

DAFTAR PUSTAKA

- Ali, Ruhani, dkk. 2011. Stock Market Overreaction and Trading Volume: Evidence From Malaysia. *Asian Academy of Management Journal of Accounting and Finance* (online). (<http://web.usm.my/journal/aamjaf/vol%207-2-2011/7-2-4.pdf>). Vol. 7 No.2. Hal. 103-119. Diakses tanggal 25 Maret 2016.
- Aulia, Nadhira Nur, dkk. 2016. Analisis Abnormal Return Saham Winner dan Saham Loser untuk Mengidentifikasi Price Reversal (Studi pada Perusahaan yang Terdaftar dalam Indeks LQ 45 di BEI Periode 2014-2015). *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB)* (online). (<http://administrasibisnis.studentjournal.ub.ac.id/index.php/jab/article/view/1298>). Vol. 33 No. 1. Diakses tanggal 12 Juni 2016.
- Aunilah, Rizqi Alfi & Abdul Ghofar. 2014. Pengaruh Accrual Anomaly dan Winner-Loser Anomaly Terhadap Abnormal Return di Indonesia. *Jurnal Ilmiah Ekonomi dan Bisnis Universitas Brawijaya*. Vol. 4 No. 2.
- Bursa Efek Indonesia. 2016. Data Daftar Saham Indeks Kompas 100 Tahun 2012-2016. (online). (<http://www.idx.co.id/>). Diakses tanggal 4 Maret 2016.
- Dinawan, Muhammad Rizkada. 2007. Analisis Overreaction Hypothesis dan Pengaruh Firm Size, Likuiditas dan Bid-Ask Spread Terhadap Fenomena Price Reversal di Bursa Efek Jakarta. *Tesis*. (<https://core.ac.uk/download/pdf/11717953.pdf>). Universitas Diponegoro. Semarang. Diakses tanggal 18 Maret 2016.
- Ghozali, Imam. 2005. *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS*. Badan Penerbit Universitas Diponegoro. Semarang.
- Hartono, Jogyanto. 2007. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi 2007. BPF. Yogyakarta.
- Mudrajad, Kuncoro. 2013. *Metode Riset untuk Bisnis dan Ekonomi*. Edisi 4. Penerbit Erlangga. Jakarta.
- Pasaribu, Rowland Bismark Fernando. 2011. Anomali Overreaction Di Bursa Efek Indonesia: Penelitian Saham LQ-45. *Jurnal Ekonomi & Bisnis* (online). (https://www.academia.edu/attachments/31546696/download_file?st=MTQ2ODg4NzI0NywzNi43Ny45OC44Niw0MzM3OTAyNg%3D%3D&s=swp-toolbar). Vol. 5 No.2. Hal 87-115. Diakses tanggal 29 Februari 2016.
- Prakoso, Indra. 2009. Analisis Market Overreaction Yang Ditandai Dengan Pembalikan Harga Jangka Pendek, Pada Saham-Saham Yang

- Diperdagangkan Di Bursa Efek Indonesia Dengan Periode Penelitian Januari Hingga Desember 2007. *Skripsi*. (<http://lib.ui.ac.id/file?file=digital/127026-6632-Analisis%20market-Literatur.pdf>). Universitas Indonesia. Depok. Diakses tanggal 20 Juli 2016.
- Saham Ok. 2016. Data Daftar Saham Indeks Kompas 100 Tahun 2012-2016. (*online*). (<http://www.sahamok.com/>). Diakses tanggal 4 Maret 2016.
- Saputro, R. Narendra & Ida Bagus Badjra. 2016. Kinerja Portofolio Saham Berdasarkan Strategi Investasi Momentum pada Industri Manufaktur. *E-Jurnal Manajemen Unud* (*online*). (<http://ojs.unud.ac.id/index.php/Manajemen/article/view/16759/11926>). Vol. 5 No. 1. 2016: 623-649. Diakses tanggal 29 Februari 2016.
- Sartono, Agus. 2001. *Manajemen Keuangan Teori dan Aplikasi*. Edisi 4. BPF. Yogyakarta.
- Suarmanayasa, I Nengah & Gede Putu Agus Jana Susila. 2012. Eksistensi Anomali Winner-Loser Saham Industri di Pasar Modal Indonesia. *Jurnal Ilmiah Akuntansi dan Humanika JINAH* (*online*). (<http://ejournal.undiksha.ac.id/index.php/JJA/article/view/553>). Vol. 2 No. 1. Diakses tanggal 26 Februari 2016.
- Swandewi, Gusti Ayu Era & I Made Mertha. 2013. Abnormal Return Portofolio Winner-Loser Saham Manufaktur di PT. Bursa Efek Indonesia. *E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana* (*online*). (<http://ojs.unud.ac.id/index.php/Akuntansi/article/view/6943/5203>). 5.1 (2013). 85-89. Diakses tanggal 3 Maret 2016.
- Tandelilin, Eduardus. 2001. *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Edisi Pertama. BPF. Yogyakarta.
- Tandelilin, Eduardus. 2010. *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi*. Edisi Pertama. Penerbit Kanisius. Yogyakarta.
- Widiastuti, Ekaningtyas & Jaryono. 2011. Short Contrarian Investment Strategy : Pengujian Winner-Loser Anomaly pada Saham-Saham di Bursa Efek Indonesia. *Dosen Fakultas Ekonomi Unsoed* (*online*). (<http://jp.feb.unsoed.ac.id/index.php/Performance/article/viewFile/63/68>). Vol. 14 No. 2. Hal 49-63. Diakses tanggal 7 Maret 2016.
- Wiksuana, I Gst. Bgs. 2009. Kinerja Portofolio Saham Berdasarkan Strategi Investasi Momentum di Pasar Modal Indonesia. *Jurnal Manajemen dan Kewirausahaan* (*online*). (<http://jurnalmanajemen.petra.ac.id/index.php/man/article/viewFile/17747/17667>). Vol. 11 No. 1. Hal 73-84. Diakses tanggal 1 Maret 2016.

- Yahoo Inc. 2016. Data Harga Saham dan IHSG. (*online*). (<http://www.finance.yahoo.com/>). Diakses tanggal 5 Maret 2016.
- Yulianawati, Enny. 2003. Pengujian Anomali Winner-Loser di Bursa Efek Jakarta. *Tesis*. (<http://eprints.undip.ac.id/10669/1/2003MM2178.pdf>). Universitas Diponegoro. Semarang. Diakses tanggal 28 Maret 2016.
- Yull, Elline & Kirmizi. 2012. Analisis Overreaction Hypothesis dan Pengaruh Ukuran Perusahaan, Bid-Ask Spread, dan Likuiditas Saham Terhadap Fenomena Price Reversal. *Pekbis Jurnal* (*online*). (<http://ejournal.unri.ac.id/index.php/JPEB/article/view/424/418>). Vol. 4 No. 1. Hal 1-16. Diakses tanggal 15 April 2016.