

DAFTAR PUSTAKA

- Abdalla, I.S dan Murinde, V. 1997. *Exchange Rate and Stock Price Interactions in Emerging Financial Markets: Evidence on India, Korea, Pakistan and Philippines*. Applied Financial Economics, Vol.7, 25-35.
- Ajija, Shochrul R. et al. 2011. *Cara Cerdas Menguasai Eviews*. Jakarta: Salemba Empat.
- Akbar, Putra Perdana. 2008. *Volatility Shock Persistence Pada Single Index Model Dari Sembilan Indeks Sektoral dan LQ\$ Periode 2002-2006*. Universitas Indonesia
- Ang, Robert. 1997. *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia*. Jakarta: Mediasoft Indonesia. Jakarta.
- Badan Pusat Statistik. 2015. *Statistik Indonesia 2014*. Jakarta.
- Badan Pusat Statistik. 2015. *Statistik Perdagangan Luar Negeri Indonesia (Ekspor) 2014*. Jakarta.
- Badan Pusat Statistik. 2015. *Statistik Perdagangan Luar Negeri Indonesia (Impor) 2014*. Jakarta.
- Bursa Efek Indonesia. *JSX Monthly Statistics 2006-2014*. Jakarta.
- Bursa Efek Indonesia. 2012. *Sekolah Pasar Modal Level 1*. Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Bursa Efek Indonesia. 2010. *Buku Panduan Indeks Harga Saham Bursa Efek Indonesia*. Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Bank Indonesia. 2015. *Laporan Kebijakan Moneter 2014*. Departemen Riset Ekonomi dan Kebijakan Moneter. Jakarta.
- Bank Indonesia. 2015. *Tinjauan Kebijakan Moneter (Ekonomi, Moneter dan Keuangan) 2014*. Jakarta.
- Bank Indonesia. 2015. *Kajian Stabilitas Keuangan 2014*. Departemen Penelitian dan Pengaturan Perbankan. Jakarta.
- Bank Indonesia. 2015. *Laporan Perekonomian Indonesia 2014*. Jakarta.
- Bank Indonesia. 2015. *Laporan Neraca Pembayaran 2014*. Departemen Statistik. Jakarta.

- Bernanke, Ben S. dan Kenneth N. Kuttner. 2004. *What Explains the Stock Market's Reaction to Federal Reserve Policy*. Federal Reserve Bank of New York. Staff Report No.174. Available: www.federalreserve.gov.
- Bodie, Kane dan Marcus. 2014. *Manajemen Portofolio dan Investasi*. Jakarta: Salemba Empat.
- Case, Karl E dan Ray C Fair. 2007. *Prinsip-Prinsip Ekonomi Jilid 2*. Jakarta: Erlangga.
- Chan, K and Fong W. 2000. *Trade Size, Order Imbalance, and The Volatility Volume Relation*, *Journal of Financial Economics* 57, 247 – 273.
- Christiawan, Alexander Hery. 2010. *Analisis Pengaruh Kondisi Makro Ekonomi Amerika Serikat dan Harga Minyak Dunia terhadap Dow Jones Industrial Average serta Pengaruh Kondisi Makro Ekonomi Indonesia, Harga Minyak Dunia dan Dow Jones Industrial Average terhadap Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2002-2009*. Tesis Universitas Diponegoro.
- Darmadji, Tjiptono dan Hendy M Fakhruddin. 2001. *Pasar Modal Indonesia: Pendekatan Tanya Jawab*. Jakarta: Salemba Empat.
- Firmansyah, Erry. 2010. *Metamorfosa Bursa Efek*. Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Firmansyah. 2006. *Analisis Volatilitas Harga Kopi Internasional*. Jakarta: Usahawan.
- Firmansyah. *Modul Pelatihan Metodologi Penelitian untuk Bisnis-DIES ke-54 FEB UNDIP: Model ARCH dan GARCH dengan EViews 8.0*. Fakultas Ekonomika dan Bisnis. Universitas Diponegoro.
- Ibrahim, Mansor H. 2000. Cointegration and Granger Causality Test of Interaction in Malaysia. *Asian Economic Bulletin*. Vol 17. Hal 36-47.
- Ghozali, Imam. 2011. *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS*. Semarang: BP UNDIP.
- Gujarati, Damodar. 2014. *Ekonometrika Dasar Buku 1*. Jakarta: Erlangga.
- Gujarati, Damodar. 2014. *Ekonometrika Dasar Buku 2*. Jakarta: Erlangga.
- Harianto, Farid dan Siswanto Sudomo. 2001. *Perangkat dan Teknik Analisis Investasi di Pasar Modal Indonesia*. Jakarta: Bursa Efek Jakarta.
- Hayo, Bernd and Ali M.Kutan. 2004. *The Impact of News, Oil Prices and Global Market Developments on Russian Financial Markets*. William Davidson Institute Working Paper Number 656. Available: www.ideas.repec.org.
- Horne, James C Van dan John M Wachowicz. 2010. *Fundamentals of Financial Management*. Jilid 2. Jakarta: Salemba Empat.

- Jones, Charles P. 2000. *Investment: Analysis and Management*. 7th edition. John Willey & Sons.Inc.
- Kementerian Keuangan Republik Indonesia. 2011. *Volatilitas Pasar Modal Indonesia dan Perekonomian Dunia*. Badan Pengawas Pasar Modal dan Lembaga Keuangan. Jakarta.
- Killian Lutz dan Cheolbeom Park. 2007. *The Impact of Oil Price Shock on The U.S. Stock Market*. Available: www.ideas.repec.org.
- Kontan. Kompas Gramedia. Majalah edisi September 2014.
- Kuncoro, Mudrajad. 2004. *Metode Kuantitatif*. Yogyakarta: UPP AMP YKPN.
- Lawrence, Steven Sugiarto. *Pengaruh Variabel Makro Ekonomi dan harga Komoditas Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan di Indonesia*. FINIESTA. Vol.1 No.2: 18-23. Universitas Kristen Petra.
- Liow, Kim Hiang dan Mong Chuan Sim. *The Risk And Return Profile Of Asian Real Estate Stock*. Pacific Rim Property Research Journal. Vol.12 No. 3. National University of Singapore.
- Muharam, Harjum dan Zuraedah Nurafni MS. 2008. *Analisis Pengaruh Nilai Tukar Rupiah Dan Indeks Dow Jones Industrial Average Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan Di BEJ*. Jurnal MAKSI Vol 8 No 1 Januari 2008 : 24-42. Universitas Diponegoro.
- Pasaribu, Rowland Bismark Fernando dan Dionysia Kowanda. *Dinamika Bursa Saham Asing dan Makroekonomi Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan Bursa Efek Indonesia*. Jurnal Akuntansi dan Bisnis. Vol.14 No.1: 89-112. Universitas Gunadarma. Available: www.fe.uns.ac.id.
- Prasetyantoko, A. 2008. *Bencana Finansial Stabilitas sebagai Barang Publik*. Jakarta: Kompas Gramedia.
- Reilly, Frank K and Keith C Brown. 2000. *Investment Analysis & Portofolio*. Australia: Thomson South-Western.
- Rohmanda, Deny. Suhadak dan Topowijono. 2014. *Pengaruh Kurs Rupiah, Inflasi dan BI Rate Terhadap Harga Saham*. Universitas Brawijaya. Jurnal Administrasi Bisnis (JAB) Vol.13 No.1. Available: administrasibisnis.studentjournal.ub.ac.id.
- Rusbariand, dkk. 2012. *Analisis Pengaruh Tingkat Inflasi, Harga Minyak Dunia, Harga Emas Dunia dan Kurs Rupiah Terhadap Pergerakan Jakarta Islamic Index di Bursa Efek Indonesia*. Prosiding Seminar Nasional. Forum Bisnis & Keuangan I. Universitas Gunadarma.
- Salvatore, Dominic. 2013. *International Economics*. Eleventh Edition. United States of America: John Willey & Sons.Inc.

- Samsul, Mohammad. 2006. *Pasar Modal Dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Erlangga.
- Shapiro, Alan C. 2003. *Multinational Financial Management*. Sevent Edition. United States of America: John Wiley & Sons.
- Smith, C. 1992. *Stock Markets and Exchange Rates:A-Multy Country Approach*, Journal of Macroeconomics, 14, 607-629.
- Sukirno, Sadono. 2004. *Makroekonomi Teori Pengantar*. Jakarta: PT Raja Grafindo Persada.
- Sunariyah. 2000. *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*. Yogyakarta: UPP AMP YKPN.
- Suyanto. 2007. *Analisis Pengaruh Nilai Tukar Uang, Suku Bunga dan Inflasi Terhadap Return Saham Sektor Properti yang Tercatat di Bursa Efek Jakarta Tahun 2001-2005*. Tesis Universitas Diponegoro.
- Thobarry, Achmad Ath. 2009. *Analisis Pengaruh Nilai Tukar, Suku Bunga, Laju Inflasi dan Pertumbuhan GDP Terhadap Indeks Harga Saham Sektor Properti (Kajian Empiris Pada Bursa Efek Indonesia Periode Pengamatan Tahun 2000-2008)*. Tesis Universitas Diponegoro.
- Twite, Garry. 2002. *Gold Prices, Exchange Rates, Gold Stocks and The Gold Premium*. Australian Journal of Management. Vol.27 No.2. The Australian Graduate School of Management.
- Undang-Undang Republik Indonesia No. 8 Tahun 1995 Tentang Pasar Modal.
- Valadkhani, Abbas. Surachai Chancharat dan Charles Havie. 2006. *The Interplay Between the Thai and Several Other International Stock Markets*. Faculty of Business-Economics Working Papers. University of Wollongong. Available: www.uow.edu.au.
- Veter, Jhon. 2011. *Happy Investing: Portofolio Management*. Jakarta: Pustaka Delapan.
- Widoatmodjo, Sawidji. 2009. *Pasar Modal Indonesia: Pengantar dan Studi Kasus*. Bogor: Ghalia Indonesia.
- Winarno, Wing Wahyu. 2009. *Analisis Ekonometrika dan Statistik dengan EViews*. Yogyakarta: UPP STIM YKPN.
- Witjaksono, Ardian Agung. 2010. *Analisis Pengaruh Tingkat Suku Bunga SBI, Harga Minyak Dunia, Harga Emas Dunia, Kurs Rupiah, Indeks Nikkei 225 dan Indeks Dow Jones terhadap IHSG (Studi Kasus Pada IHSG di BEI Selama Periode 2000-2009)*. Tesis Universitas Diponegoro.