

DAFTAR PUSTAKA

- Ambarwaty, Arum. 2016. Pengujian *The Day of The Week Effect, Week Four Effect*, dan *Rogalsky Effect* Terhadap *Return Saham Jakarta Islamic Index* di Bursa Efek Indonesia. Skripsi. Program Studi Akuntansi Universitas Muhammadiyah Surakarta. <http://eprints.ums.ac.id/46173/1/NASKAH%20PUBLIKASI.pdf>. Diakses pada 22 Februari 2018.
- Conrad, Jennifer & Gautam Kaul. 1988. *Time-Variation in Expected Returns*. Vol.61, No.4. https://www.jstor.org/stable/2352789?seq=1#page_scan_tab_contents. Diakses pada 7 Februari 2018.
- Ghozali, Imam. 2013. *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS 21: Update PLS Regresi*. Edisi 7. Badan Penerbit Universitas Diponegoro. Semarang.
- Giovanis, Eleftherios. 2014. *The Turn-of-The-Month Effect: Evidence From Periodic Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity (PGARCH) Model*. <https://www.researchgate.net/publication/275099097> The Turn-of-The-Month-Effect Evidence from Periodic Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity PGARCH Model. Diakses pada 16 Maret 2018.
- Handayani, Putu Sukma dan I Wayan Suartana. 2014. Pengaruh Hari Perdagangan Pada *Abnormal Return* dan Volatilitas *Return Saham Indeks LQ45*. <https://ojs.unud.ac.id/index.php/Akuntansi/article/view/10419/8541>. Diakses pada 26 Desember 2017.
- Hartono, Jogiyanto. 2004. *Metodologi Penelitian Bisnis (Salah Kaprah dan Pengalaman-Pengalaman)*. Edisi 6. BPFE UGM. Yogyakarta.
- Hartono, Jogiyanto. 2016. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi 10. BPFE-Yogyakarta. Yogyakarta.
- Hermasah. 2017. Estimasi *Value At Risk* Dengan Distribusi Normal Untuk Memprediksi Return Investasi. Vol.1, No.2. <https://www.researchgate.net/publication/318964022> Estimasi Value At Risk Dengan Distribusi Normal Untuk Memprediksi Return Investasi. Diakses pada 10 Juli 2018.
- Hermawan, Asep dan Husna Leila Yusran. 2017. *Penelitian Bisnis Pendekatan Kuantitatif*. Edisi 1. Kencana. Depok.
- Hersugondo, H., dkk. 2013. *The Test of Day of The Week Effect and Turn Of The Month Effect by Using a GARCH Approach: Evidence From Indonesia Capital Market*. <http://www.serialsjournals.com/serialjournalmanager/pdf/1463726064.pdf>. Diakses pada 23 Februari 2018.

- IDX. 2018. Saham. <http://www.idx.co.id/produk/saham/>. Diakses pada 10 Februari 2018.
- Imandani, Rama. 2008. Analisa Anomali Kalender Terhadap *Return* di Bursa Efek Indonesia. Skripsi. Program Studi Manajemen Universitas Negeri Syarif Hidayatullah Jakarta. <http://repository.uinjkt.ac.id/dspace/bitstream/123456789/17135/1/Rama%20Imandani.pdf>. Diakses pada 23 Februari 2018.
- Iskamto, Dedi. 2015. Anomali Pasar Pada Bursa Efek Indonesia. https://www.researchgate.net/profile/Dedi_Iskamto2/publication/321712928_Anomaly_Pasar_Pada_Bursa_Efek_Indonesia/links/5a2cc8220f7e9b63e53aee55/Anomaly-Pasar-Pada-Bursa-Efek-Indonesia.pdf. Diakses pada 26 Desember 2017.
- Kadir, Sherly. 2014. Fenomena *January Effect* di Bursa Efek Indonesia (Studi Pada Perusahaan yang Terdaftar di LQ45 Periode 2010-2013). Skripsi. Program Studi Manajemen STIE Musi Palembang.
- Kayacetin, Volkan & Senad Lekpek. 2016. *Turn-of-The-Month Effect: New Evidence From an Emerging Stock Market*. Vo.18. <https://www.science-direct.com/science/article/abs/pii/S154461231630054X>. Diakses pada 21 Agustus 2017.
- Kolahi, Firoozeh. 2007. *Turn-of-The-Month Effect For The European Stock Market*. summit.sfu.ca/system/files/iritems1/2796/etd2349.pdf. Diakses pada 20 Maret 2018.
- KSEI. 2018. *Stock Split*. <http://www.ksei.co.id/>. Diakses pada 11 Februari 2018.
- Lo, Andrew W. & A. Craig Mackinlay. 1988. *Stock Market Prices Do Not Follow Random Walks: Evidence From a Simple Specification Test*. Vol.1, No.1. <https://academic.oup.com/rfs/article-abstract/1/1/41/1601244?redirectedFrom=fulltext>. Diakses pada 7 Februari 2018.
- Lutfiaji. 2014. Pengujian *The Day of The Week Effect, Week Four Effect, dan Rogalski Effect* Terhadap Return Saham LQ45 di Bursa Efek Indonesia. <http://download.portalgaruda.org/article.php?article=189405&val=6467&title=PENGUJIAN%20THE%20DAY%20OF%20THE%20WEEK%20EFFECT,%20WEEK%20FOUR%20EFFECT,%20DAN%20ROGALSKY%20EFFECT%20TERHADAP%20RETURN%20SAHAM%20LQ-45%20DI%20BURSA%20EFEK%20INDONESIA>. Diakses pada 22 Februari 2018.
- Maher, Daniela & Anokhi Parikh. 2013. *The Turn of The Month Effect in India: A Case of Large Institutional Trading Pattern as a Source of Higher Liquidity*. <https://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S1057521913000203>. Diakses pada 16 Maret 2018.

- Margono, S. 2007. *Metodologi Penelitian Pendidikan Komponen MKDK*. PT. Rineka Cipta. Jakarta.
- Marisa, Oktafalia dan Cheppy. 2012. Analisis *Anomaly Holiday Effect* Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2009-2011. Vol.5 No.2. <https://journal.ubm.ac.id/index.php/akuntansi-bisnis/article/view/440/421>. Diakses pada 23 Februari 2018.
- Pandekar, Galih dan Nadia Putri. 2010. *Turn-off-The-Month Effect on Stocks in LQ45 Index and Various Sectors in The Indonesia Stock Exchange using GARCH (p,q)*. <http://journal.ui.ac.id/index.php/icmr/article/view/3667>. Diakses pada 26 Desember 2017.
- Rosol, Jaroslav. 2017. *Seasonal Effects on Stock Markets in Europe*. <https://is.cuni.cz/webapps/zzp/download/130180464>. Diakses pada 20 Maret 2018.
- Saputro, Aditya Probo dan Sukirno. 2014. *Day of The Week Effect dan Month of The Year Effect* Terhadap Return Indeks Pasar. <https://journal.uny.ac.id/index.php/nominal/article/view/2701>. Diakses pada 24 Januari 2018.
- Sari, Fitri Aprilia dan Eka Ardhani Sisdyani. 2013. Analisis *January Effect* di Pasar Modal Indonesia. <https://ojs.unud.ac.id/index.php/Akuntansi/article/view/792>. Diakses pada 26 Desember 2017.
- Seif, Mostafa, et.al. 2017. *Seasonal Anomalies in Advanced Emerging Stock Markets*. <https://www.sciencedirect.com/science/article/abs/pii/S1062976917300832>. Diakses pada 21 Agustus 2017.
- Sharma, Susan Kamila, et.al. 2014. *New Evidence on Turn-of-the-Month Effects*. <https://www.sciencedirect.com/science/article/pii/S1042443113001030>. Diakses pada 16 Maret 2018.
- Tandelilin, Eduardus. 2010. *Portofolio Investasi Teori dan Aplikasi*. Edisi 1. Kanisius. Yogyakarta.
- Wong, Mei Kee, et.al. 2007. *An Empirical Analysis of The Monthly Effect : The Case of The Malaysian Stock Market*. https://www.une.edu.au/_data/assets/pdf_file/0007/67993/econ-2007-4.pdf. No.2007-4. Diakses pada 26 Desember 2017.
- Yahoo. 2017. Harga Saham. <https://finance.yahoo.com/>. Diakses pada 28 September 2017.