

DAFTAR PUSTAKA

- tt. “*Small Firm Effect*”. www.investopedia.com, diunduh pada tanggal 29 November 2017, pukul 12.00 WIB.
- tt. “Perusahaan Manufaktur di BEI”, www.sahamok.com, diunduh pada tanggal 5 November 2017, pukul 16.15 WIB.
- tt. “Kapitalisasi Pasar”, www.sahamok.com, diunduh pada tanggal 8 Oktober 2017, pukul 12.18 WIB.
- tt. “Saham *Stock Split* dan *Stock Reverse*”, www.sahamok.com, diunduh pada tanggal 8 Oktober 2017, pukul 14.23 WIB.
- tt. “Daftar Emiten *Right Issue*”, www.sahamok.com, diunduh pada tanggal 8 Oktober 2017, pukul 16.10 WIB.
- tt. 2017. “*Bullish* adalah”. www.pusatis.com, diunduh pada tanggal 11 November 2017, pukul 14.55 WIB.
- tt. 2017. “*Bearish* adalah”. www.pusatis.com, diunduh pada tanggal 11 November 2017, pukul 14.58 WIB.
- tt. 2017. “Pengertian Aset dan Jenis-Jenisnya”. www.rocketmanajemen.com, diunduh pada tanggal 15 November 2017, pukul 13.09.
- Chaibi, Anissa, Sabrina Alioui, dan Bing Xiao. 2014. *On The Impact of Firm Size on Risk and Return: Fresh Evidence From The American Stock Market Over The Recent Years*. www.pdf.semanticscholar.org, diunduh pada tanggal 17 November 2017, pukul 13.15 WIB.
- Daniel dan Abriandi. 2017. Analisis Fenomena *Monday Effect* pada Saham LQ45 di Bursa Efek Indonesia Periode 2013-2015. *Kalbisocio*, Volume 4 No 1 Februari 2017. www.research.kalbis.ac.id, diunduh pada tanggal 15 Oktober 2017, pukul 15.14
- Duy, Nguyen Tanh dan Nguyen Pham Huu Phuoc. 2016. *The Relationship between Firm Sizes and Stock Returns of Service Sector in Ho Chi Minh City Stock Exchange. Review of European Studies*; Vol. 8, No. 4; 2016. www.ccsenet.org, diunduh pada tanggal 18 Oktober 2017, pukul 13.14 WIB.
- Fauzi, Yuliyanna. 2017. “Kenaikan Peringkat RI Sukses Kerek Pertumbuhan Investasi”. www.cnnindonesia.com, diunduh pada tanggal 7 Februari 2018, pukul 20.21 WIB.

- Gu, Qian. 2015. *Size and Book-to-Market Factors in Returns*. www.digitalcommons.usu.edu, diunduh pada tanggal 15 November 2017, pukul 13.35 WIB.
- Ghozali, Imam. 2013. Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS21 Update PLS Regresi. Semarang: Universitas Diponegoro.
- Hartono, Jogiyanto. 2015. Metodologi Penelitian Bisnis Salah Kaprah dan Pengalaman-Pengalaman. Yogyakarta: BPFPE.
- Imandani, Rama. 2008. Analisa Anomali Kalender terhadap *Return* di Bursa Efek Indonesia. *Skripsi*. Jakarta: Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah. www.repository.uinjkt.ac.id, diunduh pada tanggal 5 November 2017, pukul 13.34 WIB.
- Kuncoro, Mudrajad. 2013. Metode Riset Untuk Bisnis & Ekonomi: Bagaimana Meneliti dan Menulis Tesis. Edisi Keempat. Jakarta: Penerbit Erlangga.
- Mar'ati, Fudji Sri. 2012. Pengaruh *Firm Size* terhadap *Return Saham* Pada Perusahaan Manufaktur Yang Tercatat di Bursa Efek Indonesia Periode 2004-2009. *Among Makarti* Vol.6 No.12, Desember 2013. www.jurnal.stieama.ac.id, diunduh pada tanggal 2 November 2017, pukul 10.14 WIB.
- Nugraha, Harry Satria. 2015. Pengaruh *Working Capital Turnover, Economic Value Added, Dan Market Value Added* Terhadap *Market Capitalization* pada BUMN Yang Terdaftar di Bei Periode 2009 – 2013. www.repository.usu.ac.id, diunduh pada tanggal 15 November 2017, pukul 14.17 WIB.
- Perez, Gerardo Alfonso. 2017. *Company Size Effect in the Stock Market of Thailand*. *International Journal of Financial Research*, Vol. 8, No. 3; 2017. www.sciedu.ca, diunduh pada tanggal 17 November 2017, pukul 12.11 WIB.
- Pratomo, Agus Wahyu. 2007. *January Effect dan Size Effect* pada Bursa Efek Jakarta (BEJ) Periode 1998-2005. *Tesis*. Semarang: Program Pascasarjana Universitas Diponegoro.
- Rahina, Daniel Ngantu. 2003. Analisis Pengaruh Ukuran Perusahaan dan Beta terhadap *Return Saham LQ45* pada Pasar *Bullish* dan *Bearish* di Bursa Efek Jakarta Periode 1997-1999. *Tesis*. Semarang: Program Pascasarjana Universitas Diponegoro. www.eprints.undip.ac.id, diunduh pada tanggal 6 Desember 2017, pukul 09.54 WIB.

- Rahmawati, Suci. 2016. Analisis *Monday Effect* Dan *Weekend Effect* pada *Return Saham Perusahaan LQ 45* di Bursa Efek Indonesia. *Skripsi*. Yogyakarta: Univeristas Negeri Yogyakarta. www.eprints.uny.ac.id, diunduh pada 5 November 2017, pukul 13.16 WIB.
- Roviq, Wirawan. 2012. Analisis *Overreaction Hypothesis*, Dan Pengaruh *Firm Size* Serta *Bid-Ask Spread* Terhadap Fenomena *Price Reversal* Di Bursa Efek Indonesia Periode 2008- 2010. www.eprints.uny.ac.id, diunduh pada tanggal 5 November 2017, pukul 14.07 WIB.
- Saleh, Volanda Aziz. 2012. Pengaruh Informasi Akuntansi Terhadap Perubahan Harga Saham Perusahaan Pertambangan Go Public di Bursa Efek Indonesia. www.fe-akuntansi.unila.ac.id, diunduh pada tanggal 7 Februari 2018, pukul 20.16 WIB.
- Saputra, Sendhy. 2014. Analisis Perbedaan Nilai Properti Investasi, Total Aset, dan Laba Perusahaan Sebelum dan Sesudah Penerapan PSAK 13 Adopsi IFRS pada Seluruh Perusahaan Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *Skripsi*. Palembang: Universitas Katolik Musi Charitas.
- Schwert, G. William. 2003. “*Anomalies And Market Efficiency*”. *Handbook of the Economics of Finance*, Edited by G.M. Constantinides, M. Harris and R. Stulz Elsevier Science B.V. www.schwert.ssb.rochester.edu, diunduh pada tanggal 15 Oktober 2017, pukul 10:11 WIB.
- Situmorang, Anggun P. 2017. “BEI: Tak Ada Penurunan Daya Beli, Masyarakat Kini Pilih Investasi”. www.merdeka.com, diunduh pada tanggal 6 Oktober 2017, pukul 16.08 WIB.
- Sudiyatno dan Irsad. 2011. Menguji Model Tiga Faktor Fama dan French Dalam Mempengaruhi *Return Saham Studi* pada Saham LQ45 di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Bisnis dan Ekonomi (JBE)*, September 2011, Vol. 18, No. 2. Hal. 126 – 136
- Sugiyono. 2010. *Metode Penelitian Bisnis (Pendekatan Kuantitatif, Kualitatif, dan R&D)*. Bandung: Alfabeta.
- Suherna, Melda. 2014. “Pengaruh Tingkat Pengembalian Modal dan Likuiditas Terhadap Pengembalian Saham (Studi Kasus Pada Perusahaan Otomotif Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2008-2012)”. www.elib.unikom.ac.id, diunduh pada tanggal 5 November 2017, pukul 12.11 WIB.
- Tandelilin, Eduardus. 2010. *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi*. Yogyakarta: Kanisius.

- Wening, Andhika Anggoro. 2016. "Ini Daftar Emiten Penerbit *Rights Issue* Total Rp50 Triliun". [www. market.bisnis.com](http://www.market.bisnis.com), diunduh pada tanggal 8 Oktober, pukul 16.15 WIB.
- Wijaya, Ign. Krisna Adi. 2004. Analisis Pengaruh Beta dan Kapitalisasi Perusahaan Terhadap Tingkat Pengembalian Saham dalam Keadaan Pasar Bullish dan Bearish. [www. lib.ui.ac.id](http://www.lib.ui.ac.id), diunduh pada tanggal 17 November 2017, pukul 14.18 WIB.
- Wiyono, Gendro. 2011. Merancang Penelitian Bisnis dengan Alat Analisis SPSS 17. & SmartPLS 2.0. STIM YKP: Yogyakarta.
- Yanuarta, Ramel. 2012. Anomali *Size Effect* di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Kajian Manajemen Bisnis* Volume 1, Nomor 1, Maret 2012. www.ejournal.unp.ac.id, diunduh pada tanggal 8 Oktober 2017, pukul 15.12 WIB)
- Zadeh, Amir-Amel. 2011. *The Return of the Size Anomaly: Evidence from the German Stock Market. European Financial Management*, Vol. 17, No. 1, 2011, 145–182.