

## DAFTAR PUSTAKA

Adiningsih, Sri dkk. 1998. **Perangkat Analisis dan Teknik Analisis Investasi di Pasar Modal Indonesia**. Jakarta: P.T. Bursa Efek Jakarta.

Ahmad, Sadeq 2008, **Analisis Prediksi Indeks Harga Saham Gabungan dengan Metode (Studi pada IHSG di Bursa Efek Jakarta)**, Tesis Program Pasca Sarjana Magister Manajemen Universitas Diponegoro.

Ahmad Ripai Purba, 2009. **Pengaruh Faktor Teknikal terhadap Harga Saham Sektor Perbankan dan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia**, Tesis Universitas Sumatera Utara, Tidak dipublikasikan.

Ang, Robert, 1997, **Buku Pintar: Pasar Modal Indonesia**, Mediasoft Indonesia.

Anton, 2006, **Analisis Model Volatilitas Return Saham (Studi Kasus pada Saham LQ45 di Bursa Efek Jakarta)**, Tesis S2 Magister Sains Akuntansi Universtas Diponegoro.

Arsyad, Lincoln, 1995, **Peramalan Bisnis**, Ghalia Indonesia, Jakarta

A, William, diterjemahkan Sigit Triandaru, SE, 2000, **Ekonomi Makro, Pendekatan Kontemporer**, Salemba Empat, Jakarta.

Beer, Francisca, Rafiq, Rafiqul, Bhuyan,Robbani, Mohammad G., 2008, "Stock market and exchange rate dynamics: an empirical investigation on Brazil and USA", **Journal of International Business and Economics**, ISSN 1544-8037 Vol. 8 Issue 3.

Bodie, Kane, Marcus, 2006, **Investasi**, Salemba, Jakarta

B. Hadianto, 2010, " Pengaruh Volume Perdagangan, EPS dan PER Terhadap Harga Saham Sektor Pertambangan pada Periode 2000-2005 di Bursa Efek Jakarta", **Jurnal manajemen Majour Maranatha**

Chordia, Tarun and Bhaskaran, 2000,"Trading Volume And Cross Auto Correlations in Stock Return",**The Journal of Finance**, Vol. IV

Dheny Wahyu Fuadi, , 2009, **Analisis Pengaruh Suku Bunga, Volume Perdagangan, dan Kurs Terhadap Return Saham Sektor Properti yang Listed di BEI (Studi Kasus Pada Saham Sektor Properti yang Listed di BEI Periode 2003-2007)**, Tesis Program Pasca Sarjana Magister Manajemen Universitas Diponegoro.

Donna Menina Della Maryane, 2009, **Pengaruh Nilai Tukar Rupiah, Suku Bunga SBI, Volume Perdagangan, Inflasi, dan Beta Saham Terhadap Harga Saham, (Studi Empiris pada Perusahaan Sektor Perbankan di Bursa Efek Indonesia periode Tahun 2004-2007)**, Tesis Program Pasca Sarjana Magister Manajemen Universitas Diponegoro.

Dornbusch, Rudiger, Stanley Fischer, J. Mulyadi, 1997, **Makroekonomi**, Jakarta, Erlangga

D. Levi, Maurice, 2001, **Keuangan Internasional. Buku 1**, Mc. Graw-Hill Book. Co, Penerbit Andi, Yogyakarta.

Dornbusch, Rudiger, 2004. **Makro Ekonomi**. Jakarta : Media Global Edukasi

Gupta, Jyoti P., Alain Chevalier and Fran Sayekt. 2000 “The Causality Between Interest Rate, Exchange Rate and Stock Price in Emerging Market: The Case Of The Jakarta Stock Exchange” **Working Paper Series. EFMA 2000**.Athens.

Hamid, Mudasetia A, 1995, “Analisis Penentuan Saham yang Akan Dibeli, Suatu Tinjauan Umum”, **Kajian Bisnis September**, No. 6

Harjum Muharam, Zuareadah Nurafni, 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 2008 24-42.

Heri Sudarsono, 2003, “Analisis Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Investasi”, **KOMPAK** No. 7 Januari-April 2003, hal 21-30

Husnan, Suad, 1998, “Efisiensi Pasar Modal Indonesia”, **Jurnal Ekonomi Keuangan Indonesia**

Husnan, Suad, 2005, **Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas**, Edisi keempat, Edisi 4, BPFE, Yogyakarta

Jones, Charles P, 1996, **Investment Analysis and Management**, 5th Edition, Singapore John Wiley and Son, Inc.

Keown, dkk, 2005, **Manajemen Keuangan. Prinsip-prinsip dan Aplikasi. Jilid 2**, PT. Indeks. Kelompok Gramedia

Khrawish, Husni Ali, Siam, Walid Zakaria , Jaradat Mohammad, 2010, “The relationships between stock market capitalization rate and interest rate:Evidence from Jordan”, **BEH - Business and Economic Horizons** ISSN: 1804-1205 Vol. 2 Issue 2, pp. 60-66.

Lestari Anio Indah, Lutfi Muslich, Syahyunan, 2007, “Pengaruh Faktor Fundamental dan Teknikal Terhadap Harga Saham Properti yang Terdaftar di Bursa Efek Jakarta”, **MEPA Ekonomi** Volume 2 No. 2

Lutfur Rahman, Jashim Uddin, 2009, “ Dynamic Relationship between Stock prices and Exchange Rates: Evidence from Three South Asian Countries”, **International Business Research**, Vol. 2 No. 2.

M. Suparmoko, MA, PhD, 2000, **Pengantar Ekonomi Makro**, BPFE, Yogyakarta

Mohamad, Samsul, 2006, **Pasar Modal & Manajemen Portofolio**, Erlangga, Jakarta

Muhammad, Naeem, 2001, “ Stock Prices and Exchange Rates: Are they Related? Evidence from South Asian Countries” **Department Economics & Finance Institute of Business Administration Karachi University Campus Karachi-Pakistan**

Murwaningsari, Ety, 2008, “Pengaruh Volume Perdagangan, Sepsito, dan Kurs terhadap IHSG beserta Prediksi IHSG (Model GARCH dan ARIMA), **Jurnal Ekonomi dan Bisnis Indonesia**, Vol. 23, No. 2, 008, 178-195

Muslim Ridha Mthaher, Osmad Muthaher, 2007, “Pengaruh Variabel-variabel Fundamental dan Teknikal Terhadap Harga Saham pada Perusahaan Retail di BEJ”, **EKOBIS** Vo. 8 No. 1 januari 2007: 59-66

Nachrowi, Djalal, Nachrowi, Usman, Hardius, 2007, “Prediksi IHSG dengan Model GARCH dan Model ARIMA” **Jurnal Ekonomi dan Pembangunan Indonesia**, Vol.Vii No. 02 hal 73-91

Novita Mila, Nachrowi Djalal Nachrowi, 2005, “Dynamic Analysis of the Stock Price Index and the Exchange Rate Using Vector Autoregression (VAR): An Empirical Study of the Jakarta Stock Exchange, 2001-2004”, **EKI** Vol. 53 No.3.

Hartono, Jogiyanto, 2007, **Teori Portofolio dan Analisis Investasi**, BPFE-UGM, Yogyakarta

Heru, Nugroho, 2008, **Analisis Pengaruh Inflasi, Suku Bunga, Kurs, dan Jumlah Uang Beredar terhadap Indeks LQ 45 (Studi Kasus Pada BEI Periode 2002-2007)**, Tesis Program Pasca Sarjana Magister Manajemen Universitas Diponegoro.

Imam Ghozali., 2005. **Aplikasi Analisis Multivariat dengan Program SPSS**. Badan Penerbit Universitas Diponegoro. Semarang

Ologunde A.O, Elumilade, D.O, 2006, "Stock Market Capitalization and Interest Rate in Nigeria: A Time Series Analysis", **International Research Journal of Finance and Economics** ISSN 1450-2887 Issue 4 (2006)

Panji Anoraga dan Pakarti, Piji, 2001. **Pasar Modal, Keberadaan dan Manfaatnya Bagi Pembangunan**, Jakarta : PT. Rineka Cipta.

Prasetio, J.E dan Sutoyo, 2003, "Analisis Pengaruh Interaksi Laba Akuntansi dengan Arus Kas terhadap Harga Saham dan Volume Perdagangan Saham", **Jurnal Manajemen & Bisnis**, Vol, 5, No, 3, September, hal, 239- 252

Qiqin Trisna Dhuwita, 2003, **Pengujian Penerapan Analisis Teknikal dalam Memprediksi Indeks LQ 45 di Bursa Efek Jakarta**, Tesis Program Pasca Sarjana Magister Manajemen Universitas Diponegoro.

Sa'adah, Siti dan Yunia Panjaitan. 2006, "Interaksi Dinamis Antara Harga Saham Dengan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Dollar Amerika Serikat", **Jurnal Ekonomi dan Bisnis**.pp:46-62.

Samuelson, 2004, **Ilmu Makro Ekonomi**. Jakarta : Media Global Edukasi.

Sharpe, dkk, 2006, **Investasi, Jilid 2**, Jakarta: PT. Index Kelompok Gramedia

Sitinjak, Elyzabeth Lucky Maretha dan Widuri Kurniasari. 2003, "Indikator indikator Pasar Saham dan Pasar Uang Yang Saling Berkaitan Ditinjau Dari Pasar Saham Sedang Bullish dan Bearish", **Jurnal Riset Ekonomi dan Manajemen**. Vol. 3 No. 3

Sirirat Thammasiri, Suluck Pattarathammas, 2010, "Trading Volume and Returns Relationship in SET50 Index Futures Market", **Chinese Business Review**, ISSN 1537-1506, USA.

Slamet Sugiri, 2000, "Hubungan Antara Harga Saham Industri Telekomunikasi dan Kurs Dolar AS: Penerapan Error Correction Model (ECM)", **KOMPAK**, No, 22, Januari, hal. 489-504

Sri, Mulyono 2000, "Peramalan Harga Saham dan Nilai Tukar : Teknik Box-Jenkins", **Ekonomi dan Keuangan Indonesia**, Vol. XLVIII No.2

Subiyantoro, Edy dan Andreani, Fransisca, 2003, "Analisis Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi Harga Saham (Kasus Perusahaan Jasa Perhotelan yang Terdaftar di Pasar Modal Indonesia)", **Jurnal Manajemen & Kewirausahaan** Vol. 5, No. 2, September 2003: 171 – 180

Sugiarto, Ir, Msc, Harijono, SE, MAF, 2000, **Peramalan Bisnis**, Gramedia Pustaka, Jakarta.

Sunariyah, SE, Msi, 2006, **Pengantar Pengetahuan Pasar Modal**, Edisi Ke-5, UPP STIM YKPN

Sutrisno, 2000, **Manajemen Keuangan Teori, Konsep dan Aplikasi** , Edisi Pertama, Ekonosia, Yogyakarta, 2000.

Tandelilin, E, 2001, **Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio**. BPFE, Yogyakarta

Tahir. M. F, Wong Wing Keung, 2001, "Linkage between Stock Market Prices and Exchange Rate: A Causality Analysis for Pakistan."

Tripathy, Naliniprava, 2010, "The Emprical Relationship between Trading Volumes & Stock Return Volatility in Indian Stock Market, **European Journal of Economics, Finance, and Administrative Sciences**, ISSN 1450-2257 Issue 24.

Wongkaroon, Rewat, 2002, "A Testing of Market Efficiency Using ARIMA Model:The Stock Exchange of Thailand", **Thesis Financial Management**

Winarno, Wahyu, Wing, 2009, **Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan Eviews**, STIM YPKN, Yogyakarta.

Wiyani, Wahyu dan Wijayanto, Andi, 2005. "Pengaruh Nilai Tukar Rupiah, Tingkat Suku Bunga Deposito dan Volume Perdagangan Saham terhadap Harga Saham", **Jurnal Keuangan dan Perbankan**, Tahun IX, No. 3 September.

[www.idx.co.id](http://www.idx.co.id)

[www.bi.go.id](http://www.bi.go.id)

Zulhawati, 2000,"Aktivitas Volume Perdagangan di Pasar Modal Indonesia Tahun Laporan Keuangan 1996", **KOMPAK**, No, 22, Januari, hal. 505-520