

Daftar Pustaka

- Al-Jafari, khaled Mohamed. 2012. *An Empirical Investigation of the Day-of-the-Week Effect on Stock Returns and Volatility: Evidence from Muscat Securities Market*. International Journal of economics and Finance, vol4, No7 (<http://ccsenet.org/journal/index.php/ijef/article/download/18329/12124>). Diakses tanggal 16 Maret 2016.
- Antarnews. 2016. Informasi nilai IHSG sebelum libur natal. www.Antarnews.com (diakses tanggal 3 April 2016)
- As'adah Luluk. 2009. Pengaruh *January Effect* Terhadap *Abnormal Return* dan *Volume* Perdagangan Saham di *Jakarta Islamic Index* (JII). Skripsi. Program Studi Manajemen Keuangan Islam Universitas Islam Negeri Sunan Kalijaga. Yogyakarta. (<http://www.thedigilib.com/doc/41380-pengaruh-january-effect-terhadap-abnormal-return-dan-volume-perdagangan-pada-saham-di-jakarta-islamic-index-jii#.UZIxKFJOKKE>). Diakses tanggal 20 Juli 2016.
- BEI. 2016. Publikasi LQ45. www.IDX.co.id (diakses tanggal 26 Maret)
- Cao, Xiaoli. Et, al. 2009. Firm Size and the Pre-Holiday Effect in New Zealand. *International Reserch Journal of Finance and Economics (online)*, No 32. Hal 171-187. (www.eurojournals.com). Diakses tanggal 16 Maret 2016.
- Chomariah, Siti. 2004. Pengaruh Hari Libur Nasional terhadap Return Saham Harian di BEI. *Published master's thesis*, Program Pasca Sarjana Universitas Diponegoro, Semarang. (<http://eprints.undip.ac.id>). Diakses tanggal 16 Maret 2016.
- Dodd, Olga & Gakhovich, Alex. 2011. The holiday effect in Central and Eastern European financial markets. *Investment Management and Financial Innovations (online)*, vol 8 No 4. Hal 29-35. (<http://businessperspectives.org>). Diakses tanggal 16 Maret 2016.

- Ghozali, Imam. 2013. *Aplikasi Analisis Multivariate dengan SPSS21 Update PLS Regresi*. Edisi 7. Badan Penerbit Diponegoro. Semarang. *Program IBM Universitas*
- Hamid, Syahril. 2003. Pengaruh Hari Libur terhadap Return Pasar. Published master's thesis, Program Pasca Sarjana Universitas Diponegoro. Semarang. (<http://eprints.undip.ac.id>). Diakses tanggal 16 Maret 2016.
- Hidayat, Anwar. 2015. *CochraneOrcutt*. (<http://www.statistikian.com/2015/01/cochrane-orcutt.html>). Diakses pada 21 Juli 2016.
- Ilmupengetahuanumum. 2016. Informasi jumlah kependudukan sesuai agama. www.ilmupengetahuanumum.com (diakses tanggal 18 Maret 2016).
- Levy, H. 1996. *Intoduction to Investment*, South-Western College Publishing.
- Okezone. 2016. Fenomena pasar Wall Street. [www.Okezone.com](http://www.okezone.com) (diakses tanggal 2 Maret 2016)
- Rachmawati, Rina. 2005. Pengaruh Hari Libur Tahun Baru dan Libur Lebaran terhadap *Abnormal Return* Pada Perusahaan Sektor Industri Barang Konsumsi. *Published master's thesis*, program pasca sarjana Diponegoro, Semarang. (<http://eprints.undip.ac.id>). Diakses tanggl 17 Maret 2016.
- Tandelilin, Eduardus. 2010. *Portofolio dan Investasi: Teori dan Aplikasi*. Edisi pertama. Kanisius. Yogyakarta.
- Yahoo. 2016. *Historical Price*. www.Yahoofinance.com (diakses tanggal 10 April 2016)
- Yamin, Dkk. 2011. *Regresi dan Korelasi Dalam Genggaman Anda*. Salemba Empat. Jakarta.