

DAFTAR PUSTAKA

- Abu-Rub, N dan T.Sharba. 2011. "Calender Effect in Palestine Securities Exchange (PSE): Analysis & Investigation". *World Review of Business Research*, Vol. 1, No. 5, h. 52-66
- Ariel, Robert, A. 1990, "High Stoc Returns before Holidays:Existence and Evidence on Possible Causes", *The Journal of Finance*, vol.XLV, no.5.
- Arumugam, S. 1999. "Focus on High Stock Returns Before Holidays New Evidence From India". *Journal of Financial Management and Analysis*. Vol.12.
- Bloomberg. Historical price Jakarta Stock Exchange Composite Index (JCI:IND) 2011-2016. www.bloomberg.com [31 Juli 2018]
- Brockman, P. dan David Michayluk. 1998. "The Persistent Holiday effect: Additional Evidence". *Applied Economics Letters*, Vol.5, h.205-209
- Chan, M.W. L, Anya Khanthavit, dan Hugh Thomas. 1996. "Seasonality and cultural Influences, on Four Asian Stock Markets". *Asian Pasific Journal of Management*, 13:2, 1-24
- Chomariah, S. 2004. "Pengaruh Hari Libur Nasional Terhadap Return Saham Harian di Bursa Efek Jakarta". Tesis Dipublikasikan, Universitas Diponegoro
- Hamid, S. 2003. "Pengaruh Hari Libur Terhadap Return Pasar (Studi Empiris terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di Bursa Efek Jakarta)". *Tesis Dipublikasikan*, Universitas Diponegoro
- Hartono, J. 2016. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Kesepuluh
Yogyakarta: BPFE
- Hartono, J. 2015. *Studi Peristiwa Menguji Reaksi Pasar Modal Akibat Suatu Peristiwa*. Yogyakarta: BPFE

Hidayat, Anwar. 2014. *Wilcoxon Signed Rank Test dengan SPSS*

<https://www.statistikian.com/2014/08/wilcoxon-signed-rank-test-dengan-spss.html> diakses 27 Juli 2018

Hidayat, Anwar. 2017. *Tutorial Uji Mann Whitney U Test dengan SPSS*

<https://www.statistikian.com/2014/04/mann-whitney-u-test-dengan-spss.html/amp> diakses 27 Juli 2018

Kim, C. and J. Park. 1994. "Holiday Effect and Stock Returns : Further Evidence".

The Journal of Financial and Quantitative Analysis, Vol. 29, No. 1, h. 145-157

Lakonishok, J dan Smidt S. "Are Seasonal Anomalies Real? A Ninthy Year

Perspective". *Review of Financial Studies*, I, 403-425

Latifah, Umi. 2012. "Analsisi Perbedaan Return Saham Sebelum dan Sesudah Hari

Libur Keagamaan serta Hari Libur Nasional". *Diponegoro Journal of Management*, Vol. 1, No.2, h.117-129.

Manurung, Adler Haymans. "Efek Akhir Pekan dan Januari di BEJ?". *Usahawan*,

No.03 Th XXX Maret

Pettengill, Glenn N. 1989. *Technical Analysis: A Personal Seminar*. NYIF, New

York

Prasetyo, H. 2006. "Analisis Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return, Abnormal

Return, dan Volatilitas Return Saham (Studi pada LQ45 Periode Januari – Desember 2005)". *Tesis Tidak Dipublikasikan*, Universitas Diponegoro

- Rachmawati, R. 2005. "Pengaruh Hari Libur Tahun Baru dan Libur Lebaran terhadap Abnormal Return pada Perusahaan Sektor Industri Barang Konsumsi (Studi Kasus di Bursa Efek Jakarta Kurun Waktu Tahun 1998 sampai 2003 Periode Setelah Krisis Moneter)". *Tesis Dipublikasikan*, Universitas Diponegoro
- Rystorm, D.S. dan Earl D. Benson. 1989. "Investor Psychology & The Day of The Week Effect". *Financial Analysis Journal*, Vol. 45
- Salim, Saint John Bastian. 2013. "Pengaruh *Holiday Effect* Terhadap Return Indonesia Composite Index". *FINESTA*, Vol.1, No.1, h.78-85.
- School of Business & Management Bina Nusantara. 2015. *Uji Mann Whitney*.
<https://sbm.binus.ac.id/2015/11/21/uji-mann-whitney/> diakses 27 Juli 2018
- Sekaran, U. 2006. *Research Method for Business*. Jakarta: Salemba Empat
- Sukor, Mohd Edil Abd. (2012). "Stock Return, Firm Size, Liquidity and the Festivities Effect: Asian Evidence". JEL Classification : G12 G14. Faculty of Business and economics, University of melbourne.
- Sunariyah. 2000. *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*. Yogyakarta: UPP AMP
YKPN
- Supriyono, E. dan W. Wibowo. 2008. "Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham: Pengujian *Week-Four Effect* di Bursa Efek Jakarta". *Jurnal Manajemen dan Bisnis*, Vol. 16, No. 1, h. 54-62
- Tandelilin, E. 2001. Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio. Yogyakarta: BPFE
- Tangjitprom, N. 2010. "Preholiday Returns and Volatility in Thai Stock Market".
Asian Journal of Finance & Accounting, Vol. 2, No. 2, h 41-54
- Yahoo Finance. Historical price Jakarta Stock Exchange (JKSE) 2011-2016.
finance.yahoo.com [31 Juli 2018]