

## DAFTAR PUSTAKA

- Aisyah, N. E., Desmintari, & Yetti, F. (2021). Analisis *Ramadhan effect* Pada Perusahaan Sub Sektor Food and Beverages yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *Prosiding Konferensi Riset Nasional Ekonomi, Manajemen, Dan Akuntansi*, 2, 1446–1456.
- Akbar, R., Nurmatias, & Triwahyuningtyas, N. (2021). Analisis *Ramadhan effect* Pada *Abnormal return* Subsektor Food and Beverages di Bursa Efek Indonesia (BEI). *Prosiding Konferensi Riset Nasional Ekonomi, Manajemen, Dan Akuntansi*, 2, 1499–1511.
- Alajbeg, D., Bubas, Z., & Sonje, V. (2013). The *Efficient Market Hypothesis*: problems with interpretations of empirical tests. In *Financial Theory and Practice* (Vol. 36, Issue 1). Institute of Public Finance. <https://doi.org/10.3326/fintp.36.1.3>
- Alianty, A., Setiyawan, S., & Azib. (2022). Analisis Perbedaan Pre-dan Post-Islamic Holiday Effect pada *Abnormal return* di Bursa Efek Indonesia (BEI) Selama Pandemi. *Bandung Conference Series: Business and Management*, 2(2). <https://doi.org/10.29313/bcsbm.v2i2.3563>
- Budiwanto, S. (2017). *Metode Statistika Untuk Mengolah Data Keolahragaan*.
- Cung, D., & Rakhmat, A. S. (2022). Apakah Terdapat Perbedaan Harga Saham, Volume Perdagangan, *Abnormal return* Antara Sebelum dan Sesudah Merger PT Indosat? *Jurnal IKRAITH-Ekonomika*, 5(3). <http://journals.upi-yai.ac.id/index.php/IKRAITH-EKONOMIKA>
- Darwin, M., Mamandol, M. R., Sormin, S. A., Nurhayati, Y., Tambunan, H., Sylvia, D., Adnyana, M., Prasetyo, B., Vianitati, P., & Gebang, A. (2020). *Metode Penelitian Pendekatan Kuantitatif* (T. S. Tambunan, Ed.). CV. MEDIA SAINS INDONESIA. [www.penerbit.medsan.co.id](http://www.penerbit.medsan.co.id)
- Desiyanti, R. (2017). *Teori Investasi dan Portofolio*. Bung Hatta University Press.
- Desmizar. (2021). Pengaruh Day Of the Week Effect Terhadap *Return* Saham Perusahaan Sektor Industri Perbankan di Bursa Efek Indonesia Periode 2019. *Jurnal Ilmu Ekonomi Dan Sosial*, 11(1), 32–46.
- Ehiedu, Chukwunweike, V., Obi, & Callistar. (2022). *Efficient Market Hypothesis* (EMH) and the Nigerian Stock Exchange in The Midst of Global Financial Crisis. *International Journal of Academic Management Science Research (IJAMSR)*, 6(8), 263–273. <https://www.researchgate.net/publication/364304726>

- Faih, A. (2022). Analisis Efek *Ramadhan* Terhadap *Abnormal return* dan *Trading volume activity* pada Perusahaan LQ-45 Di Bursa Efek Indonesia Periode 2015-2019. *Jurnal Ekonomi Syariah Darussalam*, 3(2).
- Faih, A., & Nafiah, R. (2019). Analisis Efek *Ramadhan* Terhadap *Abnormal return* dan *Trading volume activity* pada Perusahaan Yang Masuk dalam Jakarta Islamic Index (JII) di Bursa Efek Indonesia Periode 2014-2018. *Al-Tijary*, 5(1), 37–47. <https://doi.org/10.21093/at.v5i1.1598>
- Gbeda, J. M., & Peprah, J. A. (2018). Day of the week effect and stock market volatility in Ghana and Nairobi stock exchanges. *Journal of Economics and Finance*, 42(4), 727–745. <https://doi.org/10.1007/s12197-017-9409-7>
- Handini, S., & Astawinetu, E. (2020). *Teori Portofolio dan Pasar Modal Indonesia*. Scopindo Media Pustaka.
- Hartini, T., Amir, A., & Aurora Lubis, T. (2019). The Difference Analysis of *Abnormal return* and Trade Volume Activity Before and After *Ramadhan effects* on Food and Beverages Companies Listed in Indonesian Sharia Stock Index (ISSI). *Journal of Business Studies and Management Review (JBSMR)*, 2(2). [www.idx.co.id](http://www.idx.co.id)
- Hassan, M. H., & Kayser, M. S. (2019). Ramadan effect on stock market *return* and trade volume: Evidence from Dhaka Stock Exchange (DSE). *Cogent Economics and Finance*, 7(1). <https://doi.org/10.1080/23322039.2019.1605105>
- Hidayati, N., Maslichah dan Junaidi, H., Studi Akuntansi, P., & Ekonomi dan Bisnis, F. (2018). *Studi pada Perusahaan Food and Beverages yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode*.
- Husnan, S. (2005). *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. UPP STIM YKPN.
- Jaziri, M., & Abdelhedi, M. (2018). Islamic occasions and investor sentiment. *International Journal of Islamic and Middle Eastern Finance and Management*, 11(2), 194–212. <https://doi.org/10.1108/IMEFM-08-2017-0225>
- Jogiyanto, H. (2010). *Teori Portofolio dan analisis Investasi*. PBF E.
- Jogiyanto, H. (2017). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. BPF E.
- Karami, R. A. (2019). *Pengaruh Return Saham Terhadap Volatilitas Return Saham Dengan Membandingkan Saham Sebelum Masuk Dan Setelah Masuk Di ISSI*.

- Khan, M. (2013). *The Handbook of Equity Market Anomalies Translating Market Inefficiencies into Effective Investment Strategies*.
- Kudusia, N. A., Yusuf, N., & Mahmud, M. (2020). Reaksi *Abnormal return* Dan *Trading volume activity* Sebelum Dan Sesudah *Ramadhan effect*. *Jambura Accounting Review*, 1(1), 48–58.
- Muga, Ma. P. L. (2020). Reaksi Pasar Terhadap Peristiwa Aksi Demo Tanggal 22 Mei 2019 di Bursa Efek Indonesia (BEI). *Jurnal Akuntansi: Transparansi Dan Akuntabilitas*, 8(2), 88–95.
- Muhammad, B. Y., & Yanuarti, I. (2020). Perbedaan *Abnormal return* dan *Trading volume activity* Saham Sebelum Ramadan, Selama Ramadan, dan Sesudah Ramadan : Studi Pada Perusahaan LQ45 Yang Tercatat Di BEI Periode 2018 – 2019. *Ultima Accounting* , 11(2).
- Noori, A., Mohammadi Molgharni, A., & Noravesh, I. (2020). Pedagogical study on the effect of the holy month of Ramadan on the volume of operations and *abnormal returns* in the Iranian capital market. *Apuntes Universitarios*, 11(1), 500–513. <https://doi.org/10.17162/au.v11i1.599>
- Nur Hidayat, Y. S. S., Hasnawati, S., & Hendrawaty, E. (2019). Pengaruh size dan beta terhadap *return* pada perusahaan kecil dan besar yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia periode 2010-2014. *Journal of Business and Banking*, 9(1), 93. <https://doi.org/10.14414/jbb.v9i1.1748>
- Nursita, M. (2021). Pengaruh Laba Akuntansi, Arus Kas Operasi, Arus Kas Investasi, Arus Kas Pendanaan, dan Ukuran Perusahaan Terhadap *Return Saham*. *Going Concern : Jurnal Riset Akuntansi*, 16(1), 1–15.
- Otoritas Jasa Keuangan. (2019). *PASAR MODAL*.
- Özlem, Ş., & Tan, Ö. F. (2018). Ramadan Effect on Stock Markets. *Journal of Research in Business*, 1(3), 77–98. <https://doi.org/10.23892/jrb.2018.23>
- Pratama, A., & Wijaya, C. (2020). The Impact of *Ramadhan effect* On *Abnormal return*. *International Journal of Economics and Management Studies*, 7(4), 213–221. <https://doi.org/10.14445/23939125/ijems-v7i4p126>
- Putri, M. E. K., & Budiasih, I. G. A. N. (2019). Pengaruh Pengungkapan Corporate Social Responsibility Pada *Abnormal return*. *E-Jurnal Ekonomi Dan Bisnis Universitas Udayana* 8.9 , 977–1022.
- Robinson Sihombing, P. (2022). *Aplikasi EVIEWS Untuk Statistisi Pemula Penulis: Penerbit : PT Dewangga Energi Internasional. www.dewanggapublishing.com*

- Rokhim, R., & Octaviani, I. (2020). Is there a *Ramadhan effect* on Sharia mutual funds? Evidence from Indonesia and Malaysia. *International Journal of Islamic and Middle Eastern Finance and Management*, 13(1), 135–146. <https://doi.org/10.1108/IMEFM-04-2019-0147>
- Selvia, & Yumna, A. (2022). Testing the Ramadan Effect on Consumer Goods Industry and Miscellaneous Industry Companies Listed on the Indonesia Stock Exchange (IDX). *Advances in Economics, Business and Management Research*, 222.
- Seto, A. A., Fauzan, R., Santoso, A., Yahya, Dewi, I. D. P., Rahmah, W., Yahya, D., Dewi, C., Hartono, Dasman Sunita, Jumiaty, E., Haryadi, R., & Peristowo, H. (2023). *Teori Portofolio & Analisis Investasi* (R. Ristiyana, Ed.). Global Eksekutif Teknologi.
- Shabila, H. H., Karim, N. K., & Hudaya, R. (2022). Analisis *Abnormal return* dan *Trading volume activity* Sebelum dan Sesudah Pemberlakuan Pembatasan Kegiatan Masyarakat (PPKM) Darurat pada Perusahaan Sektor Transportasi. *Jurnal Risma*, 2(3).
- Simorangkir, R. T. M. C. (2019). Pengaruh Kinerja Keuangan Terhadap *Return Saham* Perusahaan Pertambangan. *Jurnal Bisnis Dan Akuntansi*, 21(2), 155–164. <http://jurnaltsm.id/index.php/JBA>
- Siska, E., & Arigawati, D. (2020). Reaksi *Ramadhan effect* Terhadap Saham Perusahaan Makanan dan Minuman di Indonesia. *Journal of Applied Business and Economics (JABE)*, 6 (4), 330–340.
- Sitoayu, L., Nuzrina, R., & Rumana, N. (2020). *Aplikasi SPSS Untuk Analisis Kesehatan: Bonus Analisis Data dengan SEM*. PT. Nasya Expanding Management.
- Suganda, T. R. (2018). *Event Study Teori dan Pembahasan Reaksi Pasar Modal Indonesia* (S. R. Wicaksono, Ed.). [www.fb.com/cv.seribu.bintang](http://www.fb.com/cv.seribu.bintang)
- Suryanto, & Abdul Muhyi, H. (2017). Analisis Perbandingan Volume Perdagangan Saham Sebelum dan Sesudah Stock Split di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Ilmu Politik Dan Komunikasi*, VII(2).
- Syach Putra Suhendi, K., Desmintari, & Yetti, F. (2021). *Analisis Abnormal return Sebelum Dan Sesudah Ex-Date Dividen Pada Perusahaan IDX30 di BEI*. 2.
- Tandelilin, E. (2010). Dasar-dasar Manajemen Investasi. In *Manajemen Investasi*.

- Winkasari, Q., Soesetio, Y., & Ningsih, L. R. (2019). Analisis *Abnormal return* Saham Bulan *Ramadhan*. *Akuntabel*, 16(1), 2019–2069. <http://journal.feb.unmul.ac.id/index.php/AKUNTABEL>
- Yanti, & Pinondang Dalimunthe, I. (2021). Pengaruh Volume Perdagangan Saham, *Abnormal return* dan Income Smoothing Terhadap Harga Saham. *Competitive Jurnal Akuntansi Dan Keuangan*, 5(1).
- Ying, Q., Yousaf, T., Ain, Q. ul, Akhtar, Y., & Rasheed, M. S. (2019). Stock Investment and Excess Returns: A Critical Review in the Light of the *Efficient Market Hypothesis*. *Journal of Risk and Financial Management*, 12(2), 97. <https://doi.org/10.3390/jrfm12020097>