

DAFTAR PUSTAKA

- Ang, A., Hodrick, R.J., Xing, Y., Zhang, X. 2006. "The Cross-Section of Volatility and Expected Returns". *Journal of Finance*. Vol. 61, p. 259-299.
- Ang, Robbert. 1997. *The Intelligent Guide to Indonesian Capital Market ed.1*. Indonesia: MediaSoft.
- Baradarannia, M. Reza dan Maurice Peat. 2013. "Liquidity and Expected Returns-Evidence from 1962-2008". *International Review of Financial Analysis*. Vol. 29, p. 10-23
- Barinov, Alexander. 2015. "Why Does Higher Variability of Trading Activity Predict Lower Expected Return?", *Journal of Banking and Finance*. Vol. 58, p. 457-470.
- Bhandari, Laxmi Chand. 1988. "Debt/Equity Ratio And Expected Common Stock Returns: Empirical Evidence". *The Journal of Finance*. Vol. 43, No. 2, p. 507-528.
- Bloomberg L.P. (2013) Financial Analysis Untuk Perusahaan terindeks pada JCI Index 11/1/13 to 11/1/13. Diakses pada Feb. 15, 2016 dari *Bloomberg database*.
- Bodie, Zvi et al. 2006. *Investments ed.6*. Jakarta: Salemba Empat.
- Chairiyah, Mir'atul. 2013. "Pengaruh Asset Growth, Return On Equity, Total Asset Turnover, Dan Earning Per Share Terhadap Beta Saham". Skripsi. Universitas Negeri Padang.
- Chen, Yangyang., S. Ghon Rhee., Madhu Veeraraghavan., Leon Zolotoy. 2015. "Stock Liquidity and Managerial Short-termism". *Journal of Banking and Finance*. Vol. 60, p. 44-59.
- Chiang, Thomas C dan Dazhi Zheng. 2015. "Liquidity and Stock Returns: Evidence From International Markets". *Global Finance Journal*. Vol. 27, p. 73-97.
- Crockett, Andrew. 1997. "Why is Financial Stability a Goal of Public Policy", in *Maintaining Financial Stability in A Global Economy, a Symposium Sponsored by The Federal Reserve Bank of Kansas City*. Jackson Hole, Wyoming, p. 1-36
- Darmadji, Tjiptono dan Hendy M, Fakhruddin. 2011. *Pasar Modal di Indonesia ed.3*. Jakarta: Salemba Empat.
- Eiteman, David K, Arthur I. Stonehill dan Michael H. Moffet. 2006. *Manajemen Keuangan Multinasional ed.11*. Jakarta: Erlangga.

- Fatmawati, Sri dan Marwan Asri. 1999. "Pengaruh *Stock Split* Terhadap Likuiditas Saham yang Diukur dengan Besarnya *Bid Ask Spread* di BEJ". *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia*. Vol. XIV. No. 4, hal. 90-110.
- Fernando, Rowland Bismark Pasaribu. 2010. "*Value At Risk Portofolio* Dan Likuiditas Saham". *Jurnal Akuntansi Dan Manajemen*. Vol. 21, No. 2, p. 105-127.
- Ghozali, Imam. 2013. *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS 21 Update PLS Regresi*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Guthrie, Graeme. 2011. "A Note Operating Leverage and Expected Rates of Return". *Financial Research Letter*. Vol. 8, p. 88-100
- Hadad, Muliaman D. et al. 2004. "Indeks Saham Perbankan". *Research Paper Bank Indonesia*. Nomor 6/1.
- Hartono, Jogiyanto. 2010. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi ed.7*. Yogyakarta: BPF
- Husnan, Suad. 1996. *Teori Portofolio Dan Analisis Sekuritas*. UPP AMP YKPN-Yogyakarta.
- Indonesia Stock Exchange Official Site, www.idx.co.id
- Jones, Charles M. 2002. "A Century Of Stock Market Liquidity and Trading Costs". *Working Paper*, Columbia University.
- Lirda, Nova. 2014. "Pengaruh *Current Ratio* Dan *Debt To Equity Ratio* Terhadap Likuiditas Saham Menggunakan *Trading Volume Activity*". *Accounting Financial Management*. Universitas Syiah Kuala. Darussalam-Banda Aceh.
- Mulyadi. 2003. *Akuntansi Manajemen ed. 2*. Yogyakarta: STIE YKPN.
- Mulyana, Deden. 2011. "Analisis Likuiditas Saham Serta Pengaruhnya Terhadap Harga Saham Pada Perusahaan yang Berada pada Indeks LQ 45 di Bursa Efek Indonesia". *Jurnal Magister Manajemen*. Vol. 4, No. 1, Hal 77-96.
- Mukhlis, Ahmad. 2014. "Pengaruh Kinerja Perusahaan Terhadap Likuiditas Saham". Skripsi, Universitas Islam Negeri Sunan Kalijaga.
- Munawarah. 2009. "Analisis Perbandingan *Abnormal Return* dan *Trading Volume Activity* Sebelum dan Setelah Suspend BEI". Tesis. Hal. 25.
- Nasser, Etty M. 2007. "Pengaruh Beta Saham Terhadap *Expected Return* dengan model *Capital Asset Pricing* Pada Perusahaan Publik di Bursa Efek Jakarta", *Media Riset Akuntansi, Auditing dan Informasi*. Vol. 7, No. 2, hal 163-186.

- Nassirzadeh, Farzaneh, Mahdi Salehi, Reza Sarvghadi. 2015. "The Effect of Financial Indicator on Trading Volume of The Listed Companies on The Tehran Stock Exchange". *International Business Research*. Vol. 8, No. 5, p. 176-194.
- Novy, Robert and Marx. 2012. "The Other Side Of Value: The Gross Profitability Premium". *Simon Graduate School Of Business*. University Of Rochester.
- Palazzo, Berardino. 2012. "Cash Holding, Risk, and Expected Return". *Journal of Financial Economics*. Vol. 104, No. 1, p. 162-185
- Pereira, J.P., Zhang, H.H. 2010. "Stock Returns and the Volatility of Liquidity". *Journal of Financial and Quantitative Analysis*. Vol. 45, p. 1077-1110.
- Rachmawati, Sisca. 2010. "Analisis Pengaruh Faktor Fundamental Terhadap Risiko Sistematis (Beta) Pada Saham LQ 45 Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2006-2008" Skripsi. Universitas Diponegoro.
- Siamat, Dahlan. 2005. *Manajemen Lembaga Keuangan; Kebijakan Moneter dan Perbankan*. Jakarta: Lembaga Penerbit Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia.
- Syamsuddin, Lukman. 2009. *Manajemen Keuangan Perusahaan*. Jakarta: PT Raja Grafindo Persada.
- Vayanos, Dimitri. 2005. "Transaction Costs and Asset Prices: A Dynamic Equilibrium Model". *The Review of Financial Studies*. Vol. 11, No. 1, p. 1-58.
- Widoatmodjo, Sawidji. 2012. *Cara Sehat Investasi di Pasar Modal*. Jakarta: PT Alex Media Komputindo.
- Wira dan Elfitri. 2012. "Analisis Kinerja Keuangan Perusahaan Terhadap Likuiditas Saham Pada Perusahaan Yang Listing Di Bursa Efek Indonesia". *Jurnal Akuntansi dan Manajemen*, Vol. 7, No. 2, h. 9-23
- Wira, Desmond. 2014. *Jurus CUAN Investasi Saham* ed.3. Indonesia: Exceed.
- Wira, Variyetmi. 2012. "Pengaruh Kinerja Perusahaan Terhadap Likuiditas Saham Menggunakan *Trading Turnover*". *Jurnal Manajemen dan Kewirausahaan*. Vol. 3, No. 2, hal. 97-120.
- Wiyani, W dan A. Wijayanto. 2005. "Pengaruh Nilai Tukar Rupiah, Tingkat Suku Bunga Deposito, dan Volume Perdagangan Saham Terhadap Harga Saham". *Jurnal Keuangan dan Perbankan*. Vol. 9, No. 3, p. 884-903.
- Zubir, Zalmi. 2011. *Manajemen Portofolio: Penerapannya dalam Investasi Saham*. Jakarta: Salemba Empat.