

DAFTAR PUSTAKA

- _____. “*Jakarta Islamic Indeks*”, Senin, 29 Mei 2006. Republika Online, www.republika.co.id
- Al-Qur’an, *Surah As- Sad:24*
- Aliman. 2000. “*Modul Ekonometrika Terapan*.” PAU Studi Ekonomi Universitas Gajah Mada. Yogyakarta.
- Aruzzi, M. Iqbal, dan Bandi. 2003. “*Pengaruh Tingkat Suku Bunga, Rasio Profitabilitas, dan Beta Akuntansi Terhadap Beta Saham Syariah di Bursa Efek Jakarta*.” Jurnal Simposium Nasional Akuntansi VI.
- Bapepam. 2007. “*Keputusan Ketua Badan Pengawas Pasar Modal dan Lembaga Keuangan Nomor: KEP-325/BL/2007 tentang Daftar Efek Syariah*.” Bapepam – Depkeu. Jakarta.
- Dedy. 2007. “*Risk and Return Reksa Dana Saham*.” Laman News Ekonomi dan Bisnis. Senin, 06/08/2007. Koran SINDO Online. [www.seputar-indonesia.com/edisi cetak/](http://www.seputar-indonesia.com/edisi_cetak/)
- Engle, R. T. and C. W. J. Granger .1987. “*Cointegration and Error Correction: Representation, Estimation and Testing*.” *Econometrica* 55, 251-276.
- Fulks, Bob. 1998. “*The Sharpe Ratio*.” Torna Alla Homepage.
- Gamal, Merza. 2005. “*Management Dana Syariah*.” Presentasi Manajemen, Bank Syariah Mandiri. Jakarta.
- Granger, C. W. J. 1988. “*Some Recent Development in the Concept of Causality*.” *Journal of Econometrics* 16, 199-211.
- Granger, C.W.J., and P. Newbold. 1974, “*Spurious Regressions in Econometrics*,” *Journal of Econometrics*, 2, hal. 111 – 120.
- Gujarati, D.N. 1995. “*Bank Econometric, 3rd Edition*”. Mc Graw-Hill Inc. London. <http://www.w3.org/TR/REC-html40>
- Habib, Moch. Ludfi. 2007. “*Analisa Pengaruh Tingkat Bunga SBI, Dan Nilai Kurs Dollar AS Terhadap Volume Perdagangan Saham. Studi di Bursa Efek Jakarta, Periode Tahun 2003 – 2005*.” Skripsi. Tidak Dipublikasikan, Fakultas Ekonomi Universitas Brawijaya, Malang.

- Hakim, Sam dan Manochehr Rashidian. 2002. *“Risk & Return of Islamic Stock Market Indexes.”* Dept of Finance, Seaver College of Business, Pepperdine University, Malibu, CA and Energetix LLP, Los Angeles, CA USA.
- Hamzah, Ardi dan Auliyah Robiyatul. 2006. *“Analisa Karakteristik Perusahaan, Industri dan Ekonomi Makro terhadap Return dan Beta Saham Syariah di Bursa Efek Jakarta.”* Jurnal Simposium Nasional Akuntansi IX. Padang.
- Harahap, Sofyan S. 2001. *“Menuju Perumusan Teori Akuntansi Islam.”* Cetakan Pertama, Pustaka Quantum.
- Hardianto, Erwin. 2005. *“Mekanisme Transmisi Syariah di Indonesia.”* Jurnal Ekonomi Universitas Airlangga. Surabaya.
- Harliyani. 2006. *“Hubungan IHSI dengan Indeks Saham Negara Lingkar Pasifik Periode 2001 – 2005.”* www.youngstatistician.com
- Husnan, Suad & Pudjiastuti. Enny. 1998. *“Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas.”* Edisi 2. UPP AMP YKPN, Yogyakarta.
- Husnan, Suad. 2003. *“Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas, Edisi Ketiga.”* UPP AMP YKPN. Yogyakarta.
- Insukindro. 1991. *“Regresi Linier Lancung dalam Analisis Ekonomi: Suatu Tinjauan dengan Satu Studi Kasus di Indonesia.”* Jurnal ekonomi dan Bisnis Indonesia, Vol. 6, No.1, hal. 75 - 88.
- Irawan, Andi. 2005. *“Analisis Perilaku Instabilitas, Pergerakan Harga, Employment, dan Investasi di dalam Sektor Pertanian Indonesia: Aplikasi Vector Error Correction Model.”* Jurnal Ekonomi IPB. Bogor
- Johansen, S. and K. Juselius .1990. *“Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration with Application to the Demand for Money.”* *Oxford Bulletin of Economics and Statistics* 52, 169-210.
- Johansen, S. 1988. *“Statistical Analysis of Cointegrating Vectors.”* Journal of Economic Dynamics and Control, 12(2): 131-154.
- Kesuma, Aditya. 2006. *“Pengaruh Earning Per Share (EPS) dan Tingkat Bunga Terhadap Harga Saham (Studi Empiris Pada Perusahaan Food And Beverage Yang Terdaftar di Bursa Efek Jakarta).”* Skripsi. Tidak Dipublikasikan, Fakultas Ekonomi Universitas Brawijaya, Malang.
- Madura, Jeff. 1997. *“Manajemen Keuangan Internasional.”* Edisi Keempat, Erlangga. Jakarta.

- Miskhin, Frederic, 1995. *“Financial Markets Institutions and Money.”* Harper Collins College. New York.
- Muflihah, Nafisatul. 2007. *“Analisis Suku Bunga, PDB, dan Nilai Tukar Sebagai Determinan Investasi di Indonesia (Studi Kasus: 1999:1-2006:3).”* Skripsi Fakultas Ekonomi Universitas Brawijaya Malang.
- Mulyono, Sri. 2000, *“Peramalan Bisnis dan Ekonometrika,”* Edisi Pertama, Yogyakarta: BPFE.
- Mulyono, Sugeng. 2000. *“Pengaruh Earning Per Share (EPS) dan Tingkat Bunga Terhadap Harga Saham.”* Jurnal Ekonomi dan Manajemen. Vol. 1 No. 2. Pascasarjana Universitas Gajayana, Malang
- Nopirin. 1993. *“Ekonomi Moneter.”* Edisi 4. BPFE- UGM, Yogyakarta.
- Purbayu, Budi Santosa, Dr, MS dan Ashari, SE, Akt. 2005. *“Analisis Statistik dengan Microsoft Excel & SPSS.”* Penerbit ANDI. Yogyakarta.
- Rini. 2007. *“Indeks BEJ.”* www.Vibiznews.com
- Sinungan, M. 1992. *“Manajemen Dana Bank. Edisi Ketiga.”* Cetakan Kelima. Bumi Aksara. Jakarta.
- Sugema, I. 1992. *“The Dynamic of Macroeconomy-Trade-Agriculture Linkages in The Australian Economy: An Application of Error Correction Model to Cointegrated Relation Ship.”* The University of New England. Thesis S2. Department of Agricultural Economic and Business Management, New England.
- Sunariyah. 2004. *“Pengantar Pengetahuan Pasar Modal.”* UPP AMP YKPN, Yogyakarta.
- Syuhada, Luqman H., Lc. 2007. *“Ekonomi Islam Melawan Riba dan Kemiskinan Umat.”*. Makalah Diskusi Ekonomi Syari’ah, Sragen, Jawa Tengah .
- Wahyudi, Sugeng, *“Saham Pilihan Kelompok LQ 45”*. Suara Merdeka, Selasa 4 Mei 2004.
- West, Andrew. 1998. *“Do Stock Index Futures Prices Lead The Stock Index?.”* SIRCA. Australia.
- Wondabio, Ludovicus Sensi. 2006. *“Analisa Hubungan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Jakarta (JSX), London (FTSE), Tokyo (Nikkei) dan Singapura (SSI), Pendekatan Model Ekonometri – Autocorrelation Condition Heteroscedasticity (ARCH) / Generalized Autocorrelation*

Condition Heteroscedasticity (GARCH) dan Vector Autoregression (VAR) – Suatu Studi Empiris tahun 2000 – 2005.” Jurnal Simposium Nasional Akuntansi IX. Padang.

www.bi.go.id

www.jsx.go.id