



DAFTAR PUSTAKA

- Anggraini, H. (2018). Pengaruh Volume Perdagangan , Suku Bunga , dan Kurs Terhadap Return Saham Perusahaan Farmasi , Telekomunikasi dan Perbankan di BEI. *Jurnal Bisnis Dan Komunikasi*, 5(2), 132–141.
- Asnawi, S. K., Salim, G., & Malik, W. A. (2020). Does Black Monday appear on The Indonesia Stock Exchange? *Jurnal Organisasi Dan Manajemen*, 16(1), 24–35. <https://doi.org/10.33830/jom.v16i1.780.2020>
- Christiana, A. M., Setiana, E., & Mamdudh, M. (2016). The Empirical Relationship between Stock Return and Trading Volume based on Stock Market Cycles. *Indonesian Capital Market Review*, 8(1), 46–57. <https://doi.org/10.21002/icmr.v8i1.5186>
- Dias, R., Heliodoro, P., Teixeira, N., & Godinho, T. (2020). Testing the Weak Form of Efficient Market Hypothesis: Empirical Evidence from Equity Markets. *International Journal of Accounting, Finance and Risk Management*, 5(1), 40. <https://doi.org/10.11648/j.ijafmr.20200501.14>
- Dunia Investasi, Data Bursa Efek Indonesia, diakses 30 Maret 2021 <http://www.duniainvestasi.com/bei/prices/stock>
- Flostrand, H., & Flogstad, E. (2020), Thesis: *The Day-of-the-Week Effect at Oslo Stock Exchange*, Norwegian School of Economics.
- Gumanti, Tatang Ary dan Utami, Elok Sri (2002). Bentuk Pasar Efisien dan Pengujianya. *Jurnal Akuntansi & Keuangan*, 4(1), 54–68.

© Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang
Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang
1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Harjito, D. A. (2003). Pengujian Efisiensi Pasar Bentuk Lemah di Bursa Saham Kuala

Lumpur. *Jurnal Siasat Bisnis*, 1(8), 33–51. <https://doi.org/10.20885/jsb.vol1.iss8.art3>

Hartono, Jogyanto (2017), *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, Edisi 11, BPFE-YOGYAKARTA.

Indonesia Stock Exchange, situs resmi Bursa Efek Indonesia, diakses 30 April 2021

<http://www.idx.co.id>

Juana Hase, G., & Asandimitra Haryono, N. (2018). Pengujian Efisiensi Pasar Pada Pasar Modal Indonesia Periode Juni 2009 - Juni 2015 (Studi Pada Indeks Harga Saham Gabungan). *Jurnal Ilmu Manajemen (JIM)*, 6(4), 550–558.

Krsikapa-Rasajski, J., & Rankov, S. (2016). Testing weak form efficiency on the capital markets in Serbia. *Megatrend Revija*, 13(1), 265–278.

<https://doi.org/10.5937/megrev1601265k>

Kudryavtsev, A. (2019). The effect of trading volumes on stock returns following large price moves. *Economic Annals*, 64(220), 85–116.

<https://doi.org/10.2298/EKA1920085K>

Malini, H. (2019). *Hipotesis Pasar Efisien dan Anomali Pasar LQ 45 Indeks di Bursa Efek Indonesia*. 3(2), 107–121.

Malkiel, B. G. (2003). The Efficient Market Hypothesis and Its Critics. *Journal of Economic Perspectives*, 17(1), 59–82. <https://doi.org/10.1257/089533003321164958>

Mubarok, F., & Fadhli, M. M. (2020). *Hipotesis dan Peramalan Pasar Efisien dari Industri Sektor di Bursa Efek Indonesia*. 23(2), 160–168.



Nasution, L. Z., Sulisty, S., & Halim, Abdul. (2016). Pengaruh Volume Perdagangan

Saham, Frekuensi Perdagangan Saham, Volatilitas Harga Saham, dan Kapitalisasi

Pasar Terhadap Return Saham Perusahaan Makanan dan Minuman yang Terdaftar di

BURSA EFEK INDONESIA. *Jurnal Riset Mahasiswa Akuntansi*, 4(2). Retrieved

from <https://ejournal.unikama.ac.id/index.php/jrma/article/view/1382>

Patal, R. R., & Panda, A. K. (2018). Day of the Week and Weekend Effects in the Indian

Stock Market. *Theoretical Economics Letters*, 08(11), 2559–2568.

<https://doi.org/10.4236/tel.2018.811164>

Rohmawati, Irma (2016), Skripsi: *Pengaruh Volume Perdagangan, Dividend Payout*

Ratio, dan Inflasi terhadap Volatilitas Harga Saham pada Perusahaan yang

Terdaftar dalam Indeks LQ45 Tahun 2011-2015, Universitas Negeri Yogyakarta.

Rostami, M. R., Alipour, P., Author, C., & Behzadi, A. (2019). *Analyzing the Causal*

Relations between Trading Volume and Stock Returns and between Trading Volume and Return Volatility in Tehran Stock Exchange.

<https://doi.org/10.22034/ijf.2019.101108>

Samsul, Mohamad (2018), *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*, Edisi 2, Jakarta :

Erlangga

Sekaran, Uma dan Bougie, Roger (2017), *Metode Penelitian Untuk Bisnis*, Edisi 6, Buku

1, Penerbit Salemba Empat.

Sekaran, Uma dan Bougie, Roger (2017), *Metode Penelitian Untuk Bisnis*, Edisi 6, Buku

Penerbit Salemba Empat.

Hak Cipta dilindungi Undang-Undang

Hak Cipta dilindungi Undang-Undang

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber.

a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.

b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.

2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Subagja, Pebiano (2020), Skripsi: *Fenomena Monday Effect Pada Overnight Return dan*

Intraday Return Saham yang Tergabung Dalam Indeks LQ45 Periode 2018, IBII

KWIK KIAN GIE (Tidak dipublikasikan).

Suryani, Evi (2019), Skripsi: *Pengaruh Volume Perdagangan Saham Terhadap Return Saham Syariah Pada Perusahaan Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia*, UIN SMH BANTEN.

Trihnadi, M., & Panji Sedana, I. (2016). Pengujian Anomali Pasar : Day of the Week Effect Pada Saham Lq-45 Di Bursa Efek Indonesia. *E-Jurnal Manajemen Universitas Udayana*, 5(6), 253432.

Zaman, S. (2019). Weak form market efficiency test of Bangladesh Stock Exchange: an empirical evidence from Dhaka Stock Exchange and Chittagong Stock Exchange. *Journal of Economics, Business & Accountancy Ventura*, 21(3), 285.

<https://doi.org/10.14414/jebav.v21i3.1615>