

DAFTAR PUSTAKA

- Alteza, M. (2007). Efek Hari Perdagangan Terhadap Return Saham: Suatu Telaah atas Anomali Pasar Efisien. *Jurnal Ilmu Manajemen Vol.3, No. 1, 31-42*.
- Ardinan, Haikel. (2014). Pengujian *Monday effect* Pada Bursa Efek Indonesia dan Bursa Efek Singapura. *Journal of Business and Banking*.
- Ambarwati, Sri Dwi Ari. (2009). Pengujian *Week – Four, Monday, Friday*, dan *Earning Management Effect* terhadap *Return Saham*. *Jurnal Keuangan dan Perbankan*, Vol.13, No.1 Januari 2009, hal 1-14.
- Budileksmana, Antariksa (2005). Fenomena *The Monday Effect* di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal, SNA VII Solo*.
- Cahyaningdyah, Dwi. (2005). Analisis Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap *Return Saham* : Pengujian *Week Four Effect* dan *Rogalski Effect* di Bursa Efek Jakarta. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia Vol. 20, No. 2, 2005*.
- Cahyaningdyah, Dwi dan Faridhatun Faidah. (2017) Analisis Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap *Return Saham* di Bursa Efek Indonesia: Pengujian Menggunakan GARCH. *Ekspektra, Jurnal Manajemen dan Bisnis, Volume 1, Nomor 1, Hal. 1-10*.
- Damodoran, Aswath. (1996). *Investment Valuation*. University Edition. Jonh Wiley and Sons. Inc.
- Dharma, Ketut Teguh dan Ardiana Putu Agus. (2016) Analisis *The Monday Effect* di Bursa Efek Indonesia.
- Fahmi, Irham (2012). Analisis Laporan Keuangan. Cetakan Ke-2. Bandung: Alfabeta.
- Fama, E. F., “Efficient Capital Markets: A Review of Theory and Empirical Work,” *Journal of Finance* 25 (1970), hal. 383-417.
- Firmansyah (2006). Analisis Volatilitas Harga Kopi Internasional. Jakarta.
- Friska dan Anastasia (2014). Faktor-faktor yang Mempengaruhi Volatilitas Harga Saham pada Perusahaan Publik nonkeuangan. *Jurnal Bisnis dan Akuntansi*. Vol. 16, No. 2, 2014.

- Ghozali, Imam (2013). *Aplikasi Analisis Multivariate Dengan Program IBM. SPSS 21*. Edisi Ketujuh. Semarang. Universitas Diponegoro.
- Husnan, Suad (2001). *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Edisi Ketiga. Yogyakarta: UPP-AMP YKPN.
- Iramani dan Ansyori Mahdi (006). Studi Tentang Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham pada BEJ. *Jurnal Akuntansi dan Keuangan*, Vol. 8, No2, November 2006. 63-70.
- Iswardhini, Tri Dwiyantri. (2013). Pengaruh *Monday Effect* terhadap Return Saham di Bursa Efek Indonesia pada tahun 2010-2012. Skripsi Universitas Jember.
- Jogiyanto (2014). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Kesembilan Yogyakarta: BPFE.
- Jones, Charles P. 1996. *Investment: Analysis and Management*, John Wiley and Son, California, 6th Edition.
- J William. (2012). Volatility and Compounding Effect on Beta and Return.
- Kurniawan, Arief Adhy. (2012) Analisis Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham Perusahaan Bidang Telekomunikasi yang terdaftar di BEI. STMIK AMIKOM Purwokerto.
- Lakonishok, J. And E. Maberly, 1990, The Weekend Effect: Trading Patterns of Individual and Institutional Investors, *Journal of Finance*, Vol. 45, pp. 231-243.
- Levy, Haim S. (1996), *Introduction to Investment*. South Western Publishing.
- Mehdian, Seyed and Mark J. Perry, (2001), The Reversal of the *Monday Effect*: New Evidence from US Equity Markets, *Journal of Business Finance & Accounting*, Sept/Oct, pp. 1043-1065.
- Muhammad Radian, dkk. (2016). Pengaruh *Weekday Effect* dan *Week Four Effect* Terhadap Return Saham Indeks Kompas 100 di BEI Periode 2007 – 2015. e-Proceeding of Management : Vol.3, No. 1 April 2016, page 124.
- Mulyadi dan Anwar. (2009). *The day of the week effects in Indonesia, Siangapore, and Malaysia stock market*. Munich Personal Repec Archive, MPRA Paper No. 16873.

- Parkinson, M. (1980). The Extreme Value Method For Estimating The Variance of The Rate of Return. *Journal of Business*, 61-65.
- Probo, Saputro Aditya. (2014). *Day of The Week Effect dan Month of The Year Effect Terhadap Return Indeks Pasar*. Jurnal Nominal/ Volume III nomor 2 / Tahun 2014.
- Rohmawati Irma. (2016) Pengaruh Volume Perdagangan Deviden payout Ratio dan Inflasi terhadap Volatilitas Harga Saham pada Perusahaan yang Terdaftar dalam Indeks Keuangan LQ 45.
- Rystrom, D. S., and Benson, E. (1989). *Investor Psychology and The day of The Week Effect*. *Financial Analysis Journal*, 45.
- Safaruddin. (2011). Pengujian Monday Effect Di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis*: Vol 10, No. 1 Feb 2011.
- Schwert, G. William. (1989). *Why Does Stock Market Volatility Change Over Time?*. The *Journal Of Finance*. Vol. XLIV, No.5.
- Satoto, Shinta Heru. 2011. Analisis Fenomena *Day of The Week Effect*. *Jurnal Manajemen*, Vol.10 (2): 193-202.
- Sugiyono. 2015. *Metode Penelitian Pendidikan*. Bandung : Alfabeta.
- Sunjoyo, dkk. (2013). *Aplikasi SPSS Untuk Smart Riset*. Alfabeta, Bandung.
- Sulaiman dan Ana Handi. (2008). Pengaruh Kinerja Keuangan terhadap Return Saham pada Perusahaan Manufaktur di BEJ. *Jurnal Penelitian dan Pengembangan Akuntansi* Vol. 2 No. 2 Juli 2008.
- Sularso, H., Suyono. E & Rahmawanto, D. (2011). Analisis *Monday dan Weekend Effect* pada Saham Perusahaan LQ 45 di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Keuangan dan Bisnis*. UNSOED.
- Tandelilin, Eduardus. (2010). *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi*. Kanisius Yogyakarta.