# DAFTAR PUSTAKA

Ambarwaty, Arum (2016), Skripsi: Pengujian The Day Of The Week Effect, Week Four Effect, Dan Rogalsky Effect Terhadap Return Saham Jakarta Islamic Indeks Di Bursa Efek Indonesia, Universitas Muhammadiyah Surakarta.

Ardila, N., Maslichah, & Junaidi (2018), *Analisis The Day Of The Week Effect, Week Four Effect, Dan Rogalsky Effect Terhadap Return Saham Lq 45 Di Bursa Efek Indonesia (Bei)*, E-JRA Vol. 07 No. 02 Agustus 2018, Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Islam Malang.

Fama, E. F. (1970), *Efficient Capital Market: A Review on Theory and Empirical Work*, Journal of Finance, Vol. 25, No. 2, pp. 393-417.

Gumanti, Tatang A., dan Elok S. Utami (2002), *Bentuk Pasar Efisien Dan Pengujiannya,* Jurnal Akuntansi & Keuangan Vol. 4, No. 1, Mei 2002: 54 – 68.

Halim, A. (2015), *Analisis Investasi,* Edisi 1, Jakarta: Mitra Wacana Media.

Handayani, Ani. (2014),  Anomali Pasar Pada Return Saham: Monday Effect, January Effect Dan Rogalsky Effect (Studi Pada Perusahaan Yang Terdaftar Di Jakarta Islamic Index Tahun 2012-2013). Skripsi thesis, Universitas Islam Negeri Sunan Kalijaga.

Hanung, Raditya (2018), *Turun 0,73% Sepekan, Harga Batu Bara Terendah Dalam 6 Bulan*, CNBC Indonesia, diakses 2 Februari 2019, <https://www.cnbcindonesia.com/market/20181126145141-17-43713/turun-073-sepekan-harga-batu-bara-terendah-dalam-6-bulan>.

Hanung, Raditya (2018), *Harga Minyak Anjlok Lagi ke Level Terendah Sejak Oktober 2017*, CNBC Indonesia, diakses 2 Februari 2019, https://www.cnbcindonesia.com/market/20181123103004-17-43364/harga-minyak-anjlok-lagi-ke-level-terendah-sejak-oktober-2017.

Maharani, S. N. (2014), *Rekonsiliasi Perseteruan Antara Efficient Market Hypothesis Dan Behavioural Finance Melalui Perspektif Neuroeconomics,* Jurnal Akuntansi Multiparadigma, Agustus Vol. 5, No. 2, pp. 244-261.

Maryani, O. W. (2017), Skripsi: *Pengujian The Day Of The Week Effect, Week Four Effect Dan Monday Effect Terhadap Return Saham Perusahaan Food And Beverage Di Bursa Efek Indonesia Tahun 2014-2015*, E-Jurnal Fakultas Ekonomi UMRAH, diakses 17 Juli 2019, <https://jurnal.umrah.ac.id/?p=8128>.

Muhammad, R., Brady R., Aldilla I. (2016), *Pengaruh Weekday Effect Dan Week-Four Effect Terhadap Return Saham Indeks Kompas100 Di Bursa Efek Indonesia Periode 2007 – 2015*, e-Proceeding of Management : Vol.3, No.1.

Nuraini, F. (2016), *Analisis Anomali Pasar Hari Perdagangan Pada Return Saham: Pengujian Dow Effect Dan Week-Four Effect Di Bei (Studi Pada Indeks Saham Lq45 Tahun 2011 – 2016)*, e-Proceeding of Management : Vol.3, No.3.

Purwati, Analia I. (2015), Tesis: *Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham Pada Bei : Pengujian Week Four Effect Dan Rogalski Effect*, Universitas Negeri Semarang, diakeses 17 Juli 2019, <https://lib.unnes.ac.id/22593/>.

Rahmawati, S. (2016), *Analisis Monday Effect Dan Weekend Effect Pada Return Saham Perusahaan Lq 45 Di Bursa Efek Indonesia*, Jurnal Manajemen Bisnis Indonesia, Vol. 5, No. 6.

Rita, Mario Rio. “*Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham*,”Jurnal Ekonomi dan Bisnis Vol. XV No.2, September 2009.

Roseliani, B., Khairunnisa (2015), *Efek Anomali Pasar Terhadap Return Saham (Perusahaan Lq-45 Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2013)*, e-Proceeding of Management : Vol.2, No.2 Agustus 2015, Universitas Telkom.

Saragih, Houtmand P. (2018*), Saham Tambang Melesat Saat Harga Minyak dan Batu Bara Anjlok*, CNBC Indonesia, diakses 2 Februari 2019, <https://www.cnbcindonesia.com/investment/20181123131336-21-43400/saham-tambang-melesat-saat-harga-minyak-dan-batu-bara-anjlok>.

Saragih, Houtmand P. (2018*), Anomali Pergerakan Saham Tambang dan Agro*, CNBC Indonesia, diakses 2 Februari 2019, <https://www.cnbcindonesia.com/market/20181123134658-17-43406/anomali-pergerakan-saham-tambang-dan-agro>.

Saraswati, Yunisa R., Cicik S., et al (2015), *Pengaruh The Day Of The Week Effect, Week Four Effect dan Rogalsky Effect terhadap Return Saham Lq-45 di Bursa Efek Indonesia*, Jurnal Riset Akuntansi dan Perpajakan (JRAP), Vol. 2, No. 1, p.43 – 54.

Trisnadi, Margareta M., dan Ida Bagus P. Sedana (2016), *Pengujian Anomali Pasar : Day Of The Week Effect Pada Saham Lq-45 Di Bursa Efek Indonesia*, E-Jurnal Manajemen Unud, Vol. 5, No. 6, 2016: 3794-3820.

Wulandari, F., dan Nur Diana (2018), *Analisis Monday Effect Dan Friday Effect Pada Indeks Likuiditas 45 Di Bursa Efek Indonesia*, e-Jurnal Ilmiah Riset Akuntansi, [Vol 7, No 03.](http://riset.unisma.ac.id/index.php/jra/issue/view/135)

Wulandari, Meri. (2013), Skripsi: *Anomali Pasar Bulan Perdagangan Terhadap Return Saham Dan Abnormal Return*, Fakultas Ekonomi Dan Bisnis Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah, diakses 17 Juli 2019, <http://repository.uinjkt.ac.id/dspace/handle/123456789/23958>.

Wulandari, Mega A. (2015), Skripsi: *Analisis Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham (Studi Empiris Pada Perusahaan Lq-45 Dan Non Lq-45 Di Bursa Efek Indonesia)*, STIE Perbanas Surabaya, diakses 17 Juli 2019, <http://eprints.perbanas.ac.id/505/>.

[www.idx.co.id](http://www.idx.co.id)

<https://finance.yahoo.com>