



DAFTAR PUSTAKA

- Agung Hendrawan (2004), 'Penelitian Anomali Efek Liburan Terhadap Imbal Hasil Indeks LQ-45 Di Bursa Efek Jakarta', diakses 17 Januari 2015, <http://lib.ui.ac.id/file?file=pdf/abstrak-109491.pdf>
- Ariel, Robert A. (1984), 'High Stock Returns Before Holidays : Existence and Evidence on Possible Causes', *Journal of Finance*, vol. 45, pp 1611-1626, diakses 17 Januari 2015, https://www3.nd.edu/~wevans1/class_papers/thaler.pdf
- Ariel, Robert A. (1987), 'A Monthly Effect in Stock Returns', *Journal of Financial Economics*, vol. 18, issue 1, pp 161-174, diakses 25 Januari 2015, <https://archive.org/details/monthlyeffectins00arie>
- Bastian Salim (2013), 'Pengaruh holiday Effect Terhadap Return Indonesia Composite Index (Periode 1997-1999 dan 2003-2005)', *Jurnal Finesta*, vol. 1, no. 1, hal. 78-85, diakses 17 Januari 2015, <http://studentjournal.petra.ac.id/index.php/manajemen-keuangan/search/authors/view?firstName=Saint%20John&middleName=Bastian&lastName=Salim&affiliation=&country=>
- Bowerman, Bruce L. et al (2011), *Business Statistic in Practice*, Edisi ke-6, New York : Mc Graw Hill Irwin
- Cooper, Donald R. and Pamela S. Schindler (2011), *Business Research Methods*, Edisi ke-11, New York : Mc Graw Hill Irwin
- Damodaran, Aswath (2012), *Investment Valuation: Tools and Techniques For Determining The Value of Any Asset*, Third Edition, New York : John Wiley & Sons Inc.
- Eduardus Tandelilin (2010), *Portofolio dan Investasi: Teori dan Aplikasi*, Edisi Ke-1, Jogjakarta : Kanisius.
- Fama, Eugene F. (1970), 'Efficient Capital Markets : A Review of Theory and Empirical Work', *Journal of Finance*, vol. 25, pp 383-417, diakses 16 Januari 2015, <http://onlinelibrary.wiley.com/doi/10.1111/j.1540-6261.1970.tb00518.x/full>

Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang
© Hak Milik IBIKKG Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber.
a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Gitman, Lawrence J. et al (2010), *Fundamental of Investing, Eleventh Edition*, New York : Harper Collinks College Publise, Inc.

Hirt, Geoffrey A. and Stanley B. Block (2011), *Fundamental of Investment Management, Tenth Edition*, New York : McGraw Hill Co.

Inam Ghozali (2013), *Aplikasi Analisis Multivariate Dengan Program*, Edisi Ke-7, Semarang : Badan Penerbit Universitas Diponegoro

Indonesia Stock Exchange (2014), *IDX Factbook*, Indonesia Stock Exchange Inc.

Jogiyanto (2013), *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*, Edisi Ke-8, Jogjakarta : BPFE – Jogjakarta.

Jones, Charles P. (2012), *Investments : Analysis and Management*, Twelfth Edition, New York : John Wiley & Sons Inc.

Kim and Park (1994), 'Holiday Effects and Stock Returns : Further Evidence', *Journal of Financial and Quantitative Analysis*, vol. 29, no. 1, diakses 17 Januari 2015, <http://www.jstor.org/discover/10.2307/2331196?sid=21105810910873&uid=2&uid=4>

Lakonshok, J. and Smidt S. (1988), 'Are Seasonal Anomalies Real? A Ninety Year Perspective', *The Review of Financial Studies*, vol. 1, issue 4, pp 403-425, diakses 25 Januari 2015, <http://www.jstor.org/discover/10.2307/2962097?sid=21105813155803&uid=2&uid=4>

Pettengil, Glenn N. (1989), 'Holiday Closings and Security Returns', *Journal of Financial Research*, vol. 12, pp 27-67, diakses 16 januari 2015, <http://onlinelibrary.wiley.com/doi/10.1111/j.1475-6803.1989.tb00101.x/abstract>

[Profil.merdeka.com](http://profil.merdeka.com), diakses 20 April 2015.

Hak cipta © Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie
Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang
1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:
a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.
b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.
2. Dilarang mengumumkan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.



Rama Imandani (2008), Skripsi: *Analisa Anomali kalender Terhadap Return di Bursa Efek Indonesia*, Universitas Islam Negeri Syarif Hidayatullah Jakarta, diakses 25 Januari 2015,
<http://repository.uinjkt.ac.id/dspace/bitstream/123456789/17135/1/Rama%20Imandani.pdf>

Reilly Frank K. dan Brown, Keith C. (2011), *Investment Analysis and Portofolio Management*, Tenth Edition, Fort Worth : The Dryden Press.

Rina Rachmawati (2008), Skripsi: *Pengaruh Hari Libur Tahun Baru dan Libur Lebaran Terhadap Abnormal Return Pada Perusahaan Sektor Industri Barang Konsumsi*, Universitas Diponegoro, diakses 25 Januari 2015, <http://eprints.undip.ac.id/9697/>

Rob, Nour Abu dan Tawfeeq Sharba (2011), 'Calendar Effects in The Palestine Securities Exchange (PSE) : Analysis & Investigation', *Journal of World Review of Business Research*, vol. 1, no. 5, pp 52-66, diakses 17 Januari 2015, <http://www.wrbrpapers.com/static/documents/November/2011/5.%20Nour.pdf>

Seyyed, Fazal J, et al (2005), 'Seasonality in Stock Returns and Volatility : The Ramadan Effect', *Research in International Business and Finance*, vol. 19, pp 374-383, diakses 16 Januari 2015, http://faculty.kfupm.edu.sa/FINEC/mahejji/Seasonality_returns.pdf

Suad Husnan dan Enny Pudjiastuti (2012), *Dasar-Dasar Manajemen Keuangan*, Edisi Ke-6, Jogjakarta : UPP STIM YKPN.

Sugeng, Wahyudi (2003), "Pengaruh Libur Lebaran dan Mood Investor", *Suara Merdeka*, 31 Oktober 2005, diakses 15 Januari 2015, <http://www.suaramerdeka.com/harian/0510/31/eko04.htm>

Sukor, Mohd Edil Abd (2012), 'Stock return, Firm Size, Liquidity and the Festivities Effect : Asian Evidence', diakses tanggal 17 Januari 2015, http://asianfa2012.mcu.edu.tw/fullpaper_tfa%5C10144.pdf

Thaler, Richard (1987), 'Seasonal Movements in Security Prices II : Weekend, Holiday, Turn of The Month, and Intraday Effects', *Journal of Economic Perspectives*, vol. 1,



no. 2, pp 169-177, diakses tanggal 17 januari 2015,
https://www3.nd.edu/~wevans1/class_papers/thaler.pdf



Hak Cipta Dilindungi Undang-Undang
Hak Milik Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie

Institut Bisnis dan Informatika Kwik Kian Gie

Tjiptono Darmadji dan Henry M. Fakhruddin (2011), *Pasar Modal di Indonesia: Pendekatan Tanya Jawab*, Edisi Ke-3, Jakarta : Salemba Empat.

Tom Hendrawan (2001), 'Analisis Perbedaan Tingkat Pengembalian Rata-rata Saham Sebelum dan Setelah Hari-hari Libur Nasional di Bursa Efek Jakarta', diakses tanggal 17 Januari 2015, <http://adln.lib.unair.ac.id/go.php?id=jiptunair-gdl-s2-2000-hendrawan2c-593-stocks&PHPSESSID=e99ecec43aeb91a73c0e368ce140cf5f>

Wansel, Joseph K. (1976), 'Investor Behavior and Information', *Journal of Financial and Quantitative Analysis*, vol. 11, issue 01, pp 13-37, diakses 15 Januari 2015, <http://journals.cambridge.org/action/displayAbstract?fromPage=online&aid=6317320&fileId=S0022109000020470>

www.sahamok.com, diakses 10 Maret 2015.

www.duniainvestasi.com, diakses 15 Maret 2015.

1. Dilarang mengutip sebagian atau seluruh karya tulis ini tanpa mencantumkan dan menyebutkan sumber:

a. Pengutipan hanya untuk kepentingan pendidikan, penelitian, penulisan karya ilmiah, penyusunan laporan, penulisan kritik dan tinjauan suatu masalah.

b. Pengutipan tidak merugikan kepentingan yang wajar IBIKKG.

2. Dilarang mengemukakan dan memperbanyak sebagian atau seluruh karya tulis ini dalam bentuk apapun tanpa izin IBIKKG.