

## DAFTAR PUSTAKA

- Anggraini, E. A. D., dan Pratomo, A. S. (2018). *Determinan Return Saham: Jakarta Islamic Index VS LQ45*. EL DINAR: Jurnal Keuangan dan Perbankan Syariah, Volume 6 Nomor 2, hlm. 128–136.
- Basuki, A. T., dan Prawoto, N. (2017). *Analisis Regresi dalam Penelitian Ekonomi & Bisnis (Dilengkapi Aplikasi SPSS & Eviews)*, 1st edition. Jakarta: Rajawali Pers.
- Bursa Efek Indonesia. (2020). Ringkasan Performa Perusahaan LQ45 . Diakses 2 November 2020, dari <https://www.idx.co.id/data-pasar/laporan-statistik/ringkasan-performa-perusahaan-lq45/>.
- Bursa Efek Indonesia. (2020). Statistik. Diakses 5 November 2020, dari <https://www.idx.co.id/data-pasar/laporan-statistik/statistik/>
- Dinh, M. T. H. (2017). *The Returns, Risk and Liquidity Relationship in High Frequency Trading: Evidence from the Oslo Stock Market. Research in International Business and Finance*, Volume 39, hlm. 30–40.
- Fahmi, I. (2014). *Pengantar Manajemen Keuangan*. Bandung: Alfabeta.
- Fahmi, I. (2015). *Manajemen Investasi: Teori dan Soal Jawab*, 2nd edition. Jakarta: Salemba Empat.
- Ghozali, I. (2013). *Aplikasi Analisis Multivariate Dengan Program IBM SPS 21*, 7th edition. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Hartono, J. (2017). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, 11th edition. Yogyakarta: BPFE.
- Haryanto. (2020). *Dampak Covid-19 terhadap Pergerakan Nilai Tukar Rupiah dan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)*. Jurnal Perencanaan Pembangunan: *The Indonesian Journal of Development Planning*, Volume 4 Nomor 2, hlm. 151–165.
- Hertina, D., dan Hidayat, M. B. H. (2018). *Financial Performace and Systemic Risk Effect on Stock Return (Case Study on Oil and Gas Companies Listed in IDX Year 2011-2016)*. Perisai : Islamic Banking and Finance Journal, Volume 2 Nomor 2, hlm. 87–100.

- Intan, K., dan Dewi, H. K. (2020). *Berita Investasi: Market dan Rekomendasi*. Diakses 28 November 2020, dari <https://investasi.kontan.co.id/news/menyentuh-level-tertinggi-selama-pandemi-penguatan-ihsg-ditopang-saham-blue-chips>.
- Malcenièce, L., Malcenièks, K., dan Putnins, T. J. (2019). *High Frequency Trading and Comovement in Financial Markets*. *Journal of Financial Economics*, Volume 134 Nomor 2, hlm. 381–399.
- Nurfadillah, M., dan Anisa, M. (2018). *Pengaruh Risiko Sistematis dan Likuiditas Terhadap Return Saham pada PT. Bank Muamalat Indonesia Tbk di Bursa Efek Indonesia*. *Jurnal Ekonomi dan Manajemen*, Volume 12 Nomor 1.
- Octovian, R. (2017). *Pembentukan Portofolio Optimal (Studi Kasus Indeks Saham LQ45, Bisnis-27 dan IDX30 Periode 2010-2014)*. *Jurnal Sekuritas (Saham, Ekonomi, Keuangan dan Investasi)*, Volume 1 Nomor 2, hlm. 74-88.
- Sakti, Y. D. B., Nurmatias, dan Yetty, F. (2020). *Analisis Portofolio Optimal Saham menggunakan Single Index Model (Studi Empiris : Saham-saham Bisnis-27 dan JII)*. Repository Universitas Pembangunan Veteran Jakarta.
- Samsul, M. (2015). *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*, 2nd edition. Jakarta: Erlangga.
- Satgas Penanganan COVID-19. (2020). *COVID-19*. Diakses 27 September 2020, dari <https://covid19.go.id/>.
- Tandelilin, E. (2010). *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi*, 1st edition. Yogyakarta: PT Kanisius.
- Taslim, A., dan Wijayanto, A. (2016). *Pengaruh Frekuensi Perdagangan Saham, Volume Perdagangan Saham, Kapitalisasi Pasar dan Jumlah Hari Perdagangan Terhadap Return Saham*. *Management Analysis Journal*, Volume 5 Nomor 1, hlm. 1–6.
- Wibowo, A. R., dan Hendratno. (2019). *Pengaruh Frekuensi Perdagangan Saham, Volume Perdagangan Saham dan Kapitalisasi Pasar terhadap Return Saham Perusahaan yang berada pada Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2013-2017*. *E-Proceeding of Management*, Volume 6 Nomor 1, hlm. 336–340.
- Wijaya, C. F., dan Djajadikerta, H. (2018). *Pengaruh Risiko Sistematis, Leverage, dan Likuiditas terhadap Return Saham LQ45 yang terdaftar pada Bursa*

*Efek*. Jurnal Manajemen, Volume 9 Nomor 2, hlm. 62–76.

Wikipedia. (2020). *Pandemi COVID-19*. Wikipedia. Diakses 27 September 2020, dari [https://id.wikipedia.org/wiki/Pandemi\\_COVID-19](https://id.wikipedia.org/wiki/Pandemi_COVID-19).

Yahoo Finance. (2020). *Historical Data Harga Saham*. Diakses 30 September 2020, dari <https://finance.yahoo.com/>.

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*. Jurnal Akuntansi Dan Keuangan, Volume 7 Nomor 1, hlm. 65–74.