

DAFTAR PUSTAKA

- Alteza, M. (2007). Efek Hari Perdagangan Terhadap *Return* Saham: Suatu Telaah atas Anomali Pasar Efisien, *Jurnal Ilmu Manajemen*, Vol. 3, No. 1, hal. 31–42.
- Andreas and Daswan, Ria. (2011) ‘Januari Effect Pada Perusahaan LQ 45 Bursa Efek Indonesia 2003-2008’, *Jurnal Ekonomi*, Vol. 19, No. 3, September, hal. 11 – 21.
- Ang, Robert. (1997). *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia*, Jakarta: Mediasoft Indonesia.
- Aryanti, ET (2008). ‘Fenomena The Monday Effect di Bursa Efek Jakarta. *Jurnal Akuntansi dan Keuangan*’, vol 2, no. 1, pp. 293-310
- Ambarwati, Sri Dwi Ari. (2009). ‘Pengujian Week-Four, Monday, Friday dan Earnings Management Effect terhadap *Return* Saham’. *Jurnal Keuangan dan Perbankan*. Vol. 13, no. 3, pp. 487-497.
- Bachtiar, Yanuar. (2009). ‘Day Of The Week Effect Terhadap *Return* dan Volume Perdagangan Saham LQ 45 Dan Non LQ 45’. *Jurnal Keuangan dan Perbankan*. Vol. 13, no. 1, pp. 1-14.
- Best, John W. (1982). *Metodologi Penelitian Pendidikan*, Disunting oleh Sanafiah Faisal dan Mulyadi Guntur Waseso, Surabaya. Usaha Nasional.

- Budileksmana, Antariksa. (2005). Fenomena The Monday Effect di Bursa Efek Jakarta, Simposium Nasional Akuntansi VIII.
- Cahyaningdyah, Dwi. (2010). 'Analisis Monday Effect dan Rogalski Effect di BEJ' *Jurnal Dinamika Manajemen*. Vol. 1, No. 2, 2010, pp: 154-168.
- Chia, Ricky Chee-Jiun, Venus Khim-Sen Liew, and Syed Azizi Wafa Syed Khalid Wafa, (2008) 'Day-of-the-week effects in Selected East Asian stock markets' *Economics Bulletin*, Vol. 7, No. 5, pp. 1-8
- Damodaran, Aswath. (1996). *Investment Valuation*. New York: John Wiley and Sons. Inc.
- Dyl, Edward A and Maberly, Edwin D. (1988). 'A Possible Explanation of the Weekend Effect' *Financial Analysts Journal*, Vol. 44.
- Fama, E. F. (1970). Efficient Capital Markets: A Review of Theory and Empirical Works. *Journal of Finance*, 25, No. 2, 383-417. 1991. Efficient Capital Markets: II. *Journal of Finance*, vol. 46, pp. 1575-1617.
- Fauzi, Nurul. (2010). 'Anomali Harga Saham Weekend Effect di Shanghai Stock Exchange, Bombay Stock Exchange dan Indonesia Stock Exchange' *Jurnal Akuntansi & Manajemen*, Vol. 5, No.1, Juni, pp. 11-20.
- Fitriyani, Indah dan M. Ratna Sari, Maria. (2013). 'Analisis January Effect Pada Kelompok Saham Indeks LQ-45 Di Bursa Efek Indonesia Tahun 2009-2011' *E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana*, Vol. 4, No.2, pp. 421 – 438.

- Ghozali, Imam. (2007). *Aplikasi Analisis Multivariate dengan program SPSS*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Gujarati, D.N. (2006). *Dasar-Dasar Ekonometrika*, Jakarta: Penerbit Erlangga.
- Hartono, Jogiyanto. (2004). *Metodelogi Penelitian Bisnis: Salah Kaprah dan Pengalaman-Pengalaman*. Cetakan Pertama. Yogyakarta: BPFE.
- Hartono, Jogiyanto. (2010). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Keenam. Yogyakarta: BPFE.
- Husnan, S. (2009). *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*, Yogyakarta: UPP STIM YKPN.
- Iramani, Rr. dan Mahdi, A. (2006). Studi Tentang Pengaruh Hari Perdagangan terhadap *Return Saham* pada BEJ. *Jurnal Ekonomi Akuntansi*, November, pp. 63-70.
- Jones, C.P. (1996). *Investment Analysis and Management*, 5th edition, Singapore: John Wiley & Sons, Inc.
- Jones, C.P. (2007). *Investment Analysis and Management*, 10th edition, United States: John Wiley & Sons, Inc.
- Kristiawan, Agung. (2010). 'Analisis *Return Jumat* dan *Return Senin*'. *Jurnal Akuntansi Manajemen Bisnis dan Sektor Publik*, Vol. 7, No. 1, pp. 46 – 62.

Kurniawan, Arief Adhy. (2012). 'Analisis Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham Perusahaan Bidang Telekomunikasi Terdaftar di Bursa Efek Indonesia'. *Jurnal Probisnis*, Vol 5, No. 12, pp. 60-74.

Lakonishok, Josef and Edwin Maberly. (1990). 'Trading Patterns of Individual and Institutional Investors'. *Journal of Finance*, Vol. 45, No. 1, pp. 231-243.

Levy, Haim S. (1996). *Introduction to Investment*. South Western Publishing.

Luhgiatno. (2012). 'Analisa Weekend Effect terhadap *return* saham di Bursa Efek Indonesia' *Jurnal Ilmu Manajemen dan Akuntansi Terapan*, Vol. 2, No. 2, Nopember, pp. 1-11.

Mohamed Khaled Al-Jafari. (2012). 'An Empirical Investigation of the Day-of-the-Week Effect on Stock *Returns* and Volatility: Evidence from Muscat Securities Market' *International Journal of Economics and Finance*, Vol. 4, No. 7; July, pp. 141-149.

Najmudin dan Jaryono.(2010). 'Efek Hari Perdagangan Terhadap *Return* dan Volatilitasnya Pada Saham Indeks LQ 45 di Bursa Efek Indonesia' *PERFORMANCE*, Vol. 12, No. 1, pp. 13-32.

Nik Maheran Nik Muhammad and Nik Muhd Naziman Abd.Rahman. (2010). 'Efficient Market Hypothesis and Market Anomaly: Evidence from Day-of-the week effect of Malaysian Exchange' *International Journal of Economics and Finance*. Vol. 2, No. 2; May 2010, pp. 35-42.

- Patel, Nikunj R, Radadia, Nitesh and Dhawan, Juhi. (2012). 'Day of the week effect of Asian Stock Markets' *International Refereed Research Journal*, Vol. III, Issue –3(3), July, pp. 60-70.
- Rita, Maria Rio. (2009). 'Pengaruh Hari Perdagangan terhadap *Return* Saham di Bursa Efek Indonesia', *Jurnal Ekonomi dan Bisnis*, Vol. XV, No. 2, pp. 121-134.
- Roseliani, Bella dan Khairunnisa. (2015). 'Efek Anomali Pasar Terhadap Return Saham Perusahaan Lq-45 Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Pada Periode 2013. *e-Proceeding of Management*, Vol. 2, No. 2, pp. 1649-1658.
- Sekaran, U. (2006). *Metode Penelitian Untuk Bisnis 1. (4th Ed)*. Jakarta: Salemba Empat.
- Sharpe WF, Alexander Gordon J and Bailey J. (1999). *Investments*, 6th Edition, Prentice Hall.
- Sugiyono. (2007). *Metode Penelitian Pendidikan Pendekatan Kuantitatif, Kualitatif, dan R&D*. Bandung: ALFABETA
- Sularso, Havid., Eko Suyono and Dwi Rahmawanto. (2011). 'Analisis Monday dan Weekend Effect Pada Saham Perusahaan LQ 45 di Bursa Efek Indonesia' *Jurnal Ekonomi*, Vol. 1, No. 1. pp. 1-15.
- Sunariyah. (2004). *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*, Yogyakarta: UPP AMP YKPN.

Tandelilin, E. (2001). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*, Yogyakarta: BPFE.

Tandelilin, S. dan Algifari. (1999). Pengaruh Hari Perdagangan terhadap *Return Saham* di BEJ, *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia*, vol. 14, no. 4, pp. 111-123

Wibowo, Buddi and Junius, Wahyudi. (2005). Pengujian Anomali Pergantian Bulan, Anomali Bulanan, dan Anomali Hari Libur pada IHSG BEJ 1996-2004. *Usahawan* No. 11 Tahun XXXIV November 2005.

Widodo, Purwanto. (2008). 'Studi tentang Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap *Return* IHSG Periode Januari 1997 sampai dengan Mei 2008' National Conference on Management Research.

