

DAFTAR PUSTAKA

- Alteza, Muniya. (2007). Efek Hari Perdagangan Terhadap Return Saham: Suatu Telaah atas Anomali Pasar Efisien, *Jurnal Ilmu Manajemen*, Vol 3 No 1, 31-42.
- Astuti, Dina dan Legowo, H. Hermawan (2010). Pengujian January Effect di Bursa Efek Jakarta. *Ekonomi dan Kewirausahaan*. Vol 1, No 1, 1-59
- Balint, Cristina; Gica, Oana. 2012. Is the January Effect present on the Romanian capital market?. *Social and Behavioral Sciences*. Vol 58, 523-532.
- Bursa Efek Indonesia. 2010. LQ45 Index Methodology. Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Cahyaningdyah, D. 2005. Analisis Pengaruh Hari Perdagangan terhadap Return Saham. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia*, 20 (2): 175-186.
- Choi, Seung Hee dan Chhabria, Manesh. 2013. Window Dressing in Mutual Fund Portfolios: Fact or Fiction?. *Journal of Financial Regulation and Compliance*. Vol 21. Iss 2.
- Chotigeat T., Pandey I.M. (2005). Seasonality in Asia's Emerging Markets: India and Malaysia. *International Trade and Finance Association*, 53.
- Chopra, Navin dan Ritter Jay R. 1989. Portfolio Rebalancing and the Turn-of-the-Year Effect. *The Journal of The American Finance Association*. Vol 44, Iss 1. Hal 7-26.
- Deannes, Putri Cahya Pertiwi dan Isyuardhana. 2015. January Effect Pada Perusahaan LQ 45 Di Bursa Efek Indonesia Periode 2009-2013. *E-Proceeding of Management*. Vol 2, No 1, 524-538.
- Dewi, Komang Ayu Setia. 2012. Perbedaan Volume Pergerakan Saham Sebelum dan Sesudah Reverse Stock Split pada Perusahaan yang Terdaftar di BEI Periode 2007-2011. *E-Jurnal Akuntansi*.
- Fama, Eugene F. 1991. Efficient Capital Market: a Review of Theory and Empirical Work. *Journal of Finance*. Vol 25, No 2, 387-417.
- Fitriyani, Indah dan Sari, Maria M. Ratna. (2013). Analisis January Effect pada Kelompok Saham Indeks LQ-45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2009-2011. *E-Jurnal Akuntansi*. Vol 4, No. 2, 421-438.
- French, K. R. (1980). Stock Prices: A Problem in Verification. *The Journal of Business of University of Chicago*, Vol 4, No 4, 415-418.
- Ghozali, Imam. (2013). *Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS 19*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.

- Ghozali, Imam. (2016). *Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS 23*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Gibbons, M. R., dan Hess, P. (1981). Day of the Week Effect and Asset Returns. *The Journal of Business*, Vol 54, No 4, 579-596.
- Gumanti, Tatang Ary dan Elok Sri Utami. 2002. "Bentuk Pasar Efisien dan Pengujiannya". *Jurnal Akuntansi dan Keuangan*, Vol. 4, No. 1, hal. 54-68.
- Haming, M. dan Basalamah, S. (2010), *Studi Kelayakan Investasi Proyek dan Bisnis*, Jakarta: Bumi Aksara.
- Hanafi, Mamduh M, dan Abdul Halim. 2012. *Analisis Laporan Keuangan, Edisi Keempat*. Yogyakarta: UPP STIM YKPN.
- Hartono, Jogiyato. 2003. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Ketiga. Cetakan Pertama. Yogyakarta: BPFE.hm. 195.
- Hartono, Jogiyanto. 2011. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFE.
- Hendranata, Tatang Rio. 2016. Analisis Day of the Week Effect dan Rogalski Effect pada Saham Indeks LQ45. *Parsimonia*, Vol. 2, No. 1, hal 77-88.
- Henke, Herald. 2004. Tax-loss Selling and Window Dressing: An Investigation of The January Effect in Poland. *Papers Faculty of Economics European University of Viadrina*.
- Horne, James C. Van dan John M Wachowicz, Jr. 2012. *Prinsip-prinsip Manajemen Keuangan (Edisi 13)*. Jakarta: Salemba Empat.
- Iramani & Mahdi. A. 2006. Studi tentang Pengaruh Hari Perdagangan terhadap Return Saham pada BEI. *Jurnal Ekonomi Akuntansi*, November, hal.63-70.
- Maliasari, Karina. 2014. Pengaruh January Effect dan Rogalski Effect terhadap Abnormal Return Saham dan Trading Volume Activity (Studi Pada Perusahaan LQ45 yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia). *Jurnal Ilmiah Mahasiswa FEB*. Vol 2, No 2, 1-18
- Martalena dan Malinda, Maya. 2011. *Pengantar Pasar Modal. Edisi Pertama*. Yogyakarta: ANDI
- Muniya Alteza, 2006. Efek Hari Perdagangan Terhadap Return Saham: Suatu Telaah Atas Anomali Pasar Efisien. *Jurnal Ilmu Manajemen*. Vol. 3 No. 1, 31-42
- Pahlevim Reza Widhar, 2016, Anomali Pasar pada Return Saham LQ 45 di Bursa Efek Indonesia: Fenomena The Day of The Week Effect, Week Four Effect, Rogalski Effect, dan January Effect, *Jurnal Riset Akuntansi dan Keuangan*, Vol. 12, No. 1, 51-64

- Patel, Jayden B. 2016. The January Effect Anomaly Reexamined In Stock Returns. *Business and Economics*. Vol 32, Iss 1, 317-324.
- Pradnyaparamita, Ni Made W; Rahyuda, Henny. 2018. Pengujian Anomali Pasar January Effect Pada Perusahaan LQ45 Di Bursa Efek Indonesia. *E-Jurnal Manajemen Unud*. Vol 6, No 7, 3513-3539.
- Rita, Maria Rio. (2009). Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham: Pengujian Day of the Week Effect, Week-Four Effect dan Rogalski Effect di BEI. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis*. Vol 15, No 2, 121-124.
- Rogalski, R.J. 1984. New Findings Regarding Day of The Week Returns Over Trading and non-Trading periods: a Note. *Journal of Finance*. Vol 39, No. 5, 1603-1614
- Subhan, M., Amir, H., Wijaya, EY. 2016. Analisis Perbedaan Abnormal Return dan Volume Perdagangan Saham Sebelum dan Sesudah January Effect pada Saham Indeks LQ 45 di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Tepak Manajemen Bisnis*. Vol III, No. 3, 1-12.
- Sugiyono. 2013. *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif, dan R&D*. Bandung: CV Alfabeta
- Tandelilin, Eduardus. 2010. *Portofolio dan Investasi*. Kanisius: Yogyakarta.
- Wardana, Erwin Pandu. 2017. *Analisis Hubungan Indeks LQ45 Bursa Efek Indonesia Dengan Indeks Bursa Utama Dunia Tahun 2007-2016*, Skripsi Sarjana, Lampung: Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Lampung.