

DAFTAR PUSTAKA

Buku

- Charles, P. Jones, *Investment: Analysis and Management*, Ninth edition, New York: John Wiley & Sons Inc., 1995.
- Darmadji, Tjipto dan Hendy M. Fakhruddin. 2001. *Pasar Modal di Indonesia Pendekatan Tanya Jawab*, Jakarta: Salemba Empat.
- Ghozali, Imam. 2011. *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS 19*, Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Huda, Nurul dan Mustafa Edwin Nasution. 2008. *Investasi Pada Pasar Modal Syariah*, edisi revisi. Jakarta: Kencana Predana Media Group.
- Husnan, Suad. 2005. *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. UPP AMP YKPN, Yogyakarta.
- Kuswanto, Dedy. 2012. *Statistik Untuk Pemula dan Orang Awam*, Jakarta: Laskar Akasara.
- Nadjib, Mochammad, dkk, 2008. *Investasi Syari'ah Implementasi Konsep pada Kenyataan Empirik*. Yogyakarta: Kreasi Wacana.
- Jogiyanto. 2009. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. BPFE, Yogyakarta.
- Supangat, Andi. 2008. *Statika : dalam kajian deskriptif, inferensi dan non parametrik*, Jakarta: Prenada Media.
- Tandelilin, Eduardus. 2001. *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*, Edisi Pertama. Yogyakarta: BPFE.
- Widoatmodjo, Sawidji. 2009. *Pasar Modal Indonesia Pengantar & Studi Kasus*, Bogor: Ghalia Indonesia.
- Sam, M. Ichwan (et.al). 2014. *Himpunan Fatwa Keuangan Syariah Dewan Syariah Nasional MUI*. Jakarta : Erlangga.

Jurnal dan Artikel

- A'immah, Syarifatul., Suhadak dan Raden Rustam Hidayat. 2015. "Raksi Abnormal Return dan Trading Volume Activity terhadap Ramadhan Effect (Study pada Perusahaan Food and Beverages yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2013 – 2014)". *Jurnal Admisnistrasi Bisnis (JAB)*. Vol. 27.1.

- Agus Wahyu Pratomo. 2007. "January Effect dan Size Effect pada Bursa Eek Jakarta (BEJ) Periode 1998 – 2005". *Thesis* Magister Manajemen pada Fakultas Ekonomi Universitas Diponegoro.
- Andreas dan Ria Daswan. 2011. "January Effect Pada Perusahaan LQ-45 Bursa Efek Indonesia 2003-2008". *Jurnal Ekonomi*. Vol.19, No.3.
- Anwar, Syamsul. 2015. "Efek Ramadhan terhadap *Abnormal Return* dan Volume Perdagangan Saham Pada Perusahaan yang Masuk dalam Jakarta Islamic Index 2004-2014". *Skripsi*. Yogyakarta :UIN Sunan Kalijaga.
- Aprilia, Fitri Sari dan Eka Ardhani Sisdyani. 2014. " Analisis *January Effect* di Pasar Modal Indonesia" E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana. Vol. 6.2, hal. 237-248.
- Ary Gumanti, Tatang dan Elok Sri Utami. 2002. "Bentuk Pasar Efisien dan Pengujiannya". *Jurnal Akuntansi dan Keuangan*, 4(1),hal.59.
- As'adah, Luluk. 2009. "Pengaruh January Effect terhadap abnormal return dan volume perdagangan di JII periode Desember 2003 – Januari 2008" *Skripsi*. Yogyakarta: UIN Sunan Kalijaga.
- Chatterjee, Amitava, 2000, "Market Anomalies Revisited", *Journal of Applied Bussines Research*, vol:13 No.4
- Fitriyani, Indah dan Maria M. Ratna Sari. 2013. "Analisis *January Effect* pada Kelompok Saham Indeks LQ-45 di BEI Periode 2009-2011." E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana. Vol.4.2, hal.421-438.
- Kamaludin. 2010. "Bagaimana Keberadaan *January Effect* di Bursa Asia?". *Trikonomika*. Vol.9, No.1, Juni 2010, hal.1-10.
- Mardhiyah, Siti. 2014."Pengaruh Bulan Perdagangan Terhadap Return Saham: Pengujian *January Effect* di Indeks Harga Saham LQ45 Periode 2004-2014" *Skripsi*.Malang:Universitas Brawijaya.
- Mark Haug and Mark Hirschey. 2006. " The *January Effect*" *Financial Analysis Journal*, CFA Institute. Vol.62 No.5.
- Nursanti, Devita. 2014. "Analisis Perbedaan *January Effect* dan *Rogalsky Effect* pada Perusahaan yang tergabung dalam *Jakarta Islamic Index* di Bursa Efek Indonesia Tahun 2011-2013" *Skripsi*. Surakarta:Universitas Slamet Riyadi.

- Rahayuningsih, Wiwit. "Pengaruh January Effect dan Size Effect terhadap return saham di Jakarta Islamic Index (JII) tahun 2010-2013". *Skripsi*. Malang:UIN Maliki.
- Rahma, Aulia Yani, Made Sudarma dan Yeney Widya Prihatiningtias. "January Effect dan Size Effect pada Perusahaan yang Terdaftar di BEI. *Thesis*. Universitas Brawijaya.
- Rathinasamy, R.S dan Krishna G. Mantripragada. 1996. "The January Size Effect Revisited: Is it a Case of Risk Mismeasurement?" *Journal of Financial and Strategy Decisions*. Vol:9 No.3
- Rio, Rita Maria. 2009. "Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham". *Jurnal Ekonomi dan Bisnis*.
- Rozeff, Michael S. dan William R. Kinney, Jr., "Capital Market Seasonality: The Case of Stock Return," *Journal of Financial Economic*, 1976,3, 379-402.
- Thaler, Richard H. 1987. Anomalies: The January Effect. *Journal of Economic Perspectives*, 1(1), pp:197-201.
- Gumanti, Tatang Ary dan Farid Ma'arif. 2004. "Efek Pekan terhadap return saham (Study Kasus Perusahaan LQ45), *Usahawan*, No. 11, Tahun XXXIII (November, 2004).
- Werastuti, Desak Nyoman Sri. 2012. "Anomali pasar pada return saham : the day of week effect, week four effect, rogalsky effect dan january effect". *Jurnal Ilmiah Humanika JINAH*. Vol.2, No.1.

Sumber Lain

- Fatwa Dewan Syariah Nasional No. 8/DSN-MUI/III/2011 Tentang Penerapan Prinsip Syariah Dalam Mekanisme Perdagangan Efek Bersifat Ekuitas di Pasar Reguler Bursa Efek
- Saham Syariah (ISSI) di BEI, www.sahamok.com. Diakses pada 14 Oktober 2016
- Peraturan Bapepam-LK Nomor IX.A.13 tentang Penerbitan Efek Syariah Earling.gunadarma.ac.id. Statistika Non-Parametrik: Uji Beda. Hal 77 www.idx.co.id diakses tanggal 08 Oktober 2016
- www.bisniskeuangan.kompas.com diakses tanggal 02 Desember 2016
- www.kompas.com diakses tanggal 05-09 Desember 2016