

DAFTAR PUSTAKA

- Abdul, Halim. (2005). *Analisis Investasi*. Edisi Kedua. Jakarta: Salemba Empat.
- Ambarwati, S. D. A. (2009). Pengujian Week-Four, Monday, Friday Effect dan Earning Management Effect Terhadap Return Saham. *Jurnal Keuangan dan Perbankan*. 13 (1). 1-14.
- Bursa Efek Indonesia. (2012). *IDX Annual Report 2012*. Jakarta : BEI
- Bursa Efek Indonesia. (2013). *IDX Annual Report 2013*. Jakarta : BEI
- Bursa Efek Indonesia. (2014). *IDX Annual Report 2014*. Jakarta : BEI
- Bursa Efek Indonesia. (2015). *IDX Annual Report 2015*. Jakarta : BEI
- Bursa Efek Indonesia. (2016). *IDX Annual Report 2016*. Jakarta : BEI
- Cahyaningyah, Dwi. (2005). Analisis Pengaruh Hari Perdagangan terhadap *return* Saham. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia*. Vol 20 No. 2. 175-186.
- Darmawan, Deni. (2014). *Metode Penelitian Kuantitatif*. Cetakan Kedua. Bandung: PT. Remaja Rosdakarya.
- Datta, Vadali Sri Ram., Devi, Mynampati Uma., dan Praneeth, Andhe. (2014). An Empirical Study of Holiday Impact on Stock Market Returns. *Indian Research Journal*. Vol. 1, Series. 7, ISSN : 2347-7695.
- Gumanti, Tatang Ary. (2011). *Manajemen Investasi Konsep, Teori dan Aplikasi*. Jakarta: Mitra Wacana Media.
- Hartono, Jogiyanto. (2016). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFE.
- Heyer, D. D. (2001). Stochastic Dominance: A Tool for Evaluating Reinsurance Alternative. *Casualty Actuarial Society (CAS) Form*.

Hsieh, Chin-Shan. (2016). Revisiting the Monthly Effect the Chinese Stock Markets. *Applied Economics Finance*. 3(2). 73-87.

Hsieh, C.-S., dan Chen, A.-T. (2012). Using Stochastic Dominance Criterion to Examine The Day of The Week Effect. *Applied Financial Economics*. 22 (14). 1207-1213.

<https://finance.yahoo.com/> diakses pada 15 Oktober 2017

Husnan, Suad. (2009). *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Edisi Keenam. Yogyakarta: UPP STIM YKPN.

Indrawati. (2015). *Metode Penelitian Manajemen dan Bisnis Konvergensi Teknologi Komunikasi dan Informasi*. Bandung: Aditama.

Iramani dan Mahdi A. (2006). Studi Tentang Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham pada BEJ. *Jurnal Akuntansi dan Keuangan*. 8 (2). 63-70

Ke, Mei-Chu., Chou, Juan-Hsin., Hsieh, Chin-Shan., Chi, Tsung-Li., Chen, Cheng-Te., Liao, Tung Liang. (2014). Testing The Monthly Anomaly with Stochastic Dominance. *Managerial Finance*. 40(2). 137-156

Kwee, Hans. (8 Desember 2012). Manfaat dan Instrumen Investasi Pasar Modal. Berita Satu [online]. Tersedia : <http://www.beritasatu.com/konsultasi/87003-manfaat-dan-instrument-investasi-pasar-modal.html> [1 September 2017]

Laela,Nur., Slamet, Isnandar., Pangedi. (2015). Analisis Anomali Kalender Di Pasar Saham Indonesia dengan Stochastic Dominance. Digilib.uns.ac.id

Laporan Tahunan Perusahaan Periode 2012-2017

May, Ellen. (18 Januari 2013). January Effect ‘Tamu’ Pasar Modal Tiap Awal Tahun. Detik Finance [online]. Tersedia : <https://finance.detik.com/portofolio/2145847/january-effect-tamu-pasar-modal-tiap-awal-tahun> [23 September 2017]

- May, Ellen. (15 September 2016). Mengenal LQ 45. Detik Finance [online]. Tersedia: <https://finance.detik.com/bursa-valas/3298411/mengenal-lq-45> [22 September 2017]
- Putri, Elisabet Lisa Listiani. (4 Januari 2017). Memanfaatkan “January Effect untuk Memilih Saham-saham Paling Menarik. Kompasiana [Online]. Tersedia : <http://ekonomi.kompas.com/read/2017/01/04/120000326/manfaatkan.januaryeffect.untuk.memilih.saham-saham.paling.menarik> [23 September 2017]
- Roseliani, Bella., Khairunnisa, SE., MM. (2015). Efek Anomali Pasar Terhadap Return Saham (Perusahaan LQ-45 yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2013). *E-Proceeding of Management*. 2 (2). 1649-1658.
- Salim, Saint John Bastian. (2013). Pengaruh Holiday Effect Terhadap Return Indonesia Composite Index (Periode 1997-1999 dan 2003- 2005). *FINESTA*. Vol. 1, No.1, 78-85.
- Sanusi, Anwar. (2011). *Metodelogi Penelitian*. Jakarta: Salem Empat
- Saraswati, Yunisa Rahardian., Setiorini, Cicik., dan Cornelia, Dhea Agatha. (2015). Pengaruh *The Day Of The Week Effect*, *Week Four Effect* dan *Rogalsky Effect* terhadap Return Saham LQ 45 di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Riset Akuntansi dan Perpajakan JRAP*. 2(1). 43-54.
- Sari, Fitri Aprilia., Sisdyani, Eka Ardhani. (2014). Analisis *January Effect* di Pasar Modal Indonesia. *E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana* 6.2. 237-248.
- SAW. (9 Mei 2017). Investasi Reksa Dana Saham Menjanjikan di 2017. Metro TV News [online]. Tersedia: <http://ekonomi.metrotvnews.com/read/2017/05/09/698133/investasi-reksa-dana-saham-menjanjikan-di-2017> [25 Oktober 2017]
- Sugiyono. (2017). *Metode Penelitian Kuantitatif Kualitatif Dan R & D*. Bandung : Alfabeta.

Sunariyah. (2011). *Pengantar Pengetahuan pasar Modal*. Edisi keenam. Yogyakarta : UPP-AMP YKPN.

Sunjoyo, dkk. (2013). *Aplikasi SPSS untuk SMART Riset*. Bandung: CV Alfabeta.

Tandelilin, Prof. Dr. Eduardus, MBA, CMW. (2010). *Portofolio dan Investasi, Teori dan Aplikasi*. Edisi Pertama. Yogyakarta: Kanisus.

Tjipto, Darmadji., dan Fakhruddin, Hendry M. (2001). *Pasar Modal di Indonesia*. Jakarta: Salemba Empat.

Trisnadi, Margareta Maria., dan Sedana, Ida Bagus Panji. (2016). Pengujian Anomali Pasar : *Day Of The Week Effect* pada Saham LQ-45 di Bursa Efek Indonesia. *E-Jurnal Manajemen Unud*. 5(6). 3794-3820.

Werastuti, Desak Nyoman Sri. (2012). Anomali Pasar pada Return Saham : *The Day of The Week Effect, Week Four Effect, Rogalsky Effect* dan *January Effect*. *Jurnal Ilmiah Akuntansi dan Humanika*. 2(1). 1-18.

Widiatmodjo, Sawidji. (2015). *Pengetahuan Pasar Modal untuk Konteks Indonesia*. Jakarta: PT Elex Media Komputindo.

www.idx.co.id diakses pada 22 September 2017

Zuraya, Nidia. (24 Maret 2016). BEI: Produk Derivatif LQ-45 Futures Diminati. *Republika* [online]. Tersedia: <http://www.republika.co.id/berita/ekonomi/keuangan/16/03/24/o4jf1w383-bei-produk-derivatif-lq45-futures-diminati> [25 Oktober 2017]