

## DAFTAR PUSTAKA

- Ang, R. 1997. *"Buku Pintar: Pasar Modal Indonesia."* First Edition. Penerbit: Mediasoft Indonesia.
- Anggarwal, R. 1992. "Gold Markets", in: Newman, P., Milgate, M., Eatwell, J. (eds.) *The New Palgrave Dictionary of Money and Finance* (Vol. 2), Basingstoke, Macmillan, pp. 257-258.
- Anoraga, P. 2001. "Pengantar Pasar Modal". Semarang: Penerbit PT Rineka Cipta.
- Anoraga, P. dan P. Piji. 2006. *Pengantar Pasar Modal*, Edisi Kelima. Jakarta: Penerbit Rineka Cipta.
- Avonti, A.A. dan H. Prawoto. 2003. "Analisis Pengaruh Nilai Tukar Rupiah/US\$ dan Tingkat Suku Bunga BI terhadap Indeks Harga Saham Gabungan di Bursa Efek Jakarta". *Jurnal Akuntansi Bisnis*, Vol. III, No. 5.
- Badan Pusat Statistik. 2013. *Ekonomi Indonesia Triwulan I/2013 Tumbuh 6,02 Persen*. <http://www.bps.go.id/?news=1008>. Diakses 9 November 2013.
- Bernanke, B.S. and K.N. Kuttner. 2005. "What Explains the Stock Market's Reaction to Federal Reserve Policy". *Journal of Finance, American Finance Association*, Vol. 60(3), pp 1221-1257.
- Blanchard, O. 2006. *Macroeconomics*. 4th ed. New Jersey: Pearson Prentice Hall.
- Bodie, Z.V.I., A. Kane, dan A.J. Marcus. 2006. *Essential of Investments*. 6th ed. New York: McGraw-Hill.
- Bollerslev, T. 1986. "Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity". *Journal of Econometrics*, Vol. 31, pp. 307-327.
- Bursa Efek Indonesia. 2010. "Buku Panduan Indeks Harga Saham Bursa Efek Indonesia". <http://www.idx.co.id/Portals/0/Information/ForInvestor/StockMarketIndices/FileDownload/Buku%20Panduan%20Indeks%202010.pdf>. Diakses 9 November 2013.
- Cheng, C.D. Agnes, L.C. Shin, and Schaefer. 1997. "The Value Relevance of SFAS No. 95 Cash Flow from Operation as Assessed by Security Market Effects", *American Accounting Association. Accounting Horizon*, September. Vol. 11, No. 3, pp. 1-15.
- Christiawan, A.H. 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 Indeks Harga Saham Gabungan (Studi Pada Pasar New York Stock Exchange dan Bursa Efek Indonesia Periode 2002-2009)". Masters thesis, Universitas Diponegoro.

D'Agostino, A., L. Sala., and P. Surico. 2005. "*The Fed and the Stock Market*". [http://www.researchgate.net/publication/23747833\\_The\\_Fed\\_and\\_the\\_Stock\\_Market](http://www.researchgate.net/publication/23747833_The_Fed_and_the_Stock_Market). Diakses 29 Oktober 2013.

Dornbusch, R. 2004. "Makro Ekonomi". Jakarta: Media Global Edukasi.

Dornbusch, R. dan S. Fischer. 1997. "Makroekonomi". Jakarta: Erlangga.

Engle, R.F. 1982. "*Autoregressive Conditional Heteroscedasticity with Estimates of the Variance of United Kingdom Inflation*". *Journal of Econometrica*, Vol. 50, No. 4, pp. 987-1007.

Engle, R.F., D.M. Lilien dan R.P. Robins. 1987. "*Estimating Time Varying Risk Premia in the Term Structure: The ARCH-M Model*". *Journal of Econometrica*, Vol. 55, No. 2, pp. 391-407

Firdaus, M. 2006. *Analisis Deret Waktu Satu Ragam*. Bogor: IPB Press.

Frensidy, B. 2009. "*Analisis Pengaruh Aksi Beli-Jual Asing, Kurs, dan Indeks Hang Seng Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan di Bursa Efek Jakarta Dengan Model Garch*". FE UI.

Ghozali, I. 2011. *Aplikasi Analisis Multivariat dengan Program SPSS*. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro.

Gujarati, D. 2003. *Basic Econometrics*. Singapura: Mc Graw-Hill.

Hasibuan, M. 2007. "Dasar-dasar Perbankan". Jakarta: Bumi Aksara.

Hayo, B. and A.M. Kutan. 2004. "*The Impact of News, Oil Prices, and Global Market Developments on Russian Financial Markets*", Vol. 13, Issue 2, pp 373-393.

Hirschey, M. dan J. Nofsinger. 2008. "Investments Analysis and Behavior". Singapore: McGraw-Hill.

Husnan, S. 1998. "Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisa Sekuritas". Jogjakarta: UUP AMP YKPN.

Husnan, S. 2004. *Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*. Yogyakarta: Penerbit UPP AMP YKPN.

- Ishomudin. 2010. "*Analisis Pengaruh Variabel Makroekonomi Dalam dan Luar Negeri Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Di BEI Periode 1999.1 - 2009.12 (Analisis Seleksi Model OLS-ARCH/GARCH)*". Skripsi, Universitas Diponegoro.
- Joesoef, J.R. 2007. *Pasar Uang dan Pasar Valuta Asing*. Jakarta: Penerbit Salemba Empat.
- Karim, B.A., M.S.A. Majid., and S.A.A. Karim. 2009. "*Financial Integration between Indonesia and Its Major Trading Partners*". [http://www.researchgate.net/publication/46446636\\_Financial\\_Integration\\_between\\_Indonesia\\_and\\_Its\\_Major\\_Trading\\_Partners](http://www.researchgate.net/publication/46446636_Financial_Integration_between_Indonesia_and_Its_Major_Trading_Partners). Diakses 29 Oktober 2013.
- Keown. 2005. "Manajemen Keuangan Prinsip-prinsip dan Aplikasi". Jilid 2. PT Indeks. Kelompok Gramedia.
- Kilian, L. and C. Park. 2007. "*The Impact of Oil Price Shocks on the U.S. Stock Market*", Vol. 50, Issue 4, pp. 1267–1287.
- Kuncoro, M. 1996. "Manajemen Keuangan Internasional: Pengantar Ekonomi dan Bisnis Global". Yogyakarta: BPFE
- Kuncoro, M. dan Suhardjono. 2002. *Manajemen Perbankan: Teori dan Aplikasi*. Yogyakarta: Penerbit BPFE.
- Lipsey, R.G. and C. Harbury. 1992. "*First Principles of Economics*". 2nd ed. Oxford: Oxford University Press.
- Madura, J. 1997. "Manajemen Keuangan Internasional". Edisi Keempat. Jakarta: Erlangga.
- Makridakis, S. 1999. *Metode dan Aplikasi Peramalan*. Terjemahan Untung Sus Andriyanto dan Abdul Basith. Jakarta: Erlangga.
- Maryanne, D.M.D. 2009. "Pengaruh Nilai Tukar Rupiah, Suku Bunga SBI, Volume Perdagangan Saham, Inflasi dan Beta Saham Terhadap Harga Saham (Studi Empiris pada Perusahaan Sektor Perbankan Di Bursa Efek Indonesia Periode 2004-2007)". Masters thesis, Universitas Diponegoro.
- Moore, G.H. 1990. "*Gold Prices and a Leading Index of Inflation*". Challenge, Vol. 33 No. 4, pp. 52-56.
- Muharam, H. dan Z. 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, h. 24 – 42.

- Murti, L. 2005. "Pengaruh Variabel makro terhadap return saham di Bursa Efek Jakarta Pendekatan beberapa model", Paper Seminar Nasional Akuntansi VIII.
- Nachrowi dan Usman. 2005. *Penggunaan Teknik Ekonometrika*. Edisi Revisi. Jakarta: Rajawali Press.
- \_\_\_\_\_. 2006. *Penggunaan Teknik Ekonometrika*. Edisi Revisi. Jakarta: Rajawali Press.
- Nazir, M. 2005. *Metode Penelitian*. Bogor: Penerbit Ghalia Indonesia.
- Putri, D.A.S. 2012. "Analisis Pengaruh Tingkat Suku Bunga SBI, DPK, Inflasi, Kredit Non Lancar Dan Nilai Tukar Terhadap LDR Pada Bank Umum Di Indonesia Tahun 2006-2009. Masters thesis, Universitas Diponegoro.
- Rahardjo, H.B. 2009. "Analisis Pengaruh Dividend Payout Ratio, Debt Equity Ratio, Return On Equity, Nilai Tukar Dan Suku Bunga SBI Terhadap Return Saham. Masters thesis, Universitas Diponegoro.
- Ruhendi dan J. Arifin. 2003. "Dampak Perubahan Kurs Rupiah Dan Indeks Saham Dow Jones Di New York Stock Exchange Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan Di BEJ", *Jurnal Wahana*, Vol. 6, No. 1, h. 45-57.
- Rusbariandi, S.P. 2012. "Analisis Pengaruh Tingkat Inflasi, Harga Minyak Dunia, Harga Emas Dunia dan Kurs Rupiah terhadap Jakarta Islamic Index di Bursa Efek Indonesia pada periode Januari 2005–Maret 2012", *Jurnal Respository Gunadarma*, Universitas Gunadarma, h. 1-14. <http://repository.gunadarma.ac.id/handle/123456789/4455>. Diakses 29 Oktober 2013.
- Salvatore, D. 1996. *Ekonomi Internasional*. Edisi Kelima Jilid 2. Terjemahan oleh Drs. Haris Munandar. Jakarta: PT Gelora Aksara Pratama.
- Samsul, M. 2006. *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Penerbit Erlangga.
- \_\_\_\_\_. 2008. *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Penerbit Erlangga.
- Samuelson. 2004. "Ilmu Makro Ekonomi". Jakarta: Media Global Edukasi.
- Santoso, S. dan F. Tjiptono. 2001. *Riset Pemasaran, Konsep dan Aplikasi dengan SPSS*. Jakarta: PT. Alex Media Komputindo.
- Sari, Y.K. 2012. "Pengaruh Tingkat Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia, Indeks Saham Hang Seng, Kurs Dollar As Dan Indeks Saham Dow Jones Industrial Average Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan Di Bursa

*Efek Indonesia Periode 2008 -2010*". S1 Thesis, Universitas Negeri Yogyakarta.

Sembel, R. 2008. Tablid Kontan. Edisi Minggu II, Maret 2008, h.12.

Smith, G. 2001. "*The Price Of Gold And Stock Price Indices For The United States*". Adrienne Roberts FT Personal Finance, pp. 14.

Sudjono. 2002. "*Analisis Keseimbangan dan Hubungan Simultan antara Variabel Ekonomi Makro terhadap Indeks Harga Saham di Bursa Efek Jakarta dengan Metode VAR (Vector Autoregression) dan ECM (Error Correction Model)*". Jurnal Riset Ekonomi dan Manajemen. Vol. 17, No. 3, h. 81-97.

Sugiharto dan Harijono. 2000. *Peramalan Bisnis*. PT. Gramedia Pustaka Utama.

Sugiyono. 1999. *Statistika Untuk Penelitian*. Bandung: Penerbit CV. Alfabeta.

Sugiyono. 2007. *Metode Penelitian Bisnis*. Yogyakarta: Penerbit CV. Alfabeta.

Sumantoro. 1990. *Pengantar Tentang Pasar Modal di Indonesia*. Jakarta: Penerbit Ghalia Indonesia.

Sunariyah. 2004. *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*. Edisi Kedua. Yogyakarta: UPP STIM YKPN.

\_\_\_\_\_. 2006. *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*. Edisi Kelima. Yogyakarta: UPP STIM YKPN.

Supono, B. 1999. *Metodologi Penelitian Bisnis untuk Akuntansi dan Manajemen*. Yogyakarta: BPFE.

Surjadi, A.J. 2006. "*Dampak Tingginya Harga Minyak Terhadap Ekonomi Global*". Paper disajikan pada Seminar Setengah Hari tentang "Antisipasi Dampak Negatif Tingginya Harga Minyak Dunia terhadap Stabilitas Perekonomian Nasional, di Departemen Keuangan, 30 Agustus 2006.

Undang-Undang Republik Indonesia No. 8 Tahun 1995 tentang Pasar Modal.

Valadkhani, A., S. Chancharat, and C. Havie. 2006. "*The Interplay Between the Thai and Several Other International Stock Markets*". Economics Working Papers wp06-18.

Wardane, A.S. 2003. "*Analisis Pengaruh Inflasi, PDB, Kurs dan Tingkat Suku Bunga terhadap Indeks Harga Saham Perusahaan Manufaktur – Food and Beverages*". Skripsi tidak dipublikasikan.

Widarjono, A. 2005. *Ekonometrika Teori dan Aplikasi untuk Ekonomi dan Bisnis*. Yogyakarta: Universitas Islam Indonesia.

Winarno, W.W. 2011. *Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan EvIEWS*. Edisi 3. Yogyakarta: Penerbit UPP STIM YKPN.

Witjaksono, A.A. 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)*". Masters thesis, Universitas Diponegoro.

Wondabio, L.S. 2006. "*Analisa Hubungan Index Harga Saham Gabungan (IHSG) Jakarta (JSX), London (FTSE), Tokyo (Nikkei) dan Singapura (SSI)*", Jurnal Simposium Nasional Akuntansi 9 Padang. Vol. 1.

Yuliman, Y. 2003. "*Analisis Pengaruh Kurs US\$, Suku Bunga dan Price Earning Ratio terhadap Indeks LQ 45 di BEJ (Studi kasus bulan Januari 2003)*". Semarang: Tesis MM UNDIP.

Yuono, E. 2011. "*Pengaruh Kurs Nilai Tukar, Suku Bunga Deposito dan Indeks Nikkei Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Tahun 2007-2010*". Surakarta: Skripsi FE Universitas Sebelas Maret.

[http://en.wikipedia.org/wiki/Nikkei\\_225](http://en.wikipedia.org/wiki/Nikkei_225), diakses 9 November 2013.

[http://id.wikipedia.org/wiki/Indeks\\_Hang\\_Seng](http://id.wikipedia.org/wiki/Indeks_Hang_Seng), diakses 9 November 2013.

[http://id.wikipedia.org/wiki/Sertifikat\\_Bank\\_Indonesia](http://id.wikipedia.org/wiki/Sertifikat_Bank_Indonesia), diakses 8 November 2013.

[http://en.wikipedia.org/wiki/Dow\\_Jones\\_Industrial\\_Average](http://en.wikipedia.org/wiki/Dow_Jones_Industrial_Average), diakses 9 November 2013.

<http://www.indonesiainancetoday.com/read/38447/Volatilitas-Saham-Tambang-Tertinggi>, diakses 11 November 2013.

<http://ekbis.sindonews.com/read/2013/03/04/34/723885/ini-10-negara-tujuan-ekspor-terbesar-indonesia>, diakses 4 Maret 2013.

[http://www.imf.org/external/pubs/ft/weo/2013/02/weodata/weorept.aspx?pr.x=71&pr.y=5&sy=2009&ey=2018&scsm=1&ssd=1&sort=country&ds=.&br=1&c=924%2C158%2C111&s=NGAP\\_NPGDP%2CPPPSH%2CNID\\_NGDP%2CNGSD\\_NGDP&grp=0&a=,](http://www.imf.org/external/pubs/ft/weo/2013/02/weodata/weorept.aspx?pr.x=71&pr.y=5&sy=2009&ey=2018&scsm=1&ssd=1&sort=country&ds=.&br=1&c=924%2C158%2C111&s=NGAP_NPGDP%2CPPPSH%2CNID_NGDP%2CNGSD_NGDP&grp=0&a=,) diakses 11 November 2013.

<http://www.idx.co.id>, diakses 11 November 2013.

[http://useconomy.about.com/od/economicindicators/p/Crude\\_Oil.htm](http://useconomy.about.com/od/economicindicators/p/Crude_Oil.htm), diakses 11 November 2013.

[http://useconomy.about.com/od/commoditiesmarketfaq/f/oil\\_prices.htm](http://useconomy.about.com/od/commoditiesmarketfaq/f/oil_prices.htm), diakses 11 November 2013.

<http://www.antaranews.com/print/55550/>, diakses 21 November 2013.

<http://www.opec.org>, diakses 21 November 2013.

[http://www.lbma.org.uk/pages/index.cfm?page\\_id=52](http://www.lbma.org.uk/pages/index.cfm?page_id=52), diakses 21 November 2013.

<http://www.investopedia.com/articles/basics/08/invest-in-gold.asp>, diakses 22 November 2013.

<http://www.investopedia.com/articles/basics/08/reasons-to-own-gold.asp>, diakses 22 November 2013.

<http://www.bloomberg.com/news/2013-10-18/asia-stock-index-heads-for-weekly-gain-ahead-of-china-gdp.html>, diakses 22 November 2013.

<http://finance.detik.com/read/2012/04/09/114259/1887703/65/pengaruh-indeks-dow-jones-terhadap-ihsg>

<http://www.research.stlouisfed.org>

<http://www.goldfixing.com>

<http://www.bps.go.id>.

[www.nni.nikkei.co.jp](http://www.nni.nikkei.co.jp)

[finance.yahoo.com](http://finance.yahoo.com)

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