

DAFTAR PUSTAKA

- Abduh, Muhamad. 2012. "Peran Pasar Modal Syariah terhadap Pertumbuhan Ekonomi." *Iqtishodia Jurnal Ekonomi Islam Republika*, 28 Juni 2012, h.26. Diakses tanggal 13 Juli 2015.
- Badan Pusat Statistik. 2015. Data Ekspor Januari 2004 sampai Desember 2014. Diakses dari www.bps.go.id tanggal 5 Maret 2015.
- _____. 2015. Data Jumlah Uang Beredar Januari 2004 sampai Desember 2014. Diakses dari www.bps.go.id tanggal 30 Juni 2015.
- _____. 2015. Data Indeks Harga Konsumen (IHK) Januari 2004 sampai Desember 2014. Diakses dari www.bps.go.id tanggal 28 Juli 2015.
- _____. 2015. Data Angka Kedatangan Turis Asing Januari 2004 sampai Desember 2014. Diakses dari www.bps.go.id tanggal 29 Juli 2015.
- _____. 2015. Data Indeks Produksi Industri (IPI) Januari 2004 sampai Desember 2014. Diakses dari www.bps.go.id tanggal 2 Agustus 2015.
- Bank Indonesia. 2015. Data *Retail Sales* Bulan Januari 2004 sampai Desember 2014. Diakses dari www.bi.go.id tanggal 3 Juni 2015.
- _____. 2015. Data Kurs Jual dan Kurs Beli Bulan Januari 2004 sampai Desember 2014. Diakses dari www.bi.go.id tanggal 9 Juni 2015.
- Birz, Gene dan John R. Lott, Jr. 2008. "The Effect of Macroeconomic News on Stock Returns: New Evidence from Newspaper Coverage." *Journal of Banking & Finance*, h.n.p <http://citeseerx.ist.psu.edu>. Diakses tanggal 8 Juni 2015.
- Bodie, Zvi, Alex Kane, dan Alan J. Marcus. 2006. *Investment* (terj), Zualini Dalimunthe. Jakarta: Salemba Empat.
- Burgstaller, Johann. 2002. "Are stock returns a leading indicator for real macroeconomics developments?". Working Paper No. 0207 Juli 2002. Johannes Kepler University of Linz. Department of Economics. Austria.
- Bursa Efek Indonesia. 2014. Data Saham *Jakarta Islamic Index (JII)* Januari 2004 sampai 2014. Diakses dari www.idx.co.id tanggal 17 Desember 2014.
- Chen, Nai-Fu, Richard Roll dan Stephen A. Ross. 1986. "Economic Forces and the Stock Market." *The Journal of Business*, Vol. 59, No.3 (Jul.,1986), h.383-403. Diakses dari <http://rady.ucsd.edu> tanggal 17 Desember 2014.

- Chen, Ren-Raw dan Louis Scott. 1993. "Multi-Factor Cox-Ingersoll-Ross Models of The Term Structure: Estimate and Test from a Kalman Filter Model." Diakses dari <http://citeseerx.ist.psu.edu> tanggal 17 Desember 2014.
- Dornbusch, Rudiger dan Stanley Fischer. 1997. *Makroekonomi*. Jakarta: Erlangga.
- Fama, Eugene F. dan G. William Schweet. 1977. "Asset Return and Inflation," *Journal of Financial Economics* 5 (1977), h.115-146, North-Holland Publishing Company. Diakses dari <http://schwert.ssb.rochester.edu> tanggal 17 Desember 2014.
- Faruque, Muhammad Umar. 2011. "An Empirical Investigation of the Arbitrage Pricing Theory in a Frontier Stock Market: Evidence from Bangladesh." Munich Personal RePEc Archive, No. 38675. Diakses dari mpra.ub.uni-muenchen.de pada tanggal 1 April 2015.
- Fisher, Irving. 1930. *The Theory of Interest*. New York: The Macmillan Co, Diakses 15 September 2015 dari Library Economics Liberty.
- Ghozali, Imam. 2011. *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program IBM SPSS19*. Edisi 5. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.
- Gujarati, Damodar. 2005. *Basic Econometrics* (terj.). Sumarno Zain. Jakarta: Erlangga
- Hartono, Jogiyanto. 2010. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Yogyakarta: BPFE.
- Hengchao, Zhang dan Zarinah Hamid. 2010. "The Impact of Subprime Crisis on Asia-Pacific Islamic Stock Markets." International Conference on Islamic Economics and Finance, 8th, h.n.p, <http://conference.qfis.edu.qa>. Diakses tanggal 19 Desember 2015.
- Hirschey, Mark dan John Nofsinger. 2008. *Investment: Analysis and Behavior*. New York: The McGraw-Hill.
- Husnan, Suad. 2003. *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: UPP AMP YKPN.

- Hussin, Mohd Yahya Mohd, Fidlizan Muhammad, Mohd Fauzi Abu, dan Salwah Amirah Awang. 2012. "Macroeconomic Variables and Malaysian Islamic Stock Market: A Times Series Analysis". *Journal of Business Studies Quarterly*, Vol. 3, No. 4, pp.1-13.
- Ismail, Rifki. 2012. "Peran Sektor Moneter dalam Sistem Ekonomi Islam," Publikasi Departemen Perbankan Syariah Bank Indonesia. Diakses tanggal 7 Juli 2015.
- Istiqomah dan Irfan Syauqi Beik. 2012. "Responsivitas Kebijakan Moneter terhadap Bursa Syariah." *Iqtishodia Jurnal Ekonomi Islam Republika*, 26 April 2012, h.23. Diakses tanggal 13 Juli 2015.
- Khoo, Adam, Conrad Alvin Lilm, dan Ryan Huang. 2015. *Profit from The Panic*. Jakarta: PT Elex Media Komputindo.
- Kuncoro, M. 1996. *Manajemen Keuangan Internasional: Pengantar Ekonomi dan Bisnis Global*. Yogyakarta: BPFPE.
- Kusuma, Wira, Ndari Surjaningsih dan Benny Siswanto. 2004. "Leading Indikator Investasi Indonesia dengan Menggunakan Metode OECD." *Buletin Ekonomi dan Perbankan*, Maret 2004. Diakses tanggal 3 Juli 2015 dari Bank Indonesia.
- Lim, Christine dan Felix Chan. 2013. "An Empirical Modelling of New Zealand Hospitality and Tourism Stock Returns." *ISRN Economics* Vol. 2013. No. 289718. Diakses tanggal 11 Juni 2015 dari Hindawi Publishing Corporation.
- Majid, M. Shabri Abd. dan Rosylin Mohd. Yusof. 2009. "Long-run Relationship between Islamic Stock Return and Macroeconomic Variables". *Humanomics*, Vol. 25 No. 2, pp. 127-141.
- Mankiw, N. Gregory. 2007. *Makroekonomi*. (Terj.). Fitria Liza dan Imam Nurmawan. Jakarta: Erlangga.
- Maskay, Biniv. 2007. "Analyzing the Effect of Change in Money Supply on Stock Prices." *Jurnal The Park Place Economist*, Vol.XV, pp. 72-79.

- Muharam, Harjum dan Zuraedah Nurafni MS. 2008. "Analisis Pengaruh Nilai Tukar Rupiah dan Indeks Saham Dow Jones Industrial Average terhadap Indeks Harga Saham Gabungan Di BEJ." *Jurnal MAKSI* Vol. 8, No. 1 Januari, page: 24-42.
- Nafik, Muhamad. 2009. *Bursa Efek & Investasi Syariah*. Jakarta: PT Serambi Ilmu Semesta.
- Nafisah, Irfani. 2013. "Pengaruh Nilai Tukar, Cadangan Devisa, dan Ekspor Bersih, terhadap Perubahan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)." Skripsi tidak dipublikasikan. Universitas Gunadarma.
- Naseri, Marjan dan Mansur Masih. 2013. "Causality between Malaysian Islamic Stock Market and Macroeconomic Variables." *Munich Personal RePEc Archive*, No. 60247. Diakses dari mpra.ub.uni-muenchen.de pada tanggal 1 April 2015.
- Nopirin. 2000. *Ekonomi Moneter*. Yogyakarta: BPF.
- Pilinkus, Donatas. 2009. "Stock Market and Macroeconomic Variables: Evidences from Lithuania." *Economics & Management*: 2009:14, h.n.p. Diakses tanggal 15 Juni 2015 dari <http://socsc.ktu.lt>, Kaunas University of Technology.
- Rachman, Paloma Paramita. 2012. "Analisis Pengaruh Variabel Makro terhadap Return Indeks Sembilan Sektor pada Bursa Efek Indonesia." Master Tesis, Universitas Indonesia.
- Ross, A Stephen. 1976. The Arbitrage Pricing Theory of Capital Asset Pricing Theory. "Journal of Economic Theory". Vol. 13, No. 3.
- Ross, A. Stephen, Westerfield W. Roudolp, dan Jaffe Jeffrey. 2003. *Corporate Finance*, Sixth Edition, New Jersey: Mc-Graw Hill, diakses 2 Desember 2014, dari Bookfi.org
- Salvatore, Dominick. 1997. *Ekonomi Internasional* (Terj.). Haris Munandar. Jakarta: Erlangga.
- Samsul, Mohamad. 2006. *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Erlangga.

- Samuelson, Paul A. dan William D. Nordhaus. 2004. *Ilmu Makroekonomi*. Jakarta: PT Media Global Edukasi.
- Sekaran, Uma. 2006. *Research Methods for Business Metodologi Penelitian untuk Bisnis* (terj.). Edisi 4. Kwan Men Yon. Jakarta: Salemba Empat.
- Sharpe, William F., Alexander Gordon J., dan Jeffery V. Bailey. 1997. *Investment* (terj), Henry Njooliangtik dan Agustino. Jakarta: Prenhallindo.
- Sirucek. 2012. "Macroeconomic Variable and Stock Market: US Review." MPRA Paper No. 39094, Mei 2012. Diakses dari <http://mpa.ub.uni-muenchen.de>.
- Sugiyono. 2007. *Metode Penelitian Bisnis*. Jakarta: Alfabeta.
- Sukirno, Sadono. 2010. *Teori Pengantar Makroekonomi*. Edisi 3. Jakarta: PT RajaGrafindo Persada.
- Sumartini, Ade. 2012. "Pengaruh Coincident Economic Indicator dan Leading Economic Indicator terhadap Return Saham (Studi terhadap Indeks Harga Saham Gabungan di Bursa Efek Indonesia periode 2003-2011)". *Diponegoro Business Review*, Vol. 1, No. 1, pp. 1-11.
- Sunariyah. 2004. *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*. Edisi 4. Yogyakarta: UPP AMP YKPN.
- Tandelilin, Eduardus. 2001. *Portofolio dan Invetsasi Teori dan Aplikasi*. Yogyakarta: Kanisius.
- Vejzagic, Mirza dan Hashem Zarafat. 2013. "Relationship Between Macroeconomic Variables and Stock Market Index: Co-integration Evidence from FTSE Bursa Malaysia Hijrah Shariah Index". *Asian Journal of Management Sciences & Education*, Vol. 2, No.4, pp. 94-107.
- Winarti, Endra. 2013. "Analisis Pengaruh Perubahan Suku Bunga SBI, Harga Emas Dunia, Harga Minyak Dunia, Nilai Tukar Rupiah, Tingkat Inflasi, Indeks Produksi Industri, dan Jumlah Uang Beredar terhadap *Return Saham Jakarta Islamic Index (JII)*". *Skripsi tidak dipublikasikan*. Universitas Indonesia, Jakarta.