

DAFTAR PUSTAKA

- A. Ross, S., W. Westerfield, R., & F. Jaffe, J. (2010). *Corporate Finance* (9th ed.). McGraw-Hill Companies.
- Alexander, & Kadafi, M. (2018). Analisis Abnormal Return dan Trading Volume Activity Sebelum dan Sesudah Stock Split pada Perusahaan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Manajemen*.
- Amrillah, M. (2016). Pengaruh Nilai Tukar Rupiah (Kurs), Inflasi dan Pertumbuhan Ekonomi terhadap Return Saham pada Perusahaan Perbankan yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2008-2014. *Jurnal Valuta*.
- Andarini, D. (2016). Analisis Reaksi Pasar Modal Terhadap Perubahan Harga BBM (Event Study Kenaikan dan Penurunan Harga BBM pada Perusahaan Food and Beverages yang Terdaftar di Bursa Efel Indonesia). *Jurnal Ilmiah Mahasiswa FEB Universitas Brawijaya*.
- Antara. (2020, March 02). *IHSG Melemah 1,68 Persen Pasca Indonesia Positif Virus Corona*. Diambil kembali dari <https://www.google.com/amp/s/bisnis.tempo.co/amp/1314535/ihsg-melemah-168-persen-pasca-indonesia-positif-virus-corona>
- Bryman, A. (2012). *Social Research Methods* (4 ed.). New York: Oxford University Press.
- C. Ehrhardt, M., & F. Brigham, E. (2011). *Financial Management: Theory and Practice* (13th ed.). South-western Cengage Learning.
- Chordia, T., Subrahmanyam, A., & Tong, Q. (2014). Have Capital Market Anomalies Attenuated in the Recent Era of High Liquidity and Trading Activity? *Journal of Accounting adn Economics*.
- Fama, E. (1970). Efficient Capital Market: A Review of Theory and Empirical Work. *The Journal of Finance*.
- Fatmawati, S., & Asri, M. (1999). Pengaruh Stock Split terhadap Likuiditas Saham yang Diukur dengan Besarnya Bid-Ask Spread di Bursa Efek Jakarta. *Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia*.

- Firli, A., & Rahadian, D. (2020). Analysis of the Impact of Terrorist Bombing Acts on Abnormal Return and Trading Volume Activity: Study of Terrorist Bombings Worldwide (2008-2017). *International Symposia in Economic Theory and Econometrics*.
- Ghibran, N., Effendy, L., & Lenap, I. (2021). Reaksi Pasar atas Pandemi Virus Corona pada Perusahaan LQ45 di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Bisnis Terapan*.
- Ghozali, I. (2018). *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS 25*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Gozali, L. (2020, November 27). *Laporan Informasi Pembagian Dividen Interim Tahun Buku 2020*. Diambil kembali dari <https://www.kalbe.co.id/id/investor/informasi-investor/ArtMID/797/ArticleID/872/Laporan-Informasi-Pembagian-Dividen-Interim-Tahun-Buku-2020>
- Hartono, J. (2017). *Teori Portofolio dan Analisis Investasi* (10 ed.). Yogyakarta: BPFE.
- Irawan, W., Hadiprajitno, J., & Hersugondo, H. (2021). Reaksi Pasar Modal Indonesia Terhadap Peristiwa Pengumuman PSBB DKI Jakarta (Studi Kasus pada Jakarta Islamic Index (JII) yang terdaftar dalam Bursa Efek Indonesia). *Jurnal Ilmiah Ekonomi dan Bisnis*.
- Kuntjojo. (2009). *Metodologi Penelitian*. Kediri: Universitas Nusantara PGRI.
- Kusumawati, S., & Wahidahwati. (2021). Dampak Diumumkannya Kasus COVID-19 serta Kebijakan Ner Normal terhadap Perubahan Harga dan Volume Perdagangan Saham. *Jurnal Ilmu dan Riset Akuntansi*.
- Lee, M., & Setiawati, L. (2021). Analisa Dampak Pengumuman Covid-19 di Indonesia Tahun 2020 terhadap Abnormal Return dan Trading Volume Activity Event Study pada Perusahaan LQ45 di BEI. *Jurnal Indonesia Sosial Teknologi*.
- Lestari, M., & Suaryana, I. (2020). Pengaruh Nilai Tukar terhadap Return Saham dengan Profitabilitas sebagai Variabel Intervening. *E-Jurnal Akuntansi*.
- M. Al-Awadhi, A., Alsaifi, K., Al-Awadhi, A., & Alhammadi, S. (2020). Death and Contagious Infectious Diseases: Impact of the COVID-19 Virus on Stock Market Return. *Journal of Behavioral and Experimental Finance*.

- M. Welley, M., N. S. Oroh, F., & B. Walangitan, M. D. (2020). Perbandingan Harga Saham Perusahaan Farmasi BUMN Sebelum dan Sesudah Pengembangan Vaksin Virus Corona (COVID-19). *Jurnal Ilmiah Manajemen Bisnis dan Inovasi Universitas Sam Ratulangi (JMBI UNSRAT)*.
- Malkiel, B. (t.thn.). The Efficient Market Hypothesis and Its Critics. *Journal of Economic Perspectives*, 17, 29-82.
- Munawarah. (2009). Analisis Perbandingan Abnormal Return dan Trading Volume Activity Sebelum dan Sesudah Suspend BEI (Studi Kasus pada Saham LQ-45 di BEI periode 6-15 Oktober 2008). *Magister Manajemen Universitas Diponegoro*.
- Muthaharia, S., & Yunita, I. (2021). Analysis of Abnormal Return dan Trading Volume Activity Difference Before and After the Announcement of New Normal Implementation by President Joko Widodo : Study on LQ45 in the Indonesia Stock Exchange. *International Journal of Advanced Research in Economics and Finance*.
- Nur Alifah, F., & Yunita, I. (2021). Capital Market Reaction to The Announcement of COVID-19 Vaccine Clinical Test by PT. Bio Farma Indonesia: Case Study of Pharmaceutical Sub-Sector Listed on The IDX 2020. *International Journal of Advanced in Economics and Finance*.
- Nuraini, R. (2020, Maret 02). *Kasus Covid-19 Pertama, Masyarakat Jangan Panik*. Diambil kembali dari <https://indonesia.go.id/narasi/indonesia-dalam-angka/ekonomi/kasus-covid-19-pertama-masyarakat-jangan-panik>
- Pujawati, P., Wiksuana, I., & Artini, L. (2015). Pengaruh Nilai Tukar Rupiah terhadap Return Saham dengan Profitabilitas sebagai Variabel Intervening. *E-Jurnal Ekonomi dan Bisnis Universitas Udayana*.
- R. Cooper, D., & S. Schindler, P. (2003). *Business Researc Methods* (8 ed.). New York: McGraw-Hill.
- Rahim, R., Sulaiman, D., Husni, T., & Wiranda, N. (2021). Investor Behaviour Responding to Changes in Trading Halt Conditions: Empirical Evidence from the Indonesia Stock Exchange. *Journal of Asian Finance, Economics and Business*.
- Rahmayani, D., & Oktavilia, S. (2020). Does the Covid-19 Pandemic Effect the Stock Market in Indonesia? *Jurnal Ilmu Sosisal dan Ilmu Politik*.

Research, Z. (2020). *Stock Market News*. Diambil kembali dari Yahoo Finance: finance.yahoo.com

Saraswati, N., & Mustanda, I. (2018). Reaksi Pasar Modal Indonesia terhadap Peristiwa Pengumuman Hasil Perhitungan Suara Pemilihan Umum dan Pelantikan Presiden Amerika Serikat. *E-Jurnal Manajemen Unud*.

Schell, D., Wang, M., & Huynh, T. (2020). This Time is Indeed Different: A Study on Global Market Reactions to Public Health Crisis. *Journal of Behavioral and Experimental Finance*.

Sekaran, U. (2003). *Research Methods for Business: A Skill-Building Approach* (4 ed.). New York: John Wiley & Sons.

Setyawasih, R. (2007). Studi Tentang Peristiwa (Event Study) : Suatu Panduan Riset Manajemen Keuangan di Pasar Modal. *Jurnal Optimal*.

Subekti, S., & Rahmawati, I. (2020). Reaksi Pasar Modal dari Dampak Peristiwa Hari Besar Agama Islam Terhadap Abnormal Return dan Trading Volume Activity Saham Perusahaan JII yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Manajemen Universitas Bung Hatta*.

Subrata, K., & Werastuti, D. (2020). Analisis Reaksi Pasar terhadap Penetapan Status Darurat Global ke Level Tertinggi Terkait Firus Corona oleh WHO (World Health Organization) pada Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Ilmiah Mahasiswa Akuntansi*.

Sukirno, S. (2003). *Pengantar Teori Mikroekonomi*. Jakarta: Grafindo.

Susesti, D., & Wahyuningtyas, E. (2021). Pendapatan Saham Abnormal pada Masa Tidak Pandemi dan Pandemi Covid-19 : Studi pada Subsektor Farmasi dan Telekomunikasi. *Accounting and Management Journal*.

Syahrum, & Salim. (2012). *Metodologi Penelitian Kuantitatif*. Bandung: Citapustaka Media.

Talumewo, C., Rate, P., & Untu, V. (2021). Reaksi Pasar Modal Indonesia Sebelum dan Sesudah Pengumuman Pemberlakuan New Normal (Event Study pada Perusahaan BUMN yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia). *Jurnal EMBA*.

Tandelilin, E. (2017). *Pasar Modal Manajemen Portofolio dan Investasi*. Penerbit PT KANISITUS .

- Tari, D., & Elena, M. (2020, December 07). *Vaksin Corona Bikin IHSG Melesat 2 Persen, Saham Farmasi Meriah*. Diambil kembali dari <https://www.google.com/amp/s/m.bisnis.com/amp/read/20201207/7/1327432/vaksin-corona-bikin-ihsg-melesat-2-persen-saham-farmasi-meriah>
- Teall, J. (2018). *Financial Trading and Investing* (2nd ed.). Academic Press.
- Titan, A. (2015). The Efficient Market Hypothesis: Review of Specialized Literature and Empirical Research. *Procedia Economics and Finance*.
- Triono, B., Hendrayati, S., Fauziyanti, W., & Estuti, E. (2021). Comparative Analysis of Trading Volume Activity During Covid-19. *Jurnal STIE Semarang*.
- Umar, H. (2011). *Metode Penelitian untuk Skripsi dan Tesis*. Jakarta: Rajawali Pers.
- Vaksin Telah Tiba, Hatiku Gembira*. (2020, December 06). Diambil kembali dari <https://covid19.go.id/artikel/2020/12/06/vaksin-telah-tiba-hatiku-gembira>
- Wikan Kinasih, H., & Fadil Laduny, M. (2020). Analisis Komparatif Abnormal Return, Cumulative Abnormal Return dan Trading Volume Activity: Event Study Kedatangan Vaksin Sinovac. *Ekuivalensi*.
- Xia, Y., & Hu, W. (2021). Impact of COVID-19 Attention on Pharmaceutical Stock Prices Based on Interbnet Search Data. *Acta Scientific Pharmaceutical Sciences*.
- Xu, L. (2021). Stock Return and the COVID-19 pandemic: Evidence from Canada and the US. *Finance Research Letters*.
- Zeng, H., Dong, B., Zhou, Q., & Jin, Y. (2021). The Capital Market Reaction to Central Environmental Protection Inspection: Evidence from China. *Journal of Cleaner Production*.
- Zhang, Y., & Liu, H. (2021). Stock Market Reactions to Social Media: Evidence from WeChat Recommendations. *Physica A*.