

DAFTAR PUSTAKA

- Bursa Efek Indonesia. (2010). *Buku Panduan Bursa 2010*. Jakarta : BEI
- Bursa Efek Indonesia. (2014). *IDX Annual Report 2014*. Jakarta : BEI
- Bursa Efek Indonesia. (2014). *IDX LQ45 August 2014*. Jakarta : BEI
- Darmadji, Tjiptono., dan Fakhrudin, Hendy M. (2011). *Pasar Modal di Indonesia*. Edisi Ketiga. Jakarta : Salemba Empat.
- Datta, Vadali Sri Ram., Devi, Mynampati Uma., dan Praneeth, Andhe.(2014). *An Empirical Study of Holiday Impact on Stock Market Returns*. Vol. 1, Series. 7, ISSN : 2347-7695. Indian Research Journal.
- Dumitriu, Ramona., Stefanescu, Razvan., dan Nistor, Costel. (2012). *Holiday effect on The Romanian Stock Market*. No. 41635. Munich Personal RePEc Archive.
- Fama, Eugene F. (1970). *Efficient Capital Markets : A Review of Theory and Empirical Work*. Vol. 25, No. 2, 383-417. The Journal of Finance, Wiley-Blackwell.
- Gumanti, Tatang. (2011). *Manajemen Investasi : Konsep, Teori, dan Aplikasi*. Edisi 1. Jakarta : Mitra Wacana Media.
- Handayani, Putu Sukma., dan Suartana, I Wayan. (2015). *Pengaruh Hari Perdagangan Pada Abnormal Return Dan Volatilitas Return Saham Indeks LQ45*. 916-932, ISSN : 2302-8556. E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana.

- Indriasari, Ika., Sugiarto.(2014). *Seasonal Effects Pada Anomali Pasar Modal : Suatu Review*. Vol.11, No. 1, 1-12. Jurnal Dinamika Ekonomi & Bisnis.
- Kamaludin.(2012). Reaksi Pemain Saham : *Implikasi Libur Nasional Di Bursa Efek Indonesia*. Vol. 1, No. 2, 93-98. Forum Bisnis Dan Kewirausahaan Jurnal Ilmiah STIE MDP.
- Latifah, Uli.(2012). *Analisis Perbedaan Return Saham Sebelum Dan Sesudah Hari Libur Keagamaan Serta Hari Libur Nasional (Studi Empiris Pada Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di Bursa Efek Indonesia Periode 2007-2011)*. Vol. 1, No. 2, 117-129. Diponegoro Journal Of Management.
- Marcus, Alan., Bodie, Zvi., dan Kane, Alex. (2010). *Investments*. Edisi Sembilan. New York City : McGraw Hill.
- McGowan, Carl B., dan Jakob, Noor Azzudin. (2010). *Is There An Eid al-Fitr Effect In Malaysia ?*. Vol. 9, No. 4, 11-20. International Business & Economics Research Journal.
- Nurmayanti. (2014, 24 Desember). IHSG Menghijau Jelang Libur Natal [online]. Tersedia : m.liputan6.com/ diakses pada 9 September 2015.
- Salim, Saint John Bastian . (2013). *Pengaruh Holiday effect Terhadap Return Indonesia Composite Index (Periode 1997-1999 dan 2003- 2005)*. Vol. 1, No.1, 78-85. FINESTA.
- Sanusi, Anwar. (2011). *Metodologi Penelitian Bisnis*. Jakarta : Salemba Empat.
- Saunders, Mark., Lewis, Philip., dan Thomhill, Adrian. (2009). *Research Methods for Business Students*. Edisi kelima. England : Pearson Education Limited.

Silva. (2010). *Calendar “anomalies” In The Portuguese stock market.* No.71. Investment Analysts Journal.

Sugiyono. (2011). *Metode Penelitian Kuantitatif Kualitatif Dan R & D.* Bandung : Alfabeta.

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. (2010). *Pengantar Pengetahuan pasar Modal.* Edisi ke-6. Yogyakarta : UPP-AMP YKPN.

Sunarto dan Riduwan. (2010). *Pengantar Statistika Untuk Penelitian : Pendidikan, Sosial, Komunikasi, Ekonomi, Dan Bisnis.* Bandung : Alfabeta.

Sunjoyo., Setiawan, Rony., Carolina, Verani., Magdalena, Nonie., dan Kurniawan, Albert. (2013). *Aplikasi SPSS untuk SMART Riset.* Bandung : Alfabeta.

Tangjitprom, Nopphon. (2010). *Preholiday Returns and Volatility in Thai stock market.* Vol. 2, No. 2, X : E3, ISSN 1946-052X, 41-54. Asian Journal of Finance & Accounting.

Yuan, Tian., dan Gupta, Rakesh. (2014). *Chinese Lunar New Year effect in Asian stock markets, 1999-2012.* QUAECO-781, No. 9. The Quarterly of Economics and Finance, Elsevier.

<http://finance.yahoo.com/q/hp?s=^JKLQ45+Historical+Prices> diakses pada 10 September 2015

<http://finance.yahoo.com/q/hp?s=AALI.JK+Historical+Prices> diakses pada 6
November 2015

<http://finance.yahoo.com/q/hp?s=BBRI.JK+Historical+Prices> diakses pada 6
November 2015

<http://finance.yahoo.com/q/hp?s=GGRM.JK+Historical+Prices> diakses pada 6
November 2015

<http://finance.yahoo.com/q/hp?s=INDF.JK+Historical+Prices> diakses pada 6
November 2015

<http://finance.yahoo.com/q/hp?s=INTP.JK+Historical+Prices> diakses pada 6
November 2015

<http://finance.yahoo.com/q/hp?s=JSMR.JK+Historical+Prices> diakses pada 6
November 2015

<http://finance.yahoo.com/q/hp?s=KLBF.JK+Historical+Prices> diakses pada 6
November 2015

<http://finance.yahoo.com/q/hp?s=LSIP.JK+Historical+Prices> diakses pada 6
November 2014

<http://www.idx.co.id/id-id/beranda/beritadanpengumuman/jadwalliburbursa.aspx>
diakses pada 9 September 2015

http://www.ksei.co.id/corporate_action_schedule/cash_dividend diakses pada 2
November 2015