



DAFTAR PUSTAKA

- Bouman, Sven and Jacobsen, Ben. (2001). *The Halloween Indicator, 'Sell in May and Go Away': Another Puzzle*. Didownload dari www.ssrn.com.
- Darmawan, Komang (2008). *Menunggu Kiprah Emiten Baru*. Majalah Investor X/176. Februari 2008
- Doeswijk, R. Q. (2005). *The Optimism Cycle: Sell in May*. Didownload dari www.ssrn.com.
- Fama, E.F. (1970). *Efficient Capital Markets: A Review of Theory and Empirical Works*: Journal of Finance.
- Foster, George (1986). *Financial Statement Analysis*. Second Edition. Prentice-Hall International.
- Goretti, A. I. M. (2004). *Identifikasi Idul Fitri Holiday Effect di Bursa Efek Jakarta Tahun 1999-2003*. Tesis tidak dipublikasikan. Magister Manajemen Universitas Gadjah Mada. Yogyakarta.
- Gumanti, A. T. dan Ma'ruf F. (2004). *Efek Akhir Pekan terhadap Return Saham*. Jurnal Usahawan No. 11 Th XXXIII
- Husnan, Suad (1993). *Efisiensi Pasar Modal Indonesia*. Jurnal Ekonomi Indonesia.
- _____ (2001). *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Edisi Ketiga. UUP AMP YKPN. Yogyakarta.
- Irawan Djati Prianto (2002). *Analisis Day-Of-The-Week Effect pada Return Saham Sektoral di Bursa Efek Jakarta*. Tesis tidak dipublikasikan. Magister Manajemen Universitas Gadjah Mada. Yogyakarta.



Jones, C. P. A. (2007). *Investment Analysis and Management*. Tenth Edition. John Wiley and Sons, Inc. North Carolina.

Maberly, E. D. and Pierce, R. M. (2004). *Stock Market Efficiency Withstands another Challenge: Solving the "Sell in May / Buy after Halloween" Puzzle*. Didownload dari www.ssrn.com.

Nachrowi, Djalal dan Usman, Hardius (2006). *Pendekatan Populer dan Praktis Ekonometrika untuk Analisis Ekonomi dan Keuangan*. Lembaga Penerbit Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia. Jakarta.

Pindyck, Robert S. and Daniel L. Rubinfeld (1998). *Econometric Models and Economic Forecast*, 4th ed. New York: McGraw-Hill Companies, Inc.

Ryan, Thomas P. (1997). *Modern Regression Methods*. New York: John Wiley & Sons, Inc.

Utomo, Bambang T. P. (2002). *Fenomena Efek Januari di Bursa Efek Jakarta (1996-2000)*. Tesis tidak dipublikasikan. Magister Manajemen Universitas Gadjah Mada. Yogyakarta.

Wibowo, Buddi dan Wahyudi, Junius. (2005). *Pengujian Anomali Pergantian Bulan, Anomali Bulanan dan anomaly Hari Libur pada IHSG BEJ 1996-2004*. Jurnal Usahawan No.11 Th XXXIV

_____ (2004). *Pengujian Tuntas atas Anomali Pola Harian dan Efek Akhir Pekan pada Return dan Volatility IHSG dan LQ 45 (1994-2004)*. Jurnal Usahawan No.12 Th XXXIII