

DAFTAR PUSTAKA

- Abu-rub, N and Sharba, T. (2011), *Calender effect in the palestine securities exchange(PSE): analysis & investigation*, diperoleh pada 21 April 2015 di: <http://www.wbiconpro.com/302-nour.pdf> .
- Arumugam, S. (1999), Focus on High Stock *abnormal return* Before Holidays New Evidence From India. *Journal of financial management*. Vol 12.
- Bursa Efek Indonesia. (2010), *Indeks*, diperoleh pada 24 April 2015 di :[www.idx.co.id/idid/beranda/informasi/ bagiinvestor/indeks.aspx](http://www.idx.co.id/idid/beranda/informasi/bagiinvestor/indeks.aspx).
- Cadsby, C. and Ratner, M.(1992), Turn-of-Month and Pre-Holiday Effect in Stock *abnormal return* s. *Journal of Banking and Finance*. Vol16.
- Chan, M.W.L. Khanthavit, A. and Thomas, H.(1996), Seasonality and Cultural Influences on Four Asian Stock Markets. *Asia Fasific Journal of Management*. Vol 13.
- Fahmi, I.(2015), *Manajemen Investasi: Teori dan Soal Jawab*, edisi kedua, Jakarta: Salemba Empat.
- Fama, E. (1970), Efficient Capital Market: A Review of Theory and Empirical Work. *Journal of Finance*. Vol 25.
- Gumanti, T. dan Utami, E. (2002), *Bentuk Pasar Efisien dan Pengujiannya*, diperoleh pada 22 April 2015 di : <http://puslit2.petra.aac.id/ejournal/indez.php/aku/article/view/15690>.
- Harjito, A.(2009), *Keuangan Perilaku Menganalisis Keputusan Investor*. Edisi Pertama, Yogyakarta: Ekonisia FE UII.
- Hendrawan, A. (2004), *Penelitian Anomali Efek Hari Liburan terhadap Imbal Hasil Indek LQ-45 di Bursa Efek Jakarta*. Tesis Megister Manajemen (Tidak dipublikasikan), Depok: Program Studi Ilmu Manajemen Pascasarjana Fakultas Ekonomi UI.

- Husnan, S.(2003),*Dasar-Dasar Teori Portofoliodan Analisis Saham*. CetakanKetiga, Yogyakarta: AMP YKPN.
- Jogianto,H. (2000),*Teori Portofolio dan Analisis Investasi*.Edisikedua, Yogyakarta:BPFE.
- Kamaludin.(2012).Reaksi Pemain Saham : Implikasi Libur Nasional Di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal ilmiah STIE MDP*.
- Kim, C.W. and Park, J. (1994), Holiday Effect and Stock *abnormal return* s: Further Evidence. *Journal of Financial and Quantitative Analysis*. Vol 29.
- Lakonishok, J. and Smidt, S .(1988), Are seasonal anomalies real? A ninety-year perspective. *Review of financial study 1*.
- Malasari,AR.(2014). *Efek Hari Libur Islam Terhadap Return, Abnormal return Dan Volume Perdagangan Saham Pada Perusahaan Yang Masuk Dalam Daftar Efek Syariah Periode 2007- 2013*. Skripsi (tidak dipublikasikan).
- Nurhayati, I. (2001),*Pengaruh Hari Perdagangan Saham Terhadap Return Saham Harian di Bursa Efek Indonesia*.Tesis(Tidak dipublikasikan).
- Rachmawati, R.(2005),*Pengaruh Hari Libur Tahun Baru dan Libur Idul Fitri Terhadap Abnormal return Pada Perusahaan Sektor Industri Barang Konsumsi*.Tesis. Tidak dipublikasikan.
- Ratnasari, D.(2014). Analisis Efek Hari Libur Perdagangan (*Holiday Effect*) Terhadap *Return Saham* :Study Pada Perusahaan Manufaktur Pada Sub Sektor Makanan Dan Minuman Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Pada Tahun 2013, *Jurnal Ekonomi dan Keuangan*.
- Rystroam , D.S. and Benson, E.D. (1989), Investor Psychology and The Day-of the Week Effect. *Financial Analysis Journal*.Vol 45.

- Salim, SJB, (2013), Pengaruh Holiday Effect Terhadap *Return* Indonesia Composite Index : Periode 1997 -1999 dan 2003-2005, *Finesta*. Vol1.
- Santika, MD. (2014), *Analisis The Day Of Week Effect, Week Four Effect, Rogalsky Efect dan January Effect terhadap Return Saham Perusahaan LQ 45 yang Terdaftar di BEI*, Skripsi Sarjana (Tidak dipublikasikan), Yogyakarta: Fakultas Ekonomi UII.
- Sherfin, H. (2000), *Beyond Greed and Fear: Understanding Behavioral Finance and Psychology of Investing*. Harvard Business School Press.
- Siregar, S. (2013), *Metode Penelitian Kuantitatif* *Dilengkapi Perbandingan Perhitungan Manual & SPSS*. Edisi Pertama. Kencana Media Grup. Jakarta.
- Sufany. (2010), *Pengaruh Hari Libur Kalender (Holiday Effect) Terhadap Anomali Return Indeks Sektoral Saham Perusahaan Yang Terdaftar Pada Bursa Efek Indonesia*, diperoleh pada 07 february 2016 di: <http://repository.usu.ac.id/handle/123456789/17525>
- Sukor, A. (2012), *Stock abnormal return , Firm Size, Liquidity and The Festivites Effect: Asian Evidence*, diperoleh pada 21 April 2015 di : http://asianfa2012.mcu.edu.tw/fullpaper_tfa%5C10144.pdf .
- Tendelilin, E. (2001), *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*. Edisi : Pertama. BPFE UGM. Yogyakarta.
- Tjipto, D dan Hendy, F. (2001), *Pasar Modal di Indonesia: Pendekatan Tanya Jawab*. Salemba Empat.
- Utomo, VJ dan Herlambang, L. (2015). Efek hari libur Idul Fitri pada emiten yang terdaftar dalam ISSI periode 2011-2013. *Jurnal JESTT* Vol. 2
- Putranto, P. (2012), *Memfaatkan Peluang Momentum Idul Fitri*, diperoleh pada 30 Mei 2015 di : <https://www.infovesta.com/isd/article/article5.html>.

Zaqi,M.(2006), *Reaksi Pasar Modal Indonesia Terhadap Peristiwa-Peristiwa Ekonomi dan Peristiwa-Peristiwa Sosial-Politik Dalam Negeri*.Tesis(tidak dipublikasikan), Semarang :Program Pasca Sarjana Universitas Diponegoro.