

DAFTAR PUSTAKA

- Ahsan. Mainul. F. M., dan Sarkar. H Ahasan. 2013. *Does January Effect Exist in Bangladesh. International Journal of Business and Management*, Vol 8, No 7
Maret 2013.
(<http://www.ccsenet.org/journal/index.php/ijbm/article/view/24206>).
Diakses tanggal 10 Januari 2014.
- Al-Jafari. Khaled. Mohamed. 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
Juli 2012.
(<http://ccsenet.org/journal/index.php/ijef/article/download/18329/12124>).
Diakses Tanggal 12 Maret 2013.
- Al-Rjoub. A.M. Samer., dan Alwaked Ahmad. 2010. *January Effect during Financial Crises: Evidence from the U.S. European Journal of Economics, Finance and Administrative Sciences*, ISSN 1450-2275 Tahun 2010.
(http://www.researchgate.net/publication/245536066_January_Effect_during_Financial_Crises_Evidence_from_the_U.S/file/3deec51d755c632409.pdf).
Diakses tanggal 18 Januari 2014
- As'adah Luluk. 2009. Pengaruh *January Effect* Terhadap *Abnormal Return* dan *Volume* Perdagangan Saham di *Jakarta Islamic Index (JII)*. Skripsi. Program Studi Manajemen Keuangan Islam Universitas Islam Negeri Sunan Kalijaga. Yogyakarta. (<http://www.thedigilib.com/doc/41380-pengaruh-january-effect-terhadap-abnormal-return-dan-volume-perdagangan-pada-saham-di-jakarta-islamic-index-jii-#.UZIxKfJOKKE>). Diakses tanggal 20 April 2013.
- Astuti. Dina., dan Legowo. Herman. 2010. *Testing Of January Effect Stock Exchange in Jakarta (LQ 45 Company Cas Studies on the JSE)*. (<http://ejournal.stienusa.ac.id/index.php/accounting/article/download/80/65>).
Diakes tanggal 8 April 2013.
- Bursa Efek Indonesia. 2010. *Struktur Pasar Modal Indonesia*. (<http://www.idx.co.id/id-id/beranda/tentangbei/strukturpasarmodalindonesia.aspx>). Diakes tanggal 10 Mei 2013.
- Chu. James. Chia-Shang., Liu Tung., Rathianasamy. R. S. 2004. *Robust Test Of The January Effect In Stock Markets Using Markov - Swtching Model*. *Journal of Financial Management and Analysis*, Vol 17, No 1, 2004:22-33.
(http://tliu.iweb.bsu.edu/research/papers/jfma2004v17n1p22_chu.pdf).
Diakes tanggal 8 April 2013

- Daswan, Ria., dan Andreas. 2011. *Januari Effect Pada Persahaan LQ 45 Bursa Efek Indonesia 2003-2008*. Jurnal Ekonomi, Vol 19, No 3 September 2011. (http://www.google.com/url?sa=t&rct=j&q=januari%20effect%20pa3%3Ea%20perusahaan%20LQ%2045%20bursa%20efek%20indonesia%202003%20-%202008%20andreas%20dan%20ria%20daswan&source=web&cd=1&cad=rja&ved=0CC0QFjAA&url=http%3A%2F%2Fportalgaruda.org%2Fdownload_article.php%3Farticle%3D31482&ei=-C-SUa6RLsW-rgfO_oHQBg&usg=AFQjCNGtujwQH9gyqIws2pi94n8yRbXfqg&bvm=bv.46471029,d.bmk). Diakses tanggal 18 April 2013.
- Fama. Eugene. F. 1969. *Efficient Capital Markets: A Review of Theory and Emperical Work*. *The Journal of Finance*, Vol 25, No 2 Desember 1969:383-417. (<http://www.jstor.org/discover/10.2307/2325486?uid=3738224&uid=2&uid=4&sid=21102215395981>). Diakses tanggal 18 April 2013.
- Ghozali. Imam. 2006. *Aplikasi Analsisi Multivariate dengan Program SPSS*. Edisi Keempat. Badan Penerbit Universitas Diponogoro. Semarang.
- Priyambada. Reza. 2012. Pasar Modal. *January Effect Belm Pasti Akan Terjadi*. (<http://pasarmodal.inilah.com/read/detail/1816417/january-effect-belum-pasti-akan-terjadi/>). Diakses tanggal 10 Februari 2014.
- Pratomo. Wahyu. Agus. 2007. *January Effect dan Size Effect Pada Bursa Efek Jakarta (BEJ) Periode 1998-2005*. Tesis. Program Pasca Sarjana Magister Manajemen Universitas Diponogoro Semarang. (<http://eprints.undip.ac.id/17919/>). Diakes tanggal 8 April 2013
- Investor Daily*. 2012. *January Effect Dorong IHSG Menguat Signifikan*. (<http://www.investor.co.id/home/january-effect-dorong-ihsg-menguat-siqnifikan/27311>). Diakses tanggal 20 April 2013
- Ishak. Vivin. Tabitha. 2013. *Hari Libur Nasional, Return dan Abnormal Return di BEI*. Skripsi. Program Studi Manajemen Sekolah Tinggi Ilmu Ekonomi Musi Palembang.
- Jogiyanto. Hartono. 2012. *Pasar Efisien Secara Informasi, Operasional, dan Keputusan*. Edisi 2. BPEE-Yogyakarta. Yogyakarta
- Kuncoro. Mudrajad. 2009. *Metode Riset Untuk Bisnis & Ekonomi*. Edisi ketiga. Erlangga. Jakarta.

- Manulife. 2013. *Monthly Market Review: Mei 2013*. (<http://www.google.com/url?sa=t&rct=j&q=&esrc=s&source=web&cd=2&cad=rja&uact=8&ved=0CC8QFjAB&url=http%3A%2F%2Fwww.manulife-indonesia.com%2FDownload%2FFFS%2F06May2013%2FMarket%2FMarketReviewMay-Bahasa.pdf&ei=t4wxU8PLN4WTrgeruoHQCw&usg=AFQjCNHdKCBu0D9uvzz6jIJSjUnB47AF8A&bvm=bv.63587204,d.bmk>). Diakses tanggal 24 Maret 2014
- Manulife. 2011. *Monthly Market Review: September 2011*. (http://www.reksadana-manulife.com/file/montly/2011/08_Market%20Outlook%20Aug%202011bahasa.pdf). Diakses tanggal 24 Maret 2014
- May. Ellen. 2013. *January Effect Tamu Pasar Modal Tiap Awal Tahun*. (<http://finance.detik.com/read/2013/01/18/072306/2145847/479/january-effect-tamu-pasar-modal-tiap-awal-tahun>). Diakses tanggal 8 April 2013.
- May. Ellen. 2012. *Sukses Investasi Saham Memanfaatkan Siklus Bulanan Saham*. (<http://www.ilmu-investasi.com/2012/10/sukses-investasi-saham-memanfaatkan.html#>). Diakses tanggal 24 Maret 2014.
- Indonesian. Rupiah Melemah, Pelaku Pasar Panik. 2013. (http://indonesian.irib.ir/en/asia-pasifik/-/asset_publisher/o5ZK/content/id/5505962/pop_up?_101_INSTANCE_o5ZK_viewMode=print). Diakses tanggal 24 Maret 2014.
- Irfani. S. Agus. 2011. *Dampak Krisis Global Atas Kinerja Bursa*. <http://www.neraca.co.id/article/5977/Dampak-Krisis-Global-Atas-Kinerja-Bursa/2>. Diakses tanggal 2 Februari 2014.
- Santoso. Singgih. 2009. *Panduan Lengkap Menguasai Statistik dengan SPSS 17*. Edisi Pertama. Jakarta: PT. Elex Media Komputindo.
- S. H. Purwanto dan Suharyadi. 2007. *Statistika untuk Ekonomi dan Keuangan Modern*. Edisi Kedua. Jakarta: Salemba Empat.
- Sevinc. Guler. 2013. *January Effect In Stock Returns: Evidence From Emerging Markets. Interdisciplinary Journal Of Contemporary Research In Business*. Vol 5, No 4 Agustus 2013. (<http://journal-archieves35.webs.com/641-648.pdf>). Diakses tanggal 10 Januari 2014.
- Sihombing. Pardomuan. 2010. *Adakah January Effect di Bursa Efek Indonesia*. (<http://economy.okezone.com/read/2010/01/06/279/291364/adakah-january-effect-di-bursa-indonesia/large>). Diakses Tanggal 22 September 2013.

Suliyanto. 2009. *Metode Riset Bisnis*. Andi. Yogyakarta

Tandelilin. Eduardus. 2010. *Portofolio dan Investasi: Teori dan Aplikasi*. Edisi Pertama. Yogyakarta: Kanisius.

Tim Bursa Efek Indonesia. 2011. *Anomali Pasar*.
(<http://economy.okezone.com/read/2011/01/03/226/409673/redirect>).
Diakses Tanggal 18 April 2013