

DAFTAR PUSTAKA

- Anggraeni, Olivia Dewi. 2018. Pengujian Holiday Effect Terhadap Abnormal Return dan Trading Volume Activity Di Bursa Efek Indonesia. *Skripsi. Sekolah Tinggi Ilmu Ekonomi Perbanas Surabaya*. (Tidak dipublikasikan).
- Anggraini, Mardiana Cahya. 2017. Analisis Perbandingan Return dan Trading Volume Activity Sebelum dan Sesudah Idul Fitri Pada Perusahaan Makanan dan Minuman Yang Listing Di Bursa Efek Indonesia Periode 2014-2016. *Jurnal Simki Economic*. Vol. 1, No. 2.
- Ariyani, Pratiwi. 2012. Efek Anomali Pasar Terhadap Return Saham Perusahaan LQ45 yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia. *Skripsi. Sekolah Tinggi Ilmu Ekonomi Perbanas Surabaya*. (Tidak dipublikasikan).
- Alteza, Muniya. 2007. Efek Hari Perdagangan Terhadap Return Saham: Suatu Telaah atas Anomali Pasar Efisien, *Jurnal Ilmu Manajemen*. Vol. 3, No. 1, pp. 31-43.
- As'adah, Luluk. 2009. Pengaruh January Effect Terhadap Abnormal Return dan Volume Perdagangan Pada Saham Di Jakarta Islamic Index (JII). *Skripsi. Universitas Islam Negeri Sunan Kalijaga. Yogyakarta*. (Tidak dipublikasikan).
- Audina, Mellina dan Kazia Laturette. 2017. January Effect Pada Sektor Property, Real Estate, dan Building Construction Di Bursa Efek Indonesia, *Jurnal Riset Akuntansi dan Keuangan*. Vol. 5, No. 2, pp. 1337-1348.
- Deannes, Putri Cahaya Pertiwi dan Isynuwardhana. 2015. January Effect Pada Perusahaan LQ 45 Di Bursa Efek Indonesia Periode 2009 – 2013. *ISSN : 2355-9357 Jurnal Akuntansi Universitas Telkom*. Vol. 2, No. 1, pp. 524-538.
- Fama, Eugene. 1970. Efficient Capital Market: A Review Of Theory and Empirical Work, *Journal Of Finance*, Vol. 25, No.9.
- Fitriani, Elvira dan Titin Hartini. 2014. Pengaruh January Effect Terhadap Abnormal Return Pada Saham Sektor Otomotif Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI).
- Fitriyani, Indah dan Maria M. Ratna Sari. 2013. Analisis January Effect Pada Kelompok Saham Indeks LQ-45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2009-2011, *E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana*. Vol. 4, No. 2, pp. 421-438.
- Ghozali, Imam. 2013. *Aplikasi Analisis Multivariate Dengan Program SPSS*. Badan Penerbit Universitas Diponegoro, Semarang.
- Gumanti, Tatang Ary dan Elok Sri Utami. 2002. Bentuk Pasar Efisien dan Pengujiannya. *Jurnal Ekonomi Akuntansi*. pp, 55-69.
- Hartono, Jogiyanto. 2016. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Badan Penerbit Fakultas Ekonomi Universitas Gadjah Mada, Yogyakarta.
- Hasanuddin. 2015. Analisis Komparatif Abnormal Return saham JII dan non JII Sebelum dan Sesudah Libur Idul Fitri (Periode 2009-2013). *Jurnal MIX*. Vol. 6, No. 2, pp. 246-259.

- Hinawati, Titik. 2016. Efek Hari Libur Idul Fitri Terhadap Abnormal Return Pada Bursa Efek Indonesia. *Cakrawala*. Vol. 11, No. 1, pp. 34–50.
- Indriasari, Ika dan Sugiarto. 2014. Seasonal Effects Pada Anomali Pasar Modal : Suatu Review, *Jurnal Dinamika Ekonomi & Bisnis*. Vol. 11, No. 1. UNISNU JEPARA.
- Indriastuti, Aisyah. 2018. Pengaruh Hari Libur Idul Fitri Terhadap Abnormal Return, Security Return Variability dan Trading Volume Activity Pada Jakarta Islamic Index (JII) Tahun 2013-2016. *Skripsi. Institut Agama Islam Negeri Surakarta*. (Tidak dipublikasikan).
- Jonathan, Sarwono. 2006. *Metode Penelitian Kuantitatif dan Kualitatif*. Graha Ilmu, Yogyakarta.
- Juliana, Oktafalia Marisa. 2016. Anomaly Holiday Effect Mempengaruhi Return Indeks Harga Saham Gabungan Di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2013-2015. *P-ISSN: 2337-6694 E-ISSN: 2527-9769 Jurnal Administrasi Kantor*. Vol. 4, No. 2, pp. 289-306.
- Kadir, Sherly dan Suramaya Suci Kewal. 2014. Fenomena January Effect Di Bursa Efek Indonesia (Studi Pada Perusahaan Yang Terdaftar Di LQ45 Periode 2010-2013). *Jurnal Keuangan dan Bisnis*. Vol. 12, No.1, pp. 125-140.
- Latifah, Uli. 2012. Analisis Perbedaan Return Saham Sebelum Dan Sesudah Hari Libur Keagamaan Serta Libur Nasional (Studi Empiris Pada Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Di Bursa Efek Indonesia Periode 2007-2011). *Skripsi. Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro*. (Tidak dipublikasikan).
- Malasari, Arnisa Rakhmah Jis. 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. Universitas Islam Negeri Sunan Kalijaga Yogyakarta*. (Tidak dipublikasikan).
- Majid, M. Shabri Abd dan Cut Windaswari. 2015. Analisis Return dan Kalender Anomali: Studi Komparatif Antara Saham Syariah dan Konvensional Di Indonesia. *Jurnal Human Falah*. Vol. 2, No. 1, pp 29-49.
- Mutiasari, Dinda dan V. Santi Paramita. 2017. Analisis January Effect Pada Return Saham, Abnormal Return dan Trading Volume Activity Untuk Kelompok Saham Indeks LQ-45 Di Bursa Efek Indonesia (Bei) Tahun 2013-2016.
- Nofsinger, John R. 2005. *Psychology Of Investing*. Second Edition. Presentice-Hall Inc, New Jersey.
- Patriawan, Dwiatma. 2011. Analisis Pengaruh Earning Per Share, Return On Equity, dan Debt To Equity Ratio Terhadap Harga Saham Pada Perusahaan Wholesale and Retail Trade Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI) Tahun 2006 – 2008. *Skripsi. Universitas Diponegoro Semarang*. (Tidak dipublikasikan).
- Pradnyaparamita, Ni Made W dan Henny Rahyuda. 2017. Pengujian Anomali Pasar January Effect Pada Perusahaan LQ-45 Di Bursa Efek Indonesia. *ISSN 2302-8912 E-Jurnal Manajemen Unud*. Vol. 6, No. 7, pp 3513-3539.
- Rachmawati, Rina. 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. Universitas Diponegoro Semarang*.
- Rita, Maria Rio. 2009. Pengaruh Hari Perdagangan Terhadap Return Saham. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis*. Vol. 15, No. 2, pp. 121-134.

Roth, Allan. 2007. *Behavioral Finance*. Article Wealth Logic, LLC <http://daretobedull.com/> (diakses tanggal 14 Juli 2019).

Sari, Fitri Aprilia dan Eka Ardhani Sisdyani. 2014. Analisis January Effect Di Pasar Modal Indonesia. *ISSN 2302-8556 E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana*. Vol. 6, No. 2, pp. 237-248.

Sujarweni, V. Wiratna. 2016. *Kupas Tuntas Penelitian Akuntansi Dengan SPSS*. Edisi Lengkap. Pustaka Baru Press, Yogyakarta.

Tasman, Abel, Rosyeni Rasyid, dan Ika Putriana Timuria. 2015. Analisis January Effect: Studi Empiris Pada Main Board Index (Mbx) Di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Kajian Manajemen Bisnis Universitas Negeri Padang*. Vol. 4, No. 2.

Undang-Undang Republik Indonesia Nomor 8 Tahun 1995 *tentang Pasar Modal*.

Utomo, Venny Julia dan Leo Herlambang. 2015. Efek hari Libur Lebaran Pada Emiten Yang Terdaftar dalam ISSI periode 2011-2013. *Jurnal JESTT*. Vol. 2, No. 5, pp. 372-386.

Werastuti, Desak Nyoman Sri. 2012. Anomali Pasar Pada Return Saham : The Day Of Week Effect, Week Four Effect, Rogalsky Effect, dan January Effect. *ISSN 2089-3310 Jurnal Ilmiah Akuntansi dan Humania JINAH*. Vol. 2, No. 1, pp.1-18.

Yasa, Sabdasyah. 2018. Pengaruh January Effect, Ramadhan Effect, Imlek Effect, Terhadap Return dan Trading Volume Activity Di Bursa Efek Indonesia. *Skripsi. Universitas Islam Indonesia. Yogyakarta*. (Tidak dipublikasikan).

www.idx.co.id (diakses tanggal 8 Maret 2019)

www.ojk.go.id (diakses tanggal 13 Maret 2019)

www.sahamok.com (diakses tanggal 15 Maret 2019)

www.yahoofinance.com (diakses tanggal 22 Maret 2019)