

## DAFTAR PUSTAKA

- Ajija, Shochrul R, Dyah W.S, Rahmat H.S, dan Martha R.P. 2011. *Cara Cerdas Menguasai Eviews*. Jakarta : Salemba Empat.
- Andayani, Nining Setyowati Dwi, Moeljadi P.s dan M. Harry Susanto. 2010. Pengaruh Variabel Internal dan Eksternal Perusahaan Terhadap Risiko Sistematis Saham Pada Kondisi Pasar Yang Berbeda (Studi Pada Saham-Saham ILQ45 di Bursa Efek Jakarta). *Jurnal Wacana Vol. 13 No.2*.
- Ang, Robert. 1997. *Buku Pintar Pasar Modal Indonesia*. Jakarta : Mediasoft Indonesia.
- Anoraga, Pandji dan Piji Pakarti. 2001. *Pengantar Pasar Modal*. Jakarta : PT Rineka Cipta.
- Bank Indonesia. 2014. *www.bi.go.id*. Diakses Januari 2015.
- Bank Indonesia. 2009. *Krisis Ekonomi Global dan Dampaknya terhadap Perekonomian Indonesia. Outlook Ekonomi 2009 - 2014*.
- Bank Indonesia. 2008. *Dampak Bi Rate terhadap pasar keuangan: Mengukur Signifikansi Respon Instrumen Pasar Keuangan terhadap Kebijakan Moneter. Working Paper / 21 / 2008*.
- Bursa Efek Indonesia. 2014. *www.idx.co.id*. Diakses Januari 2015.
- Bollerslev, Tim, Ray Y. Chou and Kenneth F.K. 1992. *ARCH Modeling in Finance, A Review of the Theory and Empirical Evidence. Journal of Econometrics* 52, 5-59, North-Holland.
- Bollerslev, Tim, Robert F.Engle and Daniel B.N. 1993. *ARCH Models. Discussion Paper 93-49*. University of California, San Diego.
- Darmadji, Tjiptono dan Hendry M.Fakhruddin. 2007. *Pasar Modal di Indonesia, Edisi 2 (Pendekatan Tanya Jawab)*. Jakarta : Salemba Empat.

- Ervinta, Vira Terra dan Zaroni. 2013. Analisis Pengaruh Faktor Fundamental Dan Eva Terhadap Harga Saham Indeks LQ45 Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia Periode 2007-2011. *Jurnal Nusantara Bina Ekonomi Majalah Ilmiah Fakultas Ekonomi Unpar Volume 74:17, Nomor 1*.
- Firmansyah. 2006. *Analisis Volatilitas Harga Kopi Internasional*. Jakarta : Usahawan
- Gujarati, Damodar N. 2003. *Basic Econometrics. Fourt Edition. McGraw Hill Companies. Inc. New York*.
- Gujarati, Damodar, dan Sumarno Zain. 1978. *Ekonometrika Dasar*. Jakarta : Erlangga.
- Hadi, Nor. 2013. *Pasar Modal Acuan Teoritis dan Praktik Investasi di Instrumen Keuangan Pasar Modal*. Yogyakarta : Graha Ilmu.
- Hugida, Lydianita dan Syuhada Sofian. 2010. Analisis Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi Volatilitas Harga Saham (Studi pada Perusahaan yang Terdaftar dalam Indeks LQ45 Periode Tahun 2006-2009). *Jurnal*.
- Izedonmi, Prince Famous dan Ibrahim Bello Abdullahi. 2011. *The Effects of Macroeconomic Factors on the Nigerian Stock Returns: A Sectoral Approach. University of Benin. Global Journal of Management and Business Research Volume 11 Issue 7 Version 1.0. USA : Global Journals*.
- Jakarta Stock Exchange LQ45 Historical Data. 2014.  
<http://www.investing.com/indices/jakarta-LQ45-historical-data>. Diakses Desember 2014.
- Kartika, Andi. 2010. Volatilitas Harga Saham di Indonesia dan Malaysia. *Jurnal Vol.12 No.1*. Universitas STIKUBANK : Fakultas Ekonomi
- Kewal, Suramaya Suci. 2012. Pengaruh Inflasi, Suku Bunga, Kurs, dan Pertumbuhan PDB Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan. *Jurnal Economia, Volume 8, Nomor 1*. Palembang : Sekolah Tinggi Ilmu Ekonomi.
- Kusumawardani, Angrawit. 2009. Analisis Pengaruh EPS, PER, ROE, FL, DER, CR, ROA Pada Harga Saham dan Dampaknya Terhadap Kinerja Perusahaan LQ45 Yang Terdaftar Di BEI Periode 2005 -2009. *Jurnal*. Universitas Gunadarma.
- Liummah, Khoiru, Ayu Nastiti dan Agus Suharsono 2012. Analisis Volatilitas Saham Perusahaan Go Public dengan Metode ARCH-GARCH. *Jurnal Sains dan Seni ITS Vol. 1, No. 1*. Institut Teknologi Sepuluh Nopember.

- Markowitz, Harry M. 1952. *Portofolio Selection. Journal of Finance Volume 7.*
- Miskhin, Frederic S. 2008. *Ekonomi Uang, Perbankan, dan Pasar Keuangan Edisi 8.* Salemba Empat : Jakarta.
- Muis, Saludin. 2008. *Meramal Pergerakan Harga Saham Menggunakan Pendekatan Model ARIMA, Indeks Tunggal, dan Markowitz.* Yogyakarta: Graha Ilmu.
- Musdalifah, Azis. 2013. Filsafat Teori Portofolio Modern. Artikel. <http://artikelku99.blogspot.com/2013/03/filsafat-teori-portofolio-modern.html>. Diakses Januari 2015.
- Mutakif, Fikri dan Andini Nurwulandari. 2012. Pengaruh Volume Perdagangan Saham, Nilai Tukar dan Indeks Hang Seng Terhadap Pergerakan Indeks Harga Saham Gabungan. *Jurnal Akuntansi & Bisnis Vol. 7, No. 2.* Universitas Nasional Jakarta (UNJ) : Fakultas Ekonomi.
- Nawatmi, Sri. 2012. Volatilitas Nilai Tukar dan Perdagangan Internasional ((*The Exchange Rate Volatikity and International Trade*). *Jurnal Dinamika Akuntansi, Keuangan dan Perbankan Vol. 1 No. 1.*
- Nopirin. 2000. *Pengantar Ilmu Ekonomi Makro & Mikro Edisi Pertama.* Yogyakarta : BPFE.
- Nopirin. \_\_\_\_\_. *Ekonomi Moneter Buku Satu Edisi Tiga.* Yogyakarta : BPFE.
- Nurmalasari, Indah. 2009. Analisis Pengaruh Rasio Profitabilitas Terhadap Harga Saham Emiten LQ45 Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Tahun 2005-2008. *Jurnal.* Universitas Gunadarma : Fakultas Ekonomi.
- Otoritas Jasa Keuangan. 2014. [www.ojk.go.id](http://www.ojk.go.id). Diakses Desember 2014.
- Pahlevi, Reza. 2009. Pengaruh *Earning Per Share (EPS), Net Profit Margin (NPM), Debt To Asset Ratio (DAR)* dan *Return On Equity (ROE)* Terhadap Harga Saham pada Perusahaan yang Termasuk Dalam Indeks LQ45 yang Terdaftar di BEI. *Jurnal.* Universitas Gunadarma : Fakultas Ekonomi.
- Panetta, Fabio, et al. 2006. *The recent behaviour of financial market volatility. BIS Papers No 29.* Switzerland.
- Patar, Andrew, Darminto dan Muhammad Saifi. 2013. Faktor Internal Dan Eksternal Yang Mempengaruhi Pergerakan Harga Saham (Studi Pada Saham-Saham Indeks LQ45 Periode 2009 – 2013). *Jurnal.* Malang : Universitas Brawijaya.

- Prasetiono, Dwi Wahyu. 2010. Analisis Pengaruh Faktor Fundamental Ekonomi Makro dan Harga Minyak terhadap Saham LQ45 Dalam Jangka Pendek dan Jangka Panjang. *Journal of Indonesian Applied Economics Vol. 4 No. 1*. Universitas Brawijaya : Fakultas Ekonomi.
- Rahman, Md Lutfur dan Jashim Uddin. 2010. *Dynamic Relationship between Stock Prices and Exchange Rates: Evidence from Three South Asian Countries*. *Jurnal*. Bangladesh : *International Business Research East West University*:
- Rakasetya, Gadang Ganggas dan Moch. Dzulkirom. 2013. Pengaruh Faktor Mikro Dan Faktor Makro Ekonomi Terhadap Harga Saham Perusahaan Mining And Mining Services Yang Terdaftar Di Bursa Efek Indonesia (BEI) Periode 2008-2011. *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB) Vol. 6 No. 2*. Malang : Universitas Brawijaya.
- Rinati, Ina. 2009. Pengaruh *Net Profit Margin (NPM)*, *Return On Assets (ROA)* dan *Return On Equity (ROE)* Terhadap Harga Saham Pada Perusahaan yang Tercantum Dalam Indeks LQ45. *Jurnal*. Universitas Gunadarma : Fakultas Ekonomi.
- Sari, Apri Anita dan Saimul. 2012. Analisis Pengaruh Nilai Tukar Riil, Inflasi, dan Indeks Saham Asing Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan di Indonesia. *Jurnal*. Lampung : Universitas Lampung.
- Schwert, G. William. 1989. *Why Does Stock Market Volatility Change Over Time?*. *The Journal Of Finance*. Vol. XLIV, No. 5.
- Shubiri, Faris Nafis Al. 2010. *Analysis the Determinants of Market Stock Price Movements: An Empirical Study of Jordanian Commercial Banks*. *International Journal of Business and Management*. Jordan : Amman Arab University.
- Sitopu, Wajibman. 2014. *Wajibstat.blogspot.com*. Diakses Januari 2015.
- Sunariyah. 2006. *Pengantar Pengetahuan Pasar Modal*. Edisi Kelima. Yogyakarta : Sekolah Tinggi Ilmu Manajemen YKPN.
- Tim Studi Volatilitas Pasar Modal Indonesia dan Perekonomian Dunia. 2011. *Laporan Studi Volatilitas Pasar Modal Indonesia dan Perekonomian Dunia*. Kementerian Keuangan Republik Indonesia : Badan Pengawas Pasar Modal dan Lembaga Keuangan.
- Universitas Guna Darma. 2008. Analisis Pengaruh *Earning Per Share (EPS)*, *Price Earning Ratio (PER)*, dan *Return On Equity (ROE)* Terhadap Harga Saham LQ45 Di Bursa Efek Indonesia Tahun 2007-2008. *Jurnal*.

Widarjono, Agus. 2009. *Ekonometrika Pengantar dan Aplikasinya*. Edisi Ketiga. Yogyakarta : Ekonosia.

Yahoo Finance. 2014. <http://www.yahoo.finance.com>. Diakses Desember 2014.

Yanuar, Adhi Yunanto. 2013. Dampak Variabel Internal dan Eksternal Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di Indonesia. *Jurnal Ilmiah*. Malang : Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Brawijaya.