

## DAFTAR PUSTAKA

- Ghozali, Imam. 2011. "Aplikasi Analisis Multivariate Dengan Program SPSS". Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro
- Jogiyanto, Hartono. 2013. Teori Portofolio dan Analisis Investasi. BPFE
- Tandelilin, Eduardus. (2017). Pasar Modal: Manajemen Portofolio dan Investasi. Yogyakarta: Kanisius.
- Aditha, K. K., & Adiputra, I. M. P. (2020). Analisis Perbedaan Abnormal Return , Trading Volume Activity , Dan Security Return Variability Pada Perusahaan Lq 45 Pra Dan Pasca Pengumuman Kabinet Indonesia Maju Periode 2019-2024. *JIMAT (Jurnal Ilmiah Mahasiswa Akuntansi) Universitas Pendidikan Ganesha*, 11(2).  
<https://ejournal.undiksha.ac.id/index.php/S1ak/article/view/24958>
- Ahmad Taslim, A. W. (2016). Pengaruh Frekuensi Perdagangan Saham, Volume Perdagangan Saham, Kapitalisasi Pasar dan Jumlah Hari Perdagangan Terhadap Return Saham. *Management Analysis Journal*, 5(1), 1–6.  
<https://journal.unnes.ac.id/sju/index.php/maj/article/view/5781/7701>
- Arfani, F. S. (2021). *Analisis Reaksi Pasar Modal Sebelum Dan Saat Peristiwa Pandemi Covid-19 (Event Study pada Perusahaan yang terdaftar LQ-45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2020)* (Vol. 19) [Universitas Muhammadiyah Surakarta.]. [http://eprints.ums.ac.id/88952/1/NASKAH\\_PUBLIKASI.pdf](http://eprints.ums.ac.id/88952/1/NASKAH_PUBLIKASI.pdf)
- Ayu, M. (2013). Pengaruh Kualitas Pengungkapan Informasi Terhadap Volume Perdagangan Saham Dan Return Saham Studi Empiris Pada Perusahaan LQ-45 Di BEI. *Jurnal Akuntansi Dan Keuangan*, 4(2), 1–29.  
<https://doi.org/10.36448/jak.v4i2.415>
- Bajo, E. (2010). The information content of abnormal trading volume. *Journal of Business Finance & Accounting*, 37 (7 & 8): 950-978.  
<https://doi.org/10.1111/j.1468-5957.2010.02197.x>
- Choriliah, S., Sutanto, H. A., & Hidayat, D. S. (2016). Reaksi Pasar Modal Terhadap Penurunan Harga Bahan Bakar Minyak (BBM) Atas Saham Sektor Industri Transportasi di Bursa Efek Indonesia. *Journal of Economic Education*, 5(1), 1–10.  
<https://journal.unnes.ac.id/sju/index.php/jeec/article/view/13011>
- Fama, E.F. (1970). Efficient market hypothesis: A review of theory and empirical work. *The Journal of Finance*, 25: 383-417.  
<https://www.jstor.org/stable/2325486>
- \_\_\_\_\_. (1991). Efficient capital markets II: *The Journal of Finance*, 46: 1575-1617.  
<http://efinance.org.cn/cn/fm/Efficient%20markets%20II.pdf>
- Gumanti, T. A., & Utami, E. S. (2002). Bentuk pasar efisien dan pengujiannya. *Jurnal Akuntansi & Keuangan*, 4(1), 55–69.

<https://media.neliti.com/media/publications/74144-ID-bentuk-pasar-efisiensi-dan-pengujiannya.pdf>

- Harijanto, C. A. (2013). Pengujian Market Efficiency: Pembuktian Fenomena Anomali Pasar Pada Strait Times Index Di Bursa Efek Singapura. *Artikel Ilmiah*, c, 1–10. [http://eprints.perbanas.ac.id/1228/1/ARTIKEL\\_ILMIAH.pdf](http://eprints.perbanas.ac.id/1228/1/ARTIKEL_ILMIAH.pdf)
- Harsono, R.D.B. (2021). Reaksi Pasar Berlebihan Berdekatan dan Pembelajaran di Bursa Efek Indonesia Selama Pandemi COVID-19. *Working Paper*. Pusat Pengkajian dan Pengembangan Manajemen (P3M), Fakultas Ekonomi dan Bisnis, Universitas Katolik Soegijapranata.
- Haryanto. (2020). Dampak Covid-19 terhadap Pergerakan Nilai Tukar Rupiah dan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG). *Jurnal Perencanaan Pembangunan: The Indonesian Journal of Development Planning*, 4(2), 151–165. <https://doi.org/10.36574/jpp.v4i2.114>
- Hidayat, R. (2019). Analisis Perbedaan Abnormal Return Sebelum Dan Sesudah Peristiwa Politik Pada Saham Perusahaan Lq-45 Di Bei. *Jurnal Ilmu Manajemen*, 7(2), 193. <https://doi.org/10.32502/jimn.v7i2.1569>
- Khoiri, H. A., & Arghawaty, E. (2020). Menganalisis Nilai IHSG Beserta Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi di Era Pandemi Covid-19. *Jurnal Riset Akuntansi & Keuangan Dewantara*, 3(2), 110–121. <https://ejournal.stiedewantara.ac.id/index.php/JAD/article/download/677/337>
- Nasution, L. Z. (2020). *Pengaruh Volume Perdagangan Saham, Frekuensi Perdagangan Saham, Volatilitas Harga Saham, Dan Kapitalisasi Pasar Terhadap Return Saham Perusahaan Makanan Dan Minuman Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia*. 1–28. <https://media.neliti.com/media/publications/210728-pengaruh-volume-perdagangan-saham-frekue.doc>.
- Nasution, Y. S. J. (2015). HYPOTHESIS PASAR EFISIEN/EFFICIENT MARKET HYPOTHESIS (Pasar Modal menurut Teori Fama dan Pandangan Islam). *Jurnal Perspektif Ekonomi Darussalam*, 1(1), 25–43. <https://core.ac.uk/download/pdf/297913228.pdf>
- Putra, H. I. M. D., & Putri, I. G. A. M. A. D. (2018). Analisis Reaksi Pasar Sebelum dan Sesudah Pengumuman Kemenangan Donald Trump Menjadi Presiden Amerika Serikat. *E-Jurnal Akuntansi*, 23(1), 406–435. <https://doi.org/10.24843/eja.2018.v23.i01.p16>
- Ristyawati, A. (2020). Efektifitas Kebijakan Pembatasan Sosial Berskala Besar Dalam Masa Pandemi Corona Virus 2019 oleh Pemerintah Sesuai Amanat UUD NRI Tahun 1945. *Administrative Law and Governance Journal*, 3(2), 240–249. <https://doi.org/10.14710/alj.v3i2.240-249>
- Rundengan, J. M., Mangantar, M., Maramis, J. B., & Ratulangi, U. S. (2017). Reaksi Pasar Atas Pelantikan Sri Mulyani Sebagai Menteri Keuangan Pada 27 Juli 2016 (Studi Pada Saham Lq45). *Jurnal EMBA: Jurnal Riset Ekonomi, Manajemen, Bisnis Dan Akuntansi*, 5(3), 2731–2741.

<https://ejournal.unsrat.ac.id/index.php/emba/article/view/17151>

- Siswanto, E., & Setiawan, A. (2019). Aktivitas Volume Perdagangan Abnormal. *Jurnal Aplikasi Bisnis Dan Manajemen*, 5(1), 34–46. <https://doi.org/10.17358/jabm.5.1.34>
- Suhendi, K. S. P., Desmintari, & Yetti, F. (2021). Analisis abnormal return sebelum dan sesudah ex- date dividen pada perusahaan idx30 di bei. *Konferensi Riset Nasional Ekonomi, Manajemen, Dan Akuntansi*, 2, 564–580. <https://conference.upnvj.ac.id/index.php/korelasi/article/download/1197/752>
- Susilo, A., Rumende, C. M., Pitoyo, C. W., Santoso, W. D., Yulianti, M., Herikurniawan, H., Sinto, R., Singh, G., Nainggolan, L., Nelwan, E. J., Chen, L. K., Widhani, A., Wijaya, E., Wicaksana, B., Maksum, M., Annisa, F., Jasirwan, C. O. M., & Yunihastuti, E. (2020). Coronavirus Disease 2019: Tinjauan Literatur Terkini. *Jurnal Penyakit Dalam Indonesia*, 7(1), 45. <https://doi.org/10.7454/jpdi.v7i1.415>
- Wulan, D. C., Handayani, S. R., & Nurlaily, F. (2018). Analisis Abnormal Return Dan Trading Volume Activity Terhadap Pengumuman Unusual Market Activity ( Studi Pada Perusahaan Yang Terdaftar Dalam Pengumuman Unusual Market Activity Di Bei Tahun 2015-2017 ). *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB)*, 61(1), 173–180. <http://administrasibisnis.studentjournal.ub.ac.id/index.php/jab/article/download/2560/2952>
- Yanti, N. P. E. D., Nugraha, I. M. A. D. P., Wisnawa, G. A., Agustina, N. P. D., & Diantari, N. P. A. (2020). Public Knowledge about Covid-19 and Public Behavior During the Covid-19 Pandemic. *Jurnal Keperawatan Jiwa*, 8(4), 491. <https://doi.org/10.26714/jkj.8.4.2020.491-504>
- Zilhada. (2020). Kejadian Luar Biasa COVID-19, Sebuah Tinjauan Literatur Secara Singkat. *Pharmaceutical and Biomedical Sciences Journal*, 2(1), 19–26. <https://id.scribd.com/document/501300964/15456-54980-2-PB>