

DAFTAR PUSTAKA

- Ang, Robert. 1997. *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia (The Intelligent Guide to Indonesian Capital Market)*. Jakarta: Mediasoft Indonesia.
- Arieyani, Pratiwi. 2012. Efek Anomali Pasar terhadap *Return Saham Perusahaan LQ 45* yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Akuntansi dan Keuangan*. Sekolah Tinggi Ilmu Ekonomi PERBANAS.
- Arum, Ambarwaty. 2016. Pengujian *The Day of The Week Effect, Week Four Effect, dan Rogalsky Effect* terhadap *Return Saham Jakarta Islamic Indeks* di Bursa Efek Indonesia. *Skripsi*. Universitas Muhamadiyah Surakarta.
- Brigham, E. F dan Houston, 2006. *Dasar-dasar Manajemen Keuangan*. Edisi Sepuluh. Salemba Empat: Jakarta.
- Cahyaningdyah Dwi, dan Faidah. 2017. Analisis Pengaruh Hari Perdagangan terhadap *Return Saham* di BEI. *Jurnal Management dan Bisnis*, Vol. 1. No.1 hal. 1-10.
- Darmadji, Tjiptono dan Hendi M. Fakhrudin, 2001. *Pasar Modal di Indonesia: Pendekatan Tanya Jawab*. Salemba Empat: Jakarta.
- Gumanti, Tatang Ary. (2011). *Manajemen Investasi: Konsep, Teori, dan Aplikasi*. Jakarta: Mitra Wacana Media.
- Hashemijoo, Mohammad, Aref Mahdavi Ardekani dan Nejat Younesi. 2012. *The Impact of Dividend Policy on Share Price Volatility in the Malaysian Stock Market*. *Journal of Business Studies Quarterly*, Vol. 4. No. 1, hal. 111-129.
- Hugida, L. 2011. Analisis Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Volatilitas Harga Saham. *Skripsi*. Fakultas Ekonomi Universitas Diponegoro.
- Husnan, S. 2005. *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Edisi Keempat. Cetakan Pertama. Yogyakarta: Unit Penerbit dan Percetakan AMP YKPN.
- Jain, Ravi Kant. 2001. *Putting Volatility to Work*. Active Trader.
- Jogiyanto, 2013. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Ketujuh. Cetakan Ketiga. Yogyakarta: PT.BPFE Yogyakarta.
- Kiyamaz, H. dan Berument, Hakan. 2001. The Day of the Week Effect on Stock Market Volatility. *Journal of Economics and Finance*, 25, 181-193.
- Margareta, M.T., dan Ida, B. 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, hal. 3794-3820.

- Mellysa dan Syahyunan. 2012. Pengaruh Hari Perdagangan terhadap *Return* Saham LQ-45 di Bursa Efek Indonesia.
- Nachrowi, D Nachrowi. 2006. *Ekonometrika, untuk Analisis Ekonomi dan Keuangan*. Cetakan Pertama. Jakarta: Lembaga Penerbit FE UI.
- Prasetyo, H. 2006. Analisis Pengaruh Hari Perdagangan terhadap *Return, Abnormal Return*, dan Volatilitas *Return* Saham (Studi Pada LQ 45 Periode Januari – Desember 2005). *Tesis*. Universitas Diponegoro.
- Putu, S.H., dan Wayan, S. 2015. Pengaruh Hari Perdagangan pada Abnormal Return dan Volatilitas Return Saham Indeks LQ45. *E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana*, Vol. 10. No. 3.
- Rosadi, D. 2012. *Ekonometrika dan Analisis Runtun Waktu Terapan dengan Eviews*. Yogyakarta : Andi Offset.
- Samsul, M. 2006. *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Erlangga.
- Saputro, A.P. 2014. *Day of The Week Effect dan Month of The Year Effect* terhadap Return Indeks Pasar. *Jurnal Nominal*, Vol. 3. No. 2.
- Sharpe, William F., Gordon, J. Alexander dan V. Baiiey. 1995. *Investmen*, Prentice hall, New York.
- Sugiyono. 2014. *Statistika untuk Penelitian*. Bandung: Alfabeta.
- Suliyanto. 2006. *Ekonometrika Terapan: Teori dan Aplikasi dengan SPSS*. Yogyakarta: ANDI.
- Sumiyana. 2008. Pengumuman Laba Terhadap Reaksi Pasar Modal: Studi Empiris Bursa Efek Indonesia 2004-2006. *Jurnal Manajemen Teori Dan Terapan*. Tahun 1, no.3.
- Supriyanto. 2009. *Metodologi Riset Bisnis*. Jakarta: PT. Index.
- Tandelilin, S., dan Agifari. 1999. Pengaruh Hari Perdagangan terhadap Return Saham di BEJ. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia*, Vol. 14. No. 4, hal. 111-123.
- Tandelilin, Eduardus. 2001. *Analisis Investasi dan Manajemen Risiko*. Edisi Pertama. Yogyakarta: BPF.
- _____. 2010. *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi*. Edisi Pertama. Yogyakarta: Kanisius.
- Thadete, Marsheyline G.S. 2013. Fenomena “*Monday Effect*” di Bursa Efek Indonesia (periode 2007-2012). *Jurnal FINESTA*, Vol. 1. No. 2, hal.96-101.

Tim Studi Volatilitas Pasar Modal Indonesia dan Perekonomian Dunia. 2011. Volatilitas Pasar Modal Indonesia dan Perekonomian Dunia. Kementerian Keuangan Republik Indonesia Badan Pengawas Pasar Modal dan Lembaga Keuangan.

Winarno, Wing Wahyu. 2015. Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan Eviews. Edisi Keempat. Yogyakarta: STIM YKPN.

www.idx.co.id

www.finance.yahoo.com

www.ivolatility.com