

3. Kekurangan penelitian ini adalah pada periode penelitian yang cukup pendek yaitu hanya satu tahun memungkinkan hasil penelitian tidak sesuai dengan fenomena yang ada.

F. Saran

1. Bagi penelitian selanjutnya diharapkan mengadakan penelitian yang lebih mendalam dengan memperpanjang periode pengamatan, sehingga hasil penelitian dapat digeneralisasikan.
2. Bagi penelitian selanjutnya diharapkan mengadakan penelitian lebih lanjut dengan menggunakan sampel dari beberapa sektor yang berbeda, sehingga hasil penelitian dapat digeneralisasikan.

DAFTAR PUSTAKA

- Abraham, A and Ikenberry, 1994, *The Individual Investor And Weekend Effect*. Journal of financial of Quantitative analysis 29, 263-277
- Algifari. 1997. *Statistik Induktif untuk Ekonomi dan Bisnis*. Yogyakarta: UPP AMP UGM.
- Algifari. 2000. *Analisis Regresi Teori, Kasus, dan Solusi*. edisi 2. Yogyakarta: BPFE
- Bambang, Riyanto. 1996. *Dasar-dasar Pembelanjaan Perusahaan*. Yogyakarta: BPFE UGM.
- Cahyaningdyah, Dwi, 2005, *Analisis Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham: pengujian Week For Effect Dan Rogalsky Effect Di Bursa Efek Jakarta*. Jurnal ekonomi dan bisnis indonesia Vo.12 No.2
- Djarwanto. 1998. *Statistik Induktif*. Edisi 4. Yogyakarta : YKPN.
- Djarwanto. 1998. *Statistik Induktif*. Edisi 4. Yogyakarta : YKPN.
- Gujarati, Damodar. 2001. *Ekonometrika Dasar*. Jakarta: Erlangga.
- Hair, J.F., Anderson, R.E., Thatham, R.L., Black., W.C. 1995. *Multivariate Data Analysys*. New Jersey: Prentice Hall.

- Husnan, Suud. 2003. *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: UPP AMP YKPN.
- Jogianto, Hartono. 1998, *Dasar-Dasar Teori Portofolio Dan Analisis Investasi*, BPFE, Yogyakarta.
- Jogiyanto, Hartono. 2000. *Teori Portifolio dan Analisis Investasi*. edisi 2. Yogyakarta:BPFE UGM.
- Jogiyanto, Hartono. 2004. *Metodologi Penelitian Bisnis*. Yogyakarta: BPFE UGM
- Kato, K, 1990, *Weekly Pattern In Japanesse Common Stock Return*, Manajement Science, 36,1031-1043
- Maberly, E, 1995, *Eureka ! Diskovery Of The Weekend Effect Belogs To The Ancient Secribes*, financial analysis journal, sep-oct, 10-11.
- Manurug, Adler Haymas. 2001. *Mengamati Efek Akhir Pekan Di BEJ*. Available. www.kompas.com.
- Rogalski, R, 1984, *New Fiding Regarding Day Of The Week Effect Return Over Treding And Non Trading Periode: A Note Journal Of Finansce*. Vol 39, No 5, 1603-1614.
- Sunariyah. 1996. *Pengentar Pengetahuan Pasar Modal*. Yogyakarta: UPP AMP YKPN.
- Tandelilin, Eduardus (2001), *Analisis Investasi Dan Manajemen Portofolio*, BPFE Yogyakarta.
- Tandelilin, Eduardus. 1999. *Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham Di Bursa Efek Jakarta*. Jurnal ekonomi dan bisnis indonesia, Vol.14, No.4.
- Tandelilin Eduardus dan Algifari, 2002. *Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham di BEJ*, dalam Suud Husnan dkk,.*Bunga Rampai Kajian Teori Keuangan BPFE*, Yogyakarta.
- Wihandaru, 2000, *Pengaruh Hari Perdagangan Saham Terhadap Indeks Harga Saham: studi kasus pada IHSG dan indeks LQ 45 tahun 2004*. Utilitas Vol.12 No. 1 tahun 2004.
- _____.2004. *Indonesian Capital Market Directory*.