

DAFTAR PUSTAKA

- Chatterjee, A. dan Maniam B. 1997. Market Anomalies Revisited, *Journal of Applied Business Research, Fall*.
- Corhay, A., Hawawini, G.A., dan Michael, P. 1987. Seasonality in the Risk-return Relationship: Some International Evidence, *Journal of Finance*. Vol 42.
- Coutts, J.A., 1997. Discussion of Microstructure and Seasonality in the UK Equity Market, *Journal Of Business Finance and Accounting*. Vol 24.
- Gunawan, Barbara. 2004. Reaksi pasar modal Indonesia terhadap peristiwa politik dalam negeri: Studi peristiwa peledakan bom di gedung Bursa Efek Jakarta, *Jurnal Akuntansi dan Investasi Universitas Muhammadiyah Yogyakarta*. Vol 5: halaman 29-46.
- Hartono, Jogiyanto. 2000. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi kedua. Yogyakarta: BPFE.
- Hartono, Jogiyanto. 2004. *Metodologi Penelitian Bisnis: Salah Kaprah dan Pengalaman-Pengalaman*. Edisi pertama. Yogyakarta: BPFE.
- Hartono, Jogiyanto. 2005. *Pasar Efisien Secara Keputusan*. Jakarta: PT Gramedia Pustaka Utama.
- Lionadi, Anne. 2000. *Dampak Penerbitan Saham PT Bakrie Telecom, Tbk. Terhadap Harga dan Volume Saham-saham Industri Telekomunikasi*.

- Ritter, J.R., dan Chopra, N. 1989. Portfolio Re-balancing and the Turn-of-the-year Effect, *Journal of Finance*.
- Santoso, Singgih. 2004. *Mengatasi Berbagai Masalah Statistik dengan SPSS*. Cetakan kedua. Jakarta: PT Elex Media Komputindo Jakarta.
- Sharpe, William F.; Gordon J. Alexander; dan Jeffery V. Bailey. 1997. *Investasi*. Jilid 2. Terjemahan. Jakarta: PT Prenhallindo.
- Sindang, E. 1997. *Efek Januari (The January Effect) pada Return Saham di Bursa Efek Jakarta periode 1994-1997*, Unpublished Internship Report.
- Ulansari, K. Mukti. 2002. The Explanatory Power of Moving Average Beta in The January Effect, *Simposium Nasional Keuangan In Memoriam Prof. Dr. Bambang Riyanto*. Halaman 242-260.
- Umar, H. 1999. *Metodologi Penelitian Aplikasi dalam Pemasaran*. Cetakan kedua. Jakarta: PT Gramedia Pustaka Utama Jakarta.

Website

www.bpkp.go.id/unit/hukum/pp/2006/022-06.pdf

www.ekonofisika.com

www.indostock.co.id

www.muhaiefeffendi.files.wordpress.com

www.shareselect.com.au

www.tempointeraktif.com

www.wikipedia.org