

DAFTAR PUSTAKA

- _____. 2013. Puasa dan Saham, diakses pada tanggal 12 Januari 2015 dari <http://thepresidentpostindonesia.com/2013/07/08/puasa-dan-saham/>
- _____. 2014. Pengantar Pasar Modal, diakses pada 11 Desember 2014 dari <http://www.idx.co.id/idid/beranda/informasi/bagiinvestor/pengantarpasarmodal.aspx>
- Akrami, H., Garkaz, M., dan Mehrazin. 2012. The effect of Ramadhan month on stock abnormal return of the companies accepted in Tehran Stock Exchange. *Economic and Finance Review*, 2(5): 45 51.
- Al-Hajjeh, H., Redhead, K., dan Rodgers, T. 2010. Investor sentiment and calendar anomaly effect: A case study of the impact of Ramadhan on Islamic Eastern Middle Markets. *Research in International Business and Finance*, 25(3): 345 356.
- Al-Issis, M. 2010. *The Impact of Religious Experience on Financial Markets. Working Paper*. Harvard University.
- Al-Khazali, O. 2014. Revisiting fast profit investor sentiment and stock return during Ramadhan. *International Review of Financial Analysis*, 33(2014): 158 170.
- Alteza, M. 2006. Efek hari perdagangan terhadap return saham: Suatu telaah atas anomali pasar efisien. *Jurnal Ilmu Manajemen*, 3(1): 36 37
- Amelita. 2014. Memanfaatkan Peluang Perubahan Perilaku Musiman Konsumen, diakses pada tanggal 12 Januari 2015 dari <http://www.frontier.co.id/memanfaatkan-peluang-perubahan-perilakumusiman-konsumen.html>
- Anonim. 2013. Laporan SPE Juni 2013, diakses pada 11 Desember 2013 dari <http://bi.go.id>
- Anoraga dan Pakarti. 2006. *Pengantar Pasar Modal*. Edisi Revisi. Jakarta: Rineka Cipta.
- Arikunto, S. 2010. *Prosedur Penelitian*. Jakarta: Renika Cipta.
- Bank Dunia. 2012. Laporan Perkembangan Triwulan Perekonomian Indonesia Penyesuaian Berlanjut., diakses pada tanggal 16 Juni 2015 dari <http://worldbank.go.id>
- Bialkowski, J., Etebari, A., dan Wisniewski, T.P. 2011. Fast profits: investor sentiment and stock returns during Ramadhan. *Journal of Banking and Finance*, 36(2012): 835 845.

- Bringham, E.F., dan Houston, J.F. 2006. *Dasar-dasar Manajemen Keuangan*. Diterjemahkan oleh Ali Akbar Yulianto. Edisi Kesepuluh. Jakarta: Salemba Empat
- Bukhari, Z., Ali, U., Shahzad K., Bashir, S. 2009. Determinants of organizational citizenship behavior in Pakistan. *International Review of Business Research*, 5(2): 132 150.
- Chordia, T., and Bhaskaran. 2000. Trading volume and cross auto correlations in stock return. *Journal of Finance*, 4
- Cooper, D., R., Schindler, P.S., 2006. *Metode Riset Bisnis*. Edisi Kesembilan. Jakarta: PT Media Global Edukasi.
- Darmadji, T. dan Fakhruddin, H.M. 2008. *Pasar Modal di Indonesia: Pendekatan Tanya Jawab*. Edisi 2. Jakarta: Salemba Empat.
- Dewi, F.M.S. 2014. *Konsistensi Efek Ramadhan dalam Waktu dan Periode yang Berbeda pada Saham-Saham Pembentuk ILQ'45 di Bursa Efek Indonesia*. Universitas Jember, Jember: Skripsi tidak dipublikasikan.
- Elton, E.J., dan Gruber, M.J. 2008. *Modern Portfolio Theory and Investment Analysis*. United States of America: John Willey & Sons, Inc.
- Fahmi, I. 2012. *Manajemen Investasi: Teori dan Soal Jawab*. Jakarta: Salemba Empat.
- Fama, E.F. 1970. Efficient capital market: A review of theory and empirical work. *Journal of Finance*, 25: 383 417
- Fama, E.F. 1998. Market efficiency, long-term returns, and behavioral finance. *Journal of Financial Economics*, 49(3): 283 306
- Ghozali, I. 2009. Analisis Multivariate Program IBM SPSS 2. Edisi 7. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro
- Gumanti, T. A. dan Utami, E. S. 2012. Bentuk pasar efisien dan pengujiannya. *Jurnal Akuntansi dan Keuangan*, 4(1): 54 68
- Gunawan, B. dan Indah, Y. 2005. Pengaruh volume perdagangan dan return terhadap bid ask spread dengan model koreksi kesalahan (Studi empiris saham industri farmasi di Bursa Efek). *Jurnal Akuntansi dan Investasi*, 6(2)
- Hensel, C.R., dan Ziemba, W.T. 1996. Investment result from exploiting turn of the month effect. *Journal of Portfolio Management*, 22(3): 17 23.
- Hidayat, Z.A. 2004. *Indonesia Consumers*, Jakarta: Kompas, 3/10/2006
- Husain, F. 1998. A seasonality in the Pakistani Equity Market: the Ramadhan effect. *The Pakistan Development Review*, 37(1): 77 81.

- Husnan, S. 2009. *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: UPP AMP YKPN
- Husnan, S. dan Pudjiastuti, E. 2005. *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: UPP AMP YKPN
- Idrus, M. 2009. *Metode Penelitian Ilmu Sosial Pendekatan Kualitatif dan Kuantitatif*. Yogyakarta: Erlangga.
- Jogiyanto, H. 2013. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Edisi Ketujuh. Yogyakarta: BPFE
- Kuncoro, M. 2009. *Metode Penelitian Teori dan Aplikasi untuk Bisnis dan Ekonomi*. Edisi Ketiga. Jakarta: Erlangga.
- Meyers, T.A. 1992. *The Technical Analysis Course a Winning Program for Stock and Futures Traders and Investors*. Tokyo: Toppan Company Ltd
- Mustafa, K. 2008. The islamic alendar effect on Karachi Stock Market. *Pakistan Business Review* October 2011: 569
- Nachrowi, D. N., Usman, H. 2006. *Pendekatan Populer dan Praktis Ekonometrika untuk Abalisis Ekonomi dan Keuangan*. Jakarta: Lembaga Penerbit FEUI
- Priansyah, R.A. 2014. *Analisis Pengaruh Bulan Ramadhan terhadap Pasar Modal di Indonesia pada Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)*. Universitas Indonesia, Jakarta: Skripsi tidak dipublikasikan.
- Ramezani, A., Pouraghajan, A., dan Mardani, H. 2013. Impact of Ramadhan on stock exchange index: case of Iran. *World of Sciences Journal*, 1(12): 46 54.
- Rendra, Tomy. 2005. Analisis fenomena efek Januari di Bursa Efek Jakarta Periode 1997-2001. *Jurnal Bisnis dan Manajemen*, 4(1): 1 17
- Rio, Rita, Maria. 2009. Pengaruh hari perdagangan terhadap return saham. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis*, 15(2): 121 134
- Samsul, M. 2006. *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Erlangga.
- Sarwono, J. 2006. *Metode Penelitian Kuantitatif dan Kualitatif*. Yogyakarta: Graha Ilmu.
- Sekaran, U. 2006. *Metodologi Penelitian untuk Bisnis*. Buku Kedua. Edisi Keempat. Jakarta: Penerbit Salemba Empat.
- Seyyed, F.J., Abraham, dan Al-Hajji, M. 2005. Seasonality in stock return and volatility: the Ramadhan effect. *Research in International Business and Finance*, 19(3):374 383.

- Shah, S.M.A.U.R, dan Ahmed, S.N. 2014. The Ramadhan effect on Stock Market. *European Academic Research*. 1(11): 4712 4720.
- Sugiyono. 2010. *Metode Penelitian Bisnis Pendekatan Kuantitatif, Kualitatif, dan R & D*. Cetakan Kelimabelas. Bandung: CV. Alfabeta.
- Sugiyono. 2012. *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif, dan R& D*. Bandung: Alfabeta.
- Suliyanto. 2011. *Ekonometrika Terapan: Teori dan Aplikasi dengan SPSS*. Yogyakarta: CV Andi Offset.
- Sunariyah. 2006. *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*. Yogyakarta: UPP STIM YKPN.
- Supardi. 2005. *Metode Penelitian Ekonomi dan Bisnis*. Yoyakarta: UII Press.
- Tandelilin, E. 2010. *Portofolio dan Investasi (teori dan aplikasi)*. Yogyakarta: Kanisius.
- Thaler, R.H. 1987. Anomalies: the January effect. *Journal of Economic Perspectives*, 1(1): 197 201
- Trihendradi, C. 2012. *Step by Step SPSS 20 Analisis Data Statistik*. Yogyakarta: CV Andi Offset
- Weston, J.F. dan Copeland, T.E. 2008. *Manajemen Keuangan*. Edisi Kesembilan. Diterjemahkan oleh Jaka Wasana. Jakarta: Binarupa Aksara.
- Zafar, N., Shah, S.Z.A, Urooj, F. 2009. Calendar anomalies: case of Karachi Stock Exchange. *Journal Of Economic and International Finance*, 9: 88 99.