

DAFTAR PUSTAKA

- _____, Undang-Undang Republik Indonesia Nomor 8 Tahun 1995 Tentang Pasar Modal.
- _____, Undang-Undang Republik Indonesia Nomor 2 Tahun 2017 Tentang Jasa Konstruksi.
- Ady, S. U., dan Mulyaningtyas, A. (2017). Eksplorasi Tingkat Efisiensi Pasar Modal Indonesia Studi Kasus di Bursa Efek Indonesia. *Ekspektra: Jurnal Bisnis dan Manajemen*, Vol. 1, No. 2, Hlm. 103-123, e-ISSN: 2549-3604, p-ISSN: 2549-6972.
- Bollerslev, T. (1986). *Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity. Journal of Econometrics*. Vol. 31, 1986.
- Bursa Efek Indonesia (2019). Data Perusahaan Jasa Sub Sektor Konstruksi dan Bangunan.
<http://www.idx.co.id>
- Chowdhury, H. S. (2017). *Stock Return Autocorrelation, Day of The Week and Volatility: An Empirical Investigation on The Saudi Arabian Stock Market. Review of Accounting and Finance*. Vol. 16, Emerald Group Publishing Limited.
- Dwipayana, I. G., dan Wiksuana, I. G. (2017). Pengujian Efisiensi Pasar di Bursa Efek Indonesia. *E-Jurnal Manajemen Unud*. Vol. 6, No. 4, ISSN : 2302-8912.
- Eliyawati, W. Y., Hidayat, R. R., dan Azizah, D. F. (2014). Penerapan Model Garch (*Generalized Autoregressive Conditional Heteroscedasticity*) Untuk Menguji Pasar Modal Efisien Di Indonesia. *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB)*. Vol. 7, No. 2, Januari 2014.
- Ellenmay Institute. (2019). Sektor konstruksi bangunan.
<http://www.ellen-may.com>
- Fahmi, I. (2015). *Manajemen Investasi: Teori dan Soal Jawab*. Jakarta: Salemba Empat.
- Fama, E. F. (1970). *Efficient Capital Market: A review Theory and Empirical Work*. Vol. 25, No. 2, Published by: Blackwell Publishing for the American Finance Association, December 1969 (1970), Pp. 383-417.
- Fama, E. F. (1991). *Efficient Capital Market: II*. *The Journal of Finance*. Vol. 46, No. 5, December 1991.

- Ghozali, I. (2013). Analisis Multivariate Program IBM SPSS 21. Semarang: Universitas Diponegoro.
- Gumanti, T. A. (2011). Manajemen Investasi – Konsep, Teori dan Aplikasi. Jakarta: Mitra Wacana Media.
- Hartono, J. (2015). Teori Portofolio dan Analisis Investasi. Edisi 10, Yogyakarta: BPFE.
- Husnan, S. (2015). Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas. Edisi 5, Yogyakarta: UPP AMP YKPN.
- Jaisinghani, D. (2016). *An Empirical Test of Calender Anomalies for The Indian Securities Markets. South Asian Journal of Global Business Research*. Vol. 5. Emerald Group Publishing Limited.
- Juanda, B., dan Junaidi. (2012). Ekonometrika Deret Waktu: Teori dan Aplikasi. Bogor: IPB PRESS.
- Kasdjani, A. M., Nazarudin., dan Yusuf, J. (2017). Anomali Pasar Terhadap Return Saham Perusahaan LQ45. *Jurnal Kajian Akuntansi*, Vol. 1, 2017, hlm. 35-48, e2579-9991, p2579-9975.
- Khoidah, I., dan Wijayanto, A. (2017). Fenomena Anomali Pasar Di Bursa Efek Indonesia Dan Bursa Efek Singapura. *Management Analysis Journal*, 2017.
- Kontan.co.id. (2019). Berita Saham Sektor Konstruksi dan Bangunan. <http://m.kontan.co.id/news>
- Kristianto, W., dan Sukamluja, J. S. (2014). *The Day Of The Week Effect Pada Pasar Modal Asean (Indonesia, Malaysia, Dan Singapura) Periode 2003-2013*. Serviens In Lumine Veritatis.
- Kumar, S., dan Pathak, R. (2016). *Do The Calender Anomalies Still Exist ? Evidence From Indian Currency Market. Managerial Finance*. Vol. 42. Emerald Group Publishing Limited.
- Kumar, S. (2015). *Turn of Month Effect in The Indian Currency Market. International Journal of Managerial Finance*. Vol. 11. Emerald Group Publishing Limited.
- Kurniawan, R., dan Yuniarto, B. (2016). Analisis Regresi: Teori Dasar dan Penerapannya dengan R. Edisi 1, Jakarta: Kencana.

- Laksmiana, K. A., dan Dewi, N. L. (2019). Studi Komperatif *The Day Of The Week Effect* Dan *The Month Of The Year Effect* Dalam Perolehan *Return Saham* Di Bursa Efek Indonesia Pada Perusahaan LQ45 Periode Februari 2017 - Januari 2018. *Jurnal Styagraha*. Vol. 1, No. 2, Agustus 2018 – Januari 2019. ISSN : 2620-6358.
- Makridakis, S., dan Wheelwright, S. C. (1999). *Metode dan Aplikasi Peramalan*. Edisi ke-2. Terjemahan Hari Suminto. Jakarta: Binarupa Aksara.
- Malini, H. (2014). *Month of The Year and Pre-Holiday Effects In Indonesia and Malaysia Shari'ah Compliance*. *Indonesia Journal Capital Market Review*. Vol. 6.
- Mei-Chu Ke, dkk. (2014). *Testing the monthly anomaly with stochastic dominance*. *Managerial Finance*. Vol. 40, Emerald Group Publishing Limited.
- Mensah, L. (2016). *Time Your Investment on The Ghana Stock Exchange (GSE)*. *African Journal of Economics and Management Studies*. Vol. 7, Emerald Group Publishing Limited.
- Muhammad, R., Rikumahu, B., dan Iradianty, A. (2016). Pengaruh *Weekday Effect* Dan *Week-Four Effect* Terhadap *Return Saham Indeks Kompas100* Di Bursa Efek Indonesia Periode 2007 – 2015, ISSN : 2355-9357, e-*Proceeding of Management* : Vol. 3, No. 1, April 2016, Page 124.
- Nastiti, K. L., dan Suharsono, A. (2012). Analisis Volatilitas Saham Perusahaan *Go Public* dengan Metode ARCH-GARCH. *Jurnal Sains Dan Seni ITS* Vol. 1, No. 1, (Sept. 2012) ISSN: 2301-928X.
- Nasution, Y. S. (2015). Hipotesis Pasar Efisien/*Efficient Market Hypotesis*. *Jurnal Perspektif Ekonomi Darussalam*. Vol. 1, No. 1, Maret 2015, ISSN. 2502-6976.
- Nuraini, F. (2016). Analisis Anomali Pasar Hari Perdagangan Pada *Return Saham*: Pengujian *Dow Effect* Dan *Week-Four Effect* Di Bei (Studi Pada Indeks Saham Lq45 Tahun 2011 – 2016). ISSN : 2355-9357, e-*Proceeding of Management* : Vol. 3, No. 3, Desember 2016, Page 3149.
- Nuryanto., dan Pambuko, Z. B. (2018). *Eviews untuk Analisis Ekonometrika Dasar: Aplikasi dan Interpretasi*. Magelang: UNIMMA PRESS.
- Robiyanto, (2015). *Month Of The Year Effect* Pada Beberapa Pasar Modal Di Asia Tenggara Dan Pasar Komoditas.
- Robiyanto, R. (2017). *Month Of The Year Effect* Pada Pasar Obligasi Di Indonesia. *Jurnal Ekonomi Bisnis*. Vol. 20, No. 2, Oktober 2017, ISSN 1979 – 6471.

- Rosellani, B., dan Khairunnisa. (2015). Efek Anomali Pasar Terhadap *Return Saham* (Perusahaan LQ45 yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2013). ISSN : 2355-9357, e-Proceeding of Management : Vol. 2, No. 2 Agustus 2015, Page 1649.
- Saputro, A. P., dan Sukirno (2014). *Day Of The Week Effect Dan Month Of The Year Effect Terhadap Return Indeks Pasar*. Jurnal Nominal, Vol. 3, No. 2.
- Sawitri, N. N., dan Astuty, P. (2018). *Market Anomalies and Effect on Returns*. *European Research Studies Journal*. Vol. 21, Issue 2, 2018, pp. 630-649.
- Sugiyono. (2014). *Metode Penelitian Manajemen*. Bandung: Alfabeta.
- Sularso., Suyono, E., dan Rahmawanto. (2013). *Analisis Monday Dan Weekend Effect Pada Saham Perusahaan Lq 45 Di Bursa Efek Indonesia*.
- Supranto. (2013). *Petunjuk Praktis Penelitian Ilmiah Untuk Menyusun Skripsi, Tesis, dan Disertasi*. Jakarta: Mitra Wacana Media.
- Suryandari, N. N., dan Wirawan (2018). *The Day Of The Week Effect Dan The Month Of The Year Effect Dalam Perolehan Return Saham*. Jurnal Ilmiah Manajemen & Akuntansi, p-ISSN 2301-8291. e-ISSN 2622-1489. Vol. 24, No. 1, Juni 2018, hal 47 – 65.
- Trisnadi, M. M., dan Sedana, I. 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, 2016, ISSN : 2302-8912.
- Vasileiou, E. (2015). *Does The Financial Crisis Influence The Month and The Trading Month Effects?: Evidence from The Athens Stock Exchange*. *Studies in Economics and Finance*. Vol. 32, Emerald Group Publishing Limited.
- Yahoo Finance. (2019). *Data Historis Harga Saham Perusahaan*. <http://finance.yahoo.com/quote>
- Yakob, N. A., dan Leong, C. K., (2016). *Calendar Effects in 5 ASEAN Stock Markets*. *International Journal of Business and Management Invention*. e-ISSN: 2319 – 8028, p-ISSN: 2319 – 801x, Vol. 5, Issue. 12, Desember 2016, PP 14-18.