

## DAFTAR PUSTAKA

- Ahern. (2006). *Sample Selection and Event Study Estimation. Los Angeles: University of California.*
- Andreas, & Daswan, R. (2011). January Effect pada perusahaan LQ45 Bursa Efek Indonesia 2003-2008. *Jurnal Ekonomi, 19 No.3.*
- As'adah, L. (2009). Pengaruh January Effect terhadap Abnormal Return dan Saham pada Jakarta Islamic Indeks. *Skripsi jurusan Mu'amalah Fakultas Syari'ah Universitas Islam Negeri Sunan Kalijaga.*
- Astuti, D., & Legowo, H. (2010). *Testing Of January Effect Stock Exchange in Jakarta.* Retrieved April 08, 2013, from LQ45 Company Cas Studies on the JSE:  
<http://ejournal.stienusa.ac.id/index.php/accounting/article/download/80/65>
- Azlina, N. (2009). Pengaruh THE Monday Effect Terhadap Return Saham JII di Bursa Efek Indonesia. *Pekbis Jurnal, 1, 26-35.*
- Azmi, M. U., Andini, R., & Raharjo, K. (2016). ANALISIS PENGARUH NET PROFIT MARGIN (NPM), RETURN ON ASSETS (ROA) DAN CURRENT RATIO (CR) TERHADAP HARGA SAHAM EMITEN LQ45 YANG TERDAFTAR DI BURSA EFEK INDONESIA PADA TAHUN 2010-2014. *Journal Of Accounting, 2.*
- Corrado, C. (2011). Event studies: A methodology review. *Accounting and Finance, 51.*
- Cuan, J. (2018, September 30). *Jurus Cuan.* Retrieved September 30, 2018, from [www.juruscuan.com](http://www.juruscuan.com): <https://www.juruscuan.com/daftar-saham/744-daftar-saham-indeks-lq45-terbaru-periode-agustus-2017-januari-2018>
- Fitriyani, I., & Sari, M. M. (2013). ANALISIS JANUARY EFFECT PADA KELOMPOK SAHAM INDEKS LQ-45 DI BURSA EFEK INDONESIA TAHUN 2009-2011. *E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana, 4.*
- Forex, S. (2018, Oktober 30). *Seputar Forex.* Retrieved September 30, 2018, from [www.seputarforex.com](http://www.seputarforex.com): <https://www.seputarforex.com/>
- Given, L. M. (2008). *The Sage encyclopedia of qualitative research methods.*

- Gumanti, A., & Ma'ruf, F. (2004). Anomali Pasar Dalam Teori Keuangan. *Dalam Ayu Wulandari*.
- Hartono, J. (2010). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta.
- Hartono, J. (2011). *Metode Penelitian Bisnis*. Yogyakarta: Fakultas Bisnis dan Ekonomi UGM.
- Hartono, J. (2014). *Metodologi Penelitian Bisnis* (6 ed.). Yogyakarta.
- Hartono, J. (2014). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta.
- Hartono, J. (2016). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFE-YOGYAKARTA.
- Idris. (2010). *Aplikasi Modek Analisis Data Kuantitatif dengan Program SPSS* (Edisi Revisi ed.). Padang: UNP.
- Ishak, V. T. (2013). Hari Libur Nasional, Return, dan Abnormal Return di BEI. *Skripsi*.
- Kadir, S., & Kewal, S. S. (2014). Fenomena January Effect di Bursa Efek Indonesia (studi pada perusahaan yang terdaftar di LQ45 periode 2010-2013). *Jurnal Keuangan dan Bisnis*.
- Kadir, S., & Suci, K. S. (2014). Fenomena January Effect di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Keuangan dan Bisnis*, 12.
- Khan, A., & Ahmed, M. (2009). Trading Volume and Stock Return: The Impact of Events in Pakistan on KSE 100 Indexes. *International Review of Business Research Papers*, 5, 373-383.
- Mailangkay, J. (2013). Integrasi Pasar Modal Indonesia dan beberapa Bursa di Dunia. *Jurnal EMBA*, 1.
- Manurung, A., & Cahyanti, K. (2014). Pengaruh Peristiwa Politik (Pengumuman Hasil Pemilu Legislatif, Pengumuman Hasil Pemilihan Presiden, Pengumuman Susunan Kabinet, Reshuffle Kabinet) Terhadap Sektor-Sektor Industri di Bursa Efek Jakarta. *Jurnal Program Magister Ilmu Ekonomi Bidang Kajian Utama Akuntansi Universitas Padjajaran*, 1.
- Martalena, & Malinda, M. (2011). *Pengantar Pasar Modal*. (Andi, Ed.) Yogyakarta.
- Mauliono, D. A. (2009). *Analisis Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Pergerakan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di Bursa Efek Indonesia*. Jakarta: Fakultas Ekonomi Universitas Gunadarma.

- Mutiasari, D., & Paramita, V. S. (2017). Analisis January Effect pada Return Saham, Abnormal Return dan Trading Volume Activity untuk Kelompok Saham Indeks LQ - 45 di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2013-2016. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis*.
- Pradnyaparamita, N. M., & Rahyuda, H. (2017). PENGUJIAN ANOMALI PASAR JANUARY EFFECT PADA PERUSAHAAN LQ45 DI BURSA EFEK INDONESIA. *E-Jurnal Manajemen Unud*, 6 No. 7.
- Priyambada, R. (2014, february 10). *Pasar Modal*. Retrieved 11 20, 2018, from <http://pasarmodal.inilah.com/read/detail/1816417/january-effectbelum-pasti-akan-terjadi/>:  
<http://pasarmodal.inilah.com/read/detail/1816417/january-effectbelum-pasti-akan-terjadi/>
- Rio, R. M. (2009). Pengaruh Hari Perdagangan terhadap Return Saham. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis*, 2.
- Saputro, A., & Probo. (2014). Day Of The Week Effect dan Month Of The Year Effect Terhadap Return Indeks Pasar. *Jurnal Nominal*, 3.
- Sari, F., Aprilia, Sisdyani, E., & Ardhani. (2014). Analisis January Effect Di Pasar Modal Indonesia. *E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana*, 6, 237-248.
- Setyawasih, R. (2007, Maret). Suatu Panduan Riset Manajemen Keuangan di Pasar Modal. *Jurnal Optimal*, 1 No. 1.
- Subhan, M., Hasan, A., & Wijaya, E. Y. (2016, September 03). ANALISIS PERBEDAAN ABNORMAL RETURN DAN VOLUME ERDAGANGAN SAHAM SEBELUM DAN SESUDAH JANUARY EFFECT PADA SAHAM INDEKS LQ 45 DI BURSA EFEK INDONESIA. *JURNAL TEPAK MANAJEMEN BISNIS*, 8.
- Subhan, M., Hasan, A., & Wijaya, E. Y. (2016, September). ANALISIS PERBEDAAN ABNORMAL RETURN DAN VOLUME ERDAGANGAN SAHAM SEBELUM DAN SESUDAH JANUARY EFFECT PADA SAHAM INDEKS LQ 45 DI BURSA EFEK INDONESIA. *JURNAL TEPAK MANAJEMEN BISNIS*, 8 No. 3.
- Sugiyono. (2014). *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif dan R&D*. Bandung.
- Suliyanto. (2006). *Metode Riset Bisnis*. Yogyakarta: Andi Offset.
- Sutrisno. (2009). *Manajemen Keuangan, Teori, Konsep dan Aplikasi* (1 ed.). Yogyakarta.

- Tandelilin, E. (2010). *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi* (1 ed.). Yogyakarta.
- Trisnawati, F. (2011). Pengaruh Peristiwa Politik Terhadap Perubahan Harga Saham. *Pekbis Jurnal*.
- Wijanarko, & Prasetyono. (2012). Analisis Pengaruh Pemecahan Saham (Stock Split) Terhadap Likuiditas Saham dan Return Saham. *Diponegoro Journal of Management*, 1 No.2, 189-199.
- Yoga. (2010). Analisis Fenomena January Effect terhadap Return Pasar di Bursa Efek Indonesia. *E-Jurnal STIE Atma Bhakti Surakarta*, 1(2), 1-15.

