Stock. *Journal of Portfolio Management*, Vol. 3, No. 15, 19-25.
- Chan, K., And W.M. Fong. (2000). Trade size, Order Imbalance, and The Volatility Volume Relation. *Journal of Financial Economics* 57, 247 – 273.

- Chen, Ching dan Hsin. (2011). Dynamic Relations Between Order Imbalance, Volatility and Return of Top Losers. *International Research Journal of Finance and Economics* 73, p.p 7-18
- Chaudry SN., Iqbal S., Butt M. (2015). Dividend Policy, Stock Price Volatility & Firm Size Moderation: Investigation of Bird in Hand Theory in Pakistan. *Research Journal of Finance and Accounting*. 6. (23)
- Chordia, T. Dan Subrahmanyam, A., (2004). Order Imbalance and Individual Stock Returns : Theory and Evidence. *Journal of Financial Economic*, 72: 485-518
- Dewi, N. M. A. K., & Suaryana, I. G. N. A. (2016). Pengaruh volume perdagangan saham, leverage, dan tingkat suku bunga terhadap volatilitas harga saham. *E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana*, 17(2), 1112-1140.
- Dewi, S., & Paramita, R. S. (2017). Pengaruh kebijakan dividen, volume perdagangan, earning volatility, leverage, dan firm size terhadap volatilitas harga saham perusahaan LQ45. *Sumber*, 1, 385.
- Diestra Perdana Eryando Brilliand, R. R. (2016). Analisis Fundamental Dalam Penilaian Harga Saham Dengan Menggunakan Metode Deviden Discounted Model dan Pice Earning Ratio. *Jurnal Administrasi Bisnis*, 37, 206-211.
- Dirgantara, H. (2021, April 5). Wah pandemi Covid-19 picu pertumbuhan jumlah investor pasar modal dan reksadana. Dipetik September 26, 2021, dari *investasi.kontan*: <https://investasi.kontan.co.id/news/wah-pandemi-covid-19-picu-pertumbuhan-jumlah-investor-pasar-modal-dan-reksadana>
- Eni Puji Estuti, S. H. (2020). Dampak Volume Perdagangan Saham, Profitabilitas dan Deviden Terhadap Volatilitas Harga Saham. *Proceeding Seminar Nasional & Call For Papers*, 128-136.
- Eva Yulinda, T. P. (2020). Analisis Pengaruh Deviden Payout Ratio, Leverage, Firm Size, Volume Perdagangan, Earning Volatility dan Inflasi Terhadap Volatilitas Harga Saham Pada Perusahaan Yang Terdaftar Dalam Indeks LQ45 Tahun 2014-2017. *Jurnal Ilmiah Indonesia*, V, 76-83.
- Febrianda, T. G. (2019). Pengaruh Kebijakan Dividen, Earning Volatility, dan Leverage Terhadap Volatilitas Harga Saham pada Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia
- Firmansyah. (2006). Analisis Volatilitas Harga Kopi Internasional. Jakarta: Usahawan.

- Gumanti, Ary. (2011). *Manajemen Investasi, Konsep, Teori dan Aplikasi*. Jakarta : Mitra Wacana Media
- Ghozali, Imam. (2012). *Analisis Multivariate Lanjutan dengan Program SPSS*. Semarang: Badan Penerbit, Universitas Diponegoro.
- Ghozali, Imam. (2011). *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS Edisi 5*. Semarang : BP Universitas Diponegoro.
- Hasan, Iqbal. (2008). *Pokok-Pokok Materi Statistik 2 (Statistik Inferensi)*. Jakarta: Bumi Aksara
- Hasna Rosyida, A. F. (2020). Volatilitas Harga Ssaham : Leverage, Ukuran. *Jurnal Akuntansi Syariah*, IV, 196-208.
- Hugida, L., & SOFIAN, S. (2011). Analisis faktor-faktor yang mempengaruhi volatilitas harga saham (Studi pada perusahaan yang terdaftar dalam indeks LQ45 periode 2006–2009) (Doctoral dissertation, Universitas Diponegoro).
- Investasi.kotan.co.id. (2022, janiary 09). Tumbuh Lebih Dari 90% Sepanjang 2021, Kini Investor Pasar Modal Capai 7,49 juta. Retrieved from Tumbuh Lebih Dari 90% Sepanjang 2021, Kini Investor Pasar Modal Capai 7,49 juta: <https://amp.kontan.co.id/news/tumbuh-lebih-dari-90-sepanjang-2021-kini-investor-pasar-modal-capai-749-juta>
- Irham Fahmi & Yovi L Hadi. 2009. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Bandung: Alfabeta
- I Wayan Korin Priana, K. M. (2017). Pengaruh Volume Perdagangan Saham, Leverage, dan Dividend Payout Ratio Pada Volatilitas Harga Saham. *E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana*(XX), 1-29.
- Jama'an. 2008. *Teori Manajemen Keuangan, Pemasaran, Perbankan dan SDM*. <http://ekonomi.kabo.biz/2011/07/teori-sinyal.htm>
- Jannah, R., & Haridhi, M. (2016). Pengaruh Kebijakan Dividen, Earning Volatility, Dan Leverage Terhadap Volatilitas Harga Saham Pada Perusahaan Non-Financing Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Tahun 2010-2014. *Jurnal Ilmiah Mahasiswa Ekonomi Akuntansi*, 1(1), 133-148.
- Janny Rowena, H. (2017). Earnings Volatility, Kebijakan Dividen, Dan Pertumbuhan Asset Berpengaruh Terhadap Volatilitas Harga Saham Pada

- Perusahaan Manufaktur Di BEI Periode 2013 - 2015. *Jurnal Administrasi Kantor*, V, 231-242.
- Jasselyn, E. (2021). Analisis Pengaruh Dividend Yield, Dividend Payout, Ukuran Perusahaan, Pertumbuhan Perusahaan, Volatilitas Laba dan Leverage terhadap Volatilitas Harga Saham. *Combines*, I, 1220-1233.
- J. Ademola, Osundina et.al. (2016) "Impact of Accounting Information on Stock Price Volatility (A Study of Selected Quoted Manufacturing Companies in Nigeria)", *International Journal of Business and Management Invention*, ISSN : 2319 – 8028, Volume 5 Issue 11, Volume 5 Issue 11.
- Jogiyanto Hartono. 2018. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Kesebelas. Yogyakarta. BPFE-YOGYAKARTA
- Kamal N. (2013). Pengaruh Order Imbalance Terhadap Imbal Hasil dan Volatilitas Harga Saham Teraktif Berdasarkan Volume Perdagangan Di Bursa Efek Indonesia Kuartal Kedua (April-Juni) Tahun 2011. Skripsi. Ilmu Sosial dan Ilmu Politik. Universitas Indonesia : Jawa Barat.
- Komang Ria Selpiana, I. B. (2018). Pengaruh Kebijakan Dividend, Nilai Tukar, Leverage, dan Firm Size Terhadap Volatilitas Harga Saham. *E-Jurnal Manajemen Unud*, 1682-1712.
- Kasmir. 2017. *Analisis Laporan Keuangan*. Jakarta: PT Rajagrafindo Persada.
- Kartika, A. 2010. Volatilitas Harga Saham di Indonesia dan Malaysia. *Jurnal Ekonomi*, I, 17-26.
- La Nasir, J., Diana, N., & Mawardi, M. C. (2018). Analisis Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi Volatilitas Harga Saham (Studi Kasus Pada Perusahaan LQ45 Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2012-2016). *Jurnal Ilmiah Riset Akuntansi*, 7(09).
- Lubis, S. A. (2019). Pengaruh Earning Volatility Dan Leverage Terhadap Volatilitas Harga Saham (Sektor Property dan Real Estate Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia)
- Melia Wida Rahmayani, W. R. (2020). Pengaruh Volume Perdagangan Saham dan Leverage Terhadap Volatilitas Harga Saham (Studi Empris Pada Perusahaan Indeks LQ-45 Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Tahun 2012-2014). *Jurnal Ilmiah Ekonomi dan Keuangan Syariah*, I, 133-141.
- Mobarak, Rizqin, and Mohammad Kholiq Mahfud. (2017). "Analisis Pengaruh Kebijakan Dividen, Bvps, Earning Volatility, Leverage, Per, Dan Volume Perdagangan Terhadap Volatilitas Harga Saham (Studi

Empiris Pada Perusahaan Go Public Non Keuangan Yang Listing Di Bursa Efek Indonesia Tahun 2012-2015)". *Diponegoro Journal of Management* 6 (2):1-13

Nachrowi dan Usman. (2006). *Pendekatan Populer dan Praktis : Ekonometrika Untuk Analisis Ekonomi dan Keuangan*. Jakarta: Lembaga Penerbit Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia.

Nasir, A., & Mirza, A. (2011). Pengaruh nilai kurs, inflasi, suku bunga deposito dan volume perdagangan saham terhadap return saham pada perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Ekonomi*, 19(04).

Nazihah, S. S., Hidayati, N., & Basalama, M. R. (2020). Pengaruh Kebijakan Dividen, Book Value Per Share (Bvps), Leverage Terhadap Volatilitas Harga Saham Pada Perusahaan Rokok Yang Listing Di Bursa Efek Indonesia Tahun 2016-2018. *Jurnal Ilmiah Riset Manajemen*, 9(10).

Oktavianti, R., & Saryadi, S. (2020). Pengaruh Dividend Payout Ratio, Firm Size, dan Leverage Terhadap Volatilitas Harga Saham (Studi pada Perusahaan Indeks LQ-45 yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2016-2018). *Jurnal Ilmu Administrasi Bisnis*, 9(2), 119-132.

Parkinson, Michael. "The extreme value method for estimating the variance of the rate of return." *Journal of business* (1980): 61-65.

Pomartia, T. Z., Mulyadi, J. M. V., & Rachbini, W. (2018). Analisis Volatilitas Harga Saham Dengan ROA DAN ROE Sebagai Variabel Kontrol (Studi Pada Perusahaan Yang Terdaftar Dalam Indeks LQ45). *Ekobisman-Jurnal Ekonomi Bisnis dan Manajemen*, 3(2), 138-147.

Prayogiyanto, C. D., Mardani, R. M., & Wahono, B. (2020). Analisis Pengaruh Kebijakan Dividen, Book Value Per Share (Bvps), Dan Earning Volatility (Evol) Terhadap Volatilitas Harga Saham (Study Empiris Pada Perusahaan Manufaktur Sektor Industri Dasar dan Kimia yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2016-2018). *Jurnal Ilmiah Riset Manajemen*, 9(09).

Priyatno, Dwi. (2008). *Mandiri Belajar SPSS (Statistical Product and Service Solution) untuk Analisis Data dan Uji Statistik*. Yogyakarta: Media Kom.

Rahmayani, M. W., Riyadi, W., & Ginanjar, Y. (2020). Pengaruh Volume Perdagangan Saham Dan Leverage Terhadap Volatilitas Harga Saham. *Eco-Iqtishodi: Jurnal Ilmiah Ekonomi dan Keuangan Syariah*, 1(2), 133-141.

- Rohana, dkk. (2003). Analisis Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Stock Split dan Dampak Yang Ditimbulkannya. Simposium Nasional Akuntansi VI.
- Rohmawati, I. (2017). Pengaruh Volume Perdagangan, Dividend Payout Ratio Dan Inflasi Terhadap Volatilitas Harga Saham Pada Perusahaan Yang Terdaftar Dalam Indeks LQ45 Tahun 2011-2015. *Jurnal Pendidikan dan Ekonomi*, 6(1), 38-45.
- Raihan, H. (2020). Pengaruh Earning Volatility, Leverage, Dan Firm Size Terhadap Volatilitas Harga Saham Pada Perusahaan Jasa Sub Sektor Property Dan Real Estate di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2016-2018 (Doctoral dissertation, Universitas Islam Negeri Sumatera Utara) Real Estate di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2016-2018 (Doctoral dissertation, Universitas Islam Negeri Sumatera Utara)
- Romli, H., Febrianti, M., & Pratiwi, T. S. (2017). Faktor-faktor yang mempengaruhi volatilitas harga saham pada PT Waskita Karya Tbk. *Jurnal Ilmiah Ekonomi Global Masa Kini*, 8(1), 1-5.
- Safitri, V. L. 2019. Analisis Pengaruh Kebijakan Dividen, Inflasi, Volume Perdagangan dan Leverage terhadap Volatilitas Harga Saham (Doctoral dissertation, UNISNU Jepara).
- 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
- Sejati, F. R., Ponto, S., Prasetianingrum, S., Sumartono, S., & Sumbari, N. N. (2020). Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi Kebijakan Dividen. *Berkala Akuntansi Dan Keuangan Indonesia*, 5(2), 110-131.
- Shalehah, S. (2021). Pengaruh Inflasi, Volume Perdagangan, dan Dividend Payout Ratio Terhadap Volatilitas Harga Saham Pada Perusahaan Yang Terdaftar Dalam Indeks LQ45 (Doctoral dissertation, Universitas Putra Bangsa).
- Sirait, J., Purwohedhi, U., & Noviarini, D. (2021). Pengaruh Volatilitas Laba, Leverage Keuangan, Kebijakan Dividen, dan Price to Book Value Terhadap Volatilitas Harga Saham. *Jurnal Akuntansi, Perpajakan, dan Auditing-JAPA*, 2(2), 397-415.
- Sufi Rachmani, B. H. (2018). Analisis Pengaruh Dividend Yield dan Dividend Payout Ratio Terhadap Volatilitas Harga Saham. *Jurnal Ilmu dan Riset Manajemen*, 1-17.

- Sulia & Rice. (2013). Analisa Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Wira Ekonomi Mikroskil*, Volume 3, Nomor 01, April 2013.21-30
- Waluyo, W. (2016). Analisis Determinan Volatilitas Harga Saham. *Jurnal Skripsi*.
- Widiarti, T. 2018. Faktor-faktor yang mempengaruhi volatilitas harga saham pada perusahaan yang terdaftar Di indeks Iq 45 (Doctoral dissertation, STIE PERBANAS SURABAYA).
- Yudarrudin, R., Defung, F., & Atmoko, Y. (2017). Pengaruh return on assets, debt to equity ratio, dan firm size terhadap dividend payout ratio.
- Yulinda, E., Astuti, T. P., & Haryono, S. T. (2020). Analisis pengaruh devidend payout ratio, leverage, firm size, volume perdagangan, earning volatility, dan inflasi terhadap volatilitas harga saham pada perusahaan yang terdaftar dalam Indeks LQ 45 tahun 2014. *Syntax Literate; Jurnal Ilmiah Indonesia*, 5(5), 76-83.

