

DAFTAR PUSTAKA

- Abraham, A., & Ikenberry, D. L. (1994). The Individual Investor and the Weekend Effect. *The Journal of Financial and Quantitative Analysis*, 29(2), 263–277. <https://doi.org/10.2307/2331225>
- Alteza, M. (2007). Efek Hari Perdagangan Terhadap Return Saham: Suatu Telaah Atas Anomali Pasar Efisien. *Jurnal Ilmu Manajemen*, 3(1), 31–42.
- Alteza, M. (2021). Keuangan Keperilakuan: Telaah Atas Evolusi Teori dan Studi Empiris. *Jurnal Ilmu Manajemen*, 18(1).
- Ambarwati, S. D. A. (2009). Pengujian Week-Four, Monday, Friday dan Earnings Managements Effect Terhadap Return Saham. *Jurnal Keuangan dan Perbankan*, 13(1), 1–14.
- Asri, M. (2013). *Keuangan Keperilakuan* (1st ed.). Yogyakarta: BPFE.
- Brown, S. J., Goetzmann, W. N., & Kumar, A. (1998). The Dow Theory: William Peter Hamilton's Track Record Reconsidered. *The Journal of Finance*, 53(4), 1311–1333. <https://www.jstor.org/stable/117403>
- Budi, U. (2011). *Hukum Bisnis Pasar Modal*. Yogyakarta: Andi.
- Budileksmana, A., & Hambayanti, S. (2006). Fenomena the Monday Effect di Bursa Efek Jakarta. 7(2).
- Bursa Efek Indonesia. (2023). Profil Perusahaan Tercatat Indeks Saham LQ45. <https://www.idx.co.id/id/data-pasar/data-saham/indeks-saham> diakses pada 1 Februari 2023.
- Fama, E. F. (1970). Efficient Capital Markets: A Review of Theory and Empirical Work. *The Journal of Finance*, 25(2), 383. <https://doi.org/10.2307/2325486>
- Febriyanto, F. (2018). Keputusan Diversifikasi Portofolio Investasi di Era MEA. *Fidusia: Jurnal Keuangan dan Perbankan*, 1(2). <https://doi.org/10.24127/jf.v1i2.306>
- Fitriani, E., & Hartini, T. (2014). Pengaruh January Effect Terhadap Abnormal Return Pada Saham Sektor Otomotif Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI). *Jurnal STIE MDP*.

- Ghozali, I. (2021). *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS 26* (10th ed.). Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Hartono, J. (2003). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi* (5th ed.). Yogyakarta: BPFE.
- Hartono, J. (2005). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi* (7th ed.). Yogyakarta: BPFE.
- Hartono, J. (2013). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi* (8th ed.). Yogyakarta: BPFE.
- Hartono, J. (2017). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi* (11th ed.). Yogyakarta: BPFE.
- Hendrawaty, E., & Huzaimah, R. A. F. (2019). Testing of January Effect, the Day of the Week Effect, and Size Effect: A Study of LQ45 Stocks in Indonesia Stock Exchange. *Jurnal Dinamika Manajemen*, 10(2), 173–184. <https://doi.org/10.15294/jdm.v10i2.20620>
- Herlianto, D. (2013). *Manajemen Investasi Plus Jurus Mendeteksi Investasi Bodong*. Yogyakarta: Gosyen Publishing.
- Hinawati, T. (2016). Efek Hari Libur Idul Fitri Terhadap Abnormal Return Saham Di Bursa Efek Indonesia. *Cakrawala: Jurnal Studi Islam*, 11(1), 34–50. <https://doi.org/10.31603/cakrawala.v11i1.99>
- Ihsan, D. M. (2023). Ini Penyebab January Effect Terancam Tak Terjadi di 2023. <https://www.trenasia.com/ini-penyebab-january-effect-terancam-tak-terjadi-di-2023> diakses pada 1 Februari 2023.
- Investing.com. (2023). Data Historis Harga Saham. <https://id.investing.com/indices/jakarta-lq45-historical-data> diakses pada 1 Februari 2023.
- Iswadi, I., & Hafni, N. (2018). Pengaruh Day of The Week Effect Terhadap Return Saham Pada Perusahaan yang Tergabung dalam Jakarta Islamic Index (JII). *Jurnal Akuntansi dan Keuangan*, 6(2), 95. <https://doi.org/10.29103/jak.v6i2.1828>
- Jahfer, A. (2015). Effects of Working Capital Management on Firm Profitability: Empirical Evidence from Sri Lanka. *International Journal of Managerial*

- and *Financial Accounting*, 7(1), 26–37.
<https://doi.org/10.1504/IJMFA.2015.067498>
- Jones, P. C. (2010). *Investment: Analysis and Management*. New York: John Wiley & Sons Inc.
- Kurniawan, O. T. S., & Purbawangsa, I. A. (2018). Pengujian Anomali Pasar Size Effect dan The Day of Week Effect di Bursa Efek Indonesia. *E-Jurnal Manajemen Universitas Udayana*, 7(9).
- Kustodian Sentral Efek Indonesia. (2022). Investor Pasar Modal Tembus 10 Juta. Jakarta: Berita Pers KSEI.
https://www.ksei.co.id/files/uploads/press_releases/press_file/id-id/212_berita_pers_investor_pasar_modal_tembus_10_juta_20221202065619.pdf diakses pada 21 November 2022.
- Laksamana, K. A. R. I., & Dewi, N. L. G. S. A. (2018). Studi Komparatif The Day of The Week Effect dalam Perolehan Return Saham di Bursa Efek Indonesia pada Perusahaan LQ45 Periode Februari 2017—Januari 2018. *Jurnal Satyagraha*, 1(2).
- Lo, A. W., & Wang, J. (2010). Stock Market Trading Volume. In *Handbook of Financial Econometrics: Applications* (pp. 241–342). Elsevier.
<https://doi.org/10.1016/B978-0-444-53548-1.50007-6>
- Pakpahan, K. (2003). Strategi Investasi di Pasar Modal. *The Winners*, 4(2), 138.
<https://doi.org/10.21512/tw.v4i2.3838>
- Pratiwi, A. R. (2017). Analisis Pengaruh Hari Perdagangan terhadap Return Saham Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal UII*.
- Reilly, F. K., & Brown, K. C. (2000). *Investment Analysis and Portfolio Management* (6th ed.). Fort Worth: The Dryden Press.
- Rosita Dewi Indra Pratiwi, K., & Wirakusuma, I. G. M. (2018). Reaksi Pasar Modal Indonesia Atas Pengumuman Kenaikan Tingkat Suku Bunga Acuan oleh Fed di AS. *E-Jurnal Akuntansi*, 1966.
<https://doi.org/10.24843/EJA.2018.v25.i03.p13>
- Shefrin, H. (2000). *Beyond Greed and Fear: Understanding Behavioral Finance and Psychology of Investing*. Harvard Business School Press.

- Sias, W. R., & Stark, L. T. (2005). The Day of The Week Anomaly: The Role of Institutional Investor. *Financial Analyst Journal*, 58–67.
- Statman, M. (2018). Behavioral Efficient Markets. *The Journal of Portfolio Management*, 44(3), 76–87.
- Sugiyama, A. G. (2013). *Manajemen Aset Pariwisata*. Bandung: Guardaya Intimata.
- Sularso, D. H. (2013). Analisis Monday dan Weekend Effect pada Saham Perusahaan LQ 45 di Bursa Efek Indonesia. *Sustainable Competitive Advantage (SCA)*, 1(1), 1–15.
- Sumiyana, S. (2008). Day Of The Week dan Monday Effect: Fenomena yang Terbuktikan Tidak Konsisten Di Pasar Modal Indonesia. *Jurnal Manajemen Teori dan Terapan| Journal of Theory and Applied Management*, 1(1). <https://doi.org/10.20473/jmtt.v1i1.2359>
- Sunariyah. (2004). *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal (5th ed.)*. Bandung: Alfabeta.
- Suryandari, N. N. A., & Wirawan, I. M. C. (2018). The Day of The Week Effect dan The Month of The Year Effect dalam Perolehan Return Saham. *Jurnal Ilmiah Manajemen & Akuntansi STIE Triatmamulya*, 24(1).
- Tandelilin, E. (2001). *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Yogyakarta: BPF.
- Tandelilin, E. (2010). *Portofolio dan Investasi: Teori dan Aplikasi (1st ed.)*. Yogyakarta: Kanisius.
- Tandelilin, E. (2017). *Pasar Modal: Manajemen Portofolio dan Investasi*. Yogyakarta: Kanisius.
- Trisnadi, M. M., & Sedana, I. B. P. (2016). Pengujian Anomali Pasar: Day of The Week Effect pada Saham LQ-45 di Bursa Efek Indonesia. 5(6).
- Widayanti, C. I. (2018). Pengaruh Monday Effect, Weekend Effect dan Rogalski Effect Terhadap Return Saham. 7.
- Wiratni, I. G. A. S., Surasni, N. K., & Suryani, E. (2021). Monday Effect and Weekend Effect Testing on IDX-30 Index on Indonesia Stock Exchange Period Before and During Covid-19 Pandemic. *Journal of Xi'an Shiyou University*, 17(7), 116–123.

Yolanda, F. S., Ernawati, M. T., & Rahayu, C. W. E. (2022). Market Anomaly Testing: Phenomena of Day of the Week Effect and Month of the Year Effect on IDX80 in Indonesia Stock Exchange. *Journal of Management and Business Environment (JMBE)*, 4(1), 20–42.
<https://doi.org/10.24167/jmbe.v4i1.4664>

Zubir, Z. (2011). *Manajemen Portofolio: Penerapannya dalam Investasi Saham*. Jakarta: Salemba Empat.