

## DAFTAR PUSTAKA

- Abugri, B. A. (2006). Empirical relationship between macroeconomic volatility and stock returns: Evidence from Latin American markets. *International Review of Financial Analysis* 17 (2008) 396–410.
- Adityara, E. (2012). Pengaruh Pasar Saham Dunia Terhadap Pasar Saham Indonesia. *Jurnal Etikonomi Vol. 11 No. 2 Oktober 2012*.
- Ahmed, H. (2009). Financial Crisis Risks and Lessons for Islamic Finance. *ISRA International Journal of Islamic Finance* 1, 7–32.
- Aimprasittichai, S. dan Suppakittiwong, T. (2015). *A Study of a Relationship Between The U.S. Stock Market and Emerging Stock Markets in Southeast Asia*. Linnaeus University Sweden.
- Ajmi, A. N., Hammoudeh, S., Nguyen, D. K., dan Sarafrazi, Soodabeh. (2013). How Strong Are The Causal Relationship Between Islamic Stock Markets and Conventional Financial Systems? Evidence from Linear and Nonlinear Tests. *Journal of International Financial Market, Institutions, and Money*, 28 (2014), 213-227.
- Al-Khazali, Lean, dan Samet. (2014). Do Islamic Stock Indexes Outperform Conventional Stock Indexes? A Stochastic Dominance Approach. *Pacific-Basin Finance Journal*, 28 (2014), 29-46.
- Arifin, T. M. (2014). Pengaruh Inflasi, Suku Bunga SBI, Perubahan Kurs, Dan Standart & Poor's 500 Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG). *Fakultas Ekonomi Universitas Negeri Yogyakarta*.
- Asgharian, H., Christiansen, C., Gupta, R., dan Hou, A. J. (2016). Effects of Economic Policy Uncertainty Shocks on the Long-Run US-UK Stock Market Correlation. *CREATES Research Paper 2016-29*.
- Barakat, Mahmoud R., Sara H. Elgazzar dan Khaled M. Hanafy. Impact of Macroeconomic Variables on Stock Markets: Evidence from Emerging Markets, *International Journal of Economics and Finance*; Vol. 8, No. 1; 2016. Published by Canadian Center of Science and Education.
- Bashiri, N. dan Zadeh, A. M. (2014). The Study Of Relationship Between Asian Stock Exchanges And New York Stock Exchange. *Tehnički vjesnik* 21, 3(2014), 609-615.
- Basuki, A. T. (2016). Analisis Regresi dalam Penelitian Ekonomi dan Bisnis. Rajawali Pers, Jawa Barat.
- Beltratti, A. dan Morana, C. (2005). Breaks and persistency: macroeconomic causes of stock market volatility. *Journal of Econometrics* 131 (2006) 151–177.
- Bodie, Z., Kane, A., Marcus, A. J., Jain, dan Ravi. (2014). *Investments Asia Global Edition*. Mc Graw Hill, New York.
- Budiman, A. M. A. (2015). Analisis Pengaruh Tingkat Pengangguran, Indeks Korupsi, Indeks Nikkei 225, Harga Minyak Dan Harga Emas Terhadap Ihsg Periode 1998-2014. *Parsimonia, Vol. 2. No. 1. April 2015* : 67-75.
- Daniel, C. (2016). Pengaruh Harga Minyak Dunia terhadap Nilai Indeks Sektoral di Bursa Efek Indonesia Pasca Kebijakan Fluktuasi Harga BBM. *Tesis*. Universitas Kristen Satya Wacana Salatiga.

- Dutta, A. (2018). Oil and energy sector stock markets: An analysis of implied volatility indexes. *J. of Multi. Fin. Manag.* 44, 61–68.
- Gom, H. G. (2013). Analisis Pengaruh The Fed Rate, Indeks Dow Jones Dan Indeks Nikkei225 Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (Ihsg) Di Bursa Efek Indonesia (Bei) Periode 2008-2013. *Jurnal Ekonomi dan Keuangan* Vol.1, No. 8, 2013.
- Gunasekarage, A. et.al. (2004). Macroeconomic Influence on the Stock Market: Evidence From an Emerging Market in South Asia. *Journal of Emerging Market Finance*, 3: 285-304.
- Hadi, S. (2018). Keterkaitan Pasar Modal di Amerika Serikat, Indonesia Dan Korea Selatan. *Jurnal Inovasi Ekonomi Vol. 03 No. 01 Maret 2018 Page* 19-22.
- Halim, J. dan Marcories. (2011). Analisis Pengaruh Pergerakan Bursa Internasional Terhadap Pergerakan Bursa Indonesia. *Journal of Applied Finance and Accounting* 3(2) 181-203.
- Hanung, R. (2018). Begini Hubungan Kenaikan Harga Minyak dengan IHSG. Tersedia di <https://www.cnbcindonesia.com/market/20180313140608-17-7089/begini-hubungan-kenaikan-harga-minyak-dengan-ihsg>, diakses pada 6 Juli 2018.
- Hartono, J. (2007). *Teori Portfolio dan Analisis Investasi*. BPFE, Yogyakarta.
- Haryogo, A. (2013). Pengaruh Nilai Tukar dan Indeks Dow Jones Terhadap Composite Index di Bursa Efek Indonesia. *FINESTA Vol. 1, No. 1, (2013)* 1-6.
- Heriyanto dan Chen, M., (2014). Analisis Pengaruh Indeks Harga Konsumen, Jumlah Uang Beredar (M1), Kurs Rupiah, Dan Indeks S&P 500 Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan: Studi Empiris Pada Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Nominal/ Volume III Nomor 2*.
- Hu, Z., Kutan, A. M., dan Sun, P. (2018). Is U.S. economic policy uncertainty priced in China's A-shares market? T Evidence from market, industry, and individual stocks. *International Review of Financial Analysis* 57, 207–220.
- Hurvich, C. M., dan Tsai, C. L. (1989).Regression and Time Series Model Selection in Small Samples. *Biometrika Vol 76, No 2*.
- Hutapea, G., Margareth, E., dan Tarigan, L. (2014). Analisis Pengaruh Kurs Us\$/Idr, Harga Minyak, Harga Emas Terhadap Return Saham (Studi Kasus Pada Bei Periode 2007-2011). *Buletin Ekonomi ISSN: 1410-3842 Volume 18 No.2 Agustus 2014*.
- Investopedia. VIX-CBOE Volatility Index. Tersedia di <https://www.investopedia.com/terms/v/vix.asp>, diakses pada 3 Maret 2018.
- Kalengkongan, N. C., dan Rate, P.V. (2016). Pengaruh Faktor Makro Ekonomi Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan Di Indonesia (IHSG) Dan Jepang (Nikkei 225) Periode 2011 – 2015. *Jurnal Berkala Ilmiah Efisiensi Volume 16 No. 03*.
- Kalyanaraman, L. dan Tuwajri, B. (2014). Macroeconomic Forces and Stock Prices: Some Emprirical Evidence from Saudi Arabia. *International Journal of Financial Research, Vol. 5, No. 1, 2014*.

- Mintalangi, S. (2013). Pengaruh Nilai Tukar Mata Uang Rupiah Dan Indeks Harga Saham Regional Asia (Sti, Hang Seng, Nikkei) Terhadap Pergerakan Indeks Harga Saham Gabungan Di Bursa Efek Indonesia. *Jurnal Riset Akuntansi dan Auditing*, Vol. 4, No. 2, Desember 2013.
- Misgiyanti dan Zuhroh, I. (2009). Pengaruh Suku Bunga Luar Negeri Federal Reserve (The Fed), Nilai Tukar Rupiah/US \$ Dan Inflasi Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan Di Bursa Efek Indonesia Periode 2006-2008. *Jurnal Ekonomi Pembangunan*, Vol 7 No. 1 Juli 2009.
- Muharam, H. dan Nurafni, Z. (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.
- Mulyono. (2015). Analisa Korelasi Return Indeks – Indeks Saham Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan Pada Bursa Efek Indonesia. *Binus Business Review* Vol. 6 No.2 Agustus 2015: 330-339.
- Mutakif, F. dan Nurwulandari, A. (2012). Pengaruh Volume Perdagangan Saham, Nilai Tukar Dan Indeks Hang Seng Terhadap Pergerakan Indeks Harga Saham Gabungan. *Jurnal Akuntansi & Bisnis*, Vol. 7, No. 2, Juli 2012.
- Narayan, S. dan Narayan, P. K. (2012). Do US macroeconomic conditions affect Asian stock markets?. *Journal of Asian Economics* 23, 669–679.
- Nurazi, R., Kananlua, Zulkarnain, I., dan Usman, B. (2013). Analisis Hubungan Kointegrasi dan Kausalitas Serta Hubungan Dinamis Antara Shanghai Composite Index (SHCOMP) China dan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Indonesia. *Laporan Penelitian Hibah Jurusan Manajemen*. Fakultas Ekonomi Dan Bisnis Universitas Bengkulu.
- Nurhayati, N. (2013). Analisis Faktor-Faktor yang Mempengaruhi Core Inflation di Indonesia. Skripsi. Fakultas Ekonomi Dan Manajemen Institut Pertanian Bogor.
- Pantas, P. E. Guncangan Variabel Makroekonomi Terhadap Jakarta Islamic Index (JII). *CAKRAWALA: Jurnal Studi Islam*, Vol. XII, No. 1, 2017.
- Rosadi, D. (2012). *Ekonometrika & Analisis Runtun Waktu Terapan dengan EViews*. Andi, Yogyakarta.
- Rudiyanto. (2017). Suku Bunga The Fed Naik, Harusnya IHSG Naik Atau Turun? <http://rudiyanto.blog.kontan.co.id/2017/03/17/suku-bunga-the-fed-naik-harusnya-ihsg-naik-atau-turun/>, diakses pada 6 Juli 2018.
- Sani, G. A. (2012). Uji Kausalitas VAR Toda-Yamamoto Antara Variabel Makro Ekonomi dengan Pasar Modal Syariah dan Pasar Uang Syariah di Indonesia Tahun 2002-2011 (Studi Kasus JII dan SBIS). *Skripsi*. Fakultas Ekonomi Program Ekstensi Manajemen Kekhususan Keuangan Syariah Universitas Indonesia, Salemba.
- Sarwar, G. (2012). Is VIX an investor fear gauge in BRIC equity markets? *J. of Multi. Fin. Manag.* 22 (2012) 55–65.
- Sidiq, A. (2010). Pengaruh Indeks Saham STI, TAIEX, KOSPI, Hang Seng Terhadap Pergerakan Indeks Saham Gabungan Pada BEI. *Riset Manajemen dan Akuntansi Volume 1 Nomor 2 Edisi November 2010*.

- Seputar Forex. (2018). Harga Minyak Bumi Hari Ini. Tersedia di [http://www.seputarforex.com/data/harga\\_minyak/](http://www.seputarforex.com/data/harga_minyak/), diakses pada 3 Maret 2018.
- Soebagiyo, D. (2007). Kausalitas Granger PDRB Terhadap Kesempatan Kerja di Provinsi Dati I Jawa Tengah. *Jurnal Ekonomi Pembangunan*, 8 (2), 177-192.
- Soemitra, A. (2009). *Bank & Lembaga Keuangan Syariah*. Prenada Media, Jakarta.
- Soeprajitno, H. (2017). Biasakan Diri dengan Perekonomian yang Kian Anomali. Tersedia di <http://marketeers.com/49434-2/>, diakses pada 22 November 2018.
- Sumuya, B., Yang, Y., Yang, X., dan Sun, L. (2018). Econometric testing on linear and nonlinear dynamic relation between stock prices and macroeconomy in China. *Physica A* 493, 107–115.
- Sutanto, B., Murhardi, W. R., dan Ernawati, E. (2013). Analisis Pengaruh Ekonomi Makro, Indeks Dow Jones, dan Indeks Nikkei 225 Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) di BEI Periode 2007-2011. *Calyptra: Jurnal Ilmiah Mahasiswa Universitas Surabaya Vol.2 No.1 (2013)*
- Suwanda, H. (2011). Tetap Untung Ketika Saham Turun. PT. Gramedia Pustaka Utama, Jakarta.
- Syarofi, 2014. Analisis Pengaruh Suku Bunga SBI, Kurs Rupiah/US\$, Harga Minyak Dunia, Harga Emas Dunia, DJIA, Nikkei 225, dan Hang Seng Index Terhadap IHSG Dengan Metode GARCH-M (Periode Januari 2003-Mei 2013). *Skripsi*. Universitas Diponegoro.
- Tandelilin, E. (2017). *Pasar Modal, Manajemen Portofolio dan Investasi*. Kanisius, Yogyakarta.
- Wicaksono, I. S. dan Yasa, G. W. (2017). Pengaruh Fed Rate, Indeks Dow Jones, Nikkei 225, Hang Seng Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan. *E-Jurnal Akuntansi Universitas Udayana Vol.18.1. Januari (2017): 358-385*.
- Widarjono, A. (2013). *Ekonometrika Pengantar dan Aplikasinya Disertai Panduan Eviews*. UPP STIM YKPN, Yogyakarta.
- Widodo, R., Musriha, dan Istanti, E. (2017). Pengaruh Suku Bunga SBI, Standart & Poor's 500 dan Indeks Nikkei 225 Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Di Bursa Efek Indonesia (BEI). *Jurnal Manajemen Branchmark Vol 3 Issue 3, 2017*
- Wijayaningsih, R., Rahayu, S. M., dan Saifi, M. (2016). Pengaruh BI Rate, Fed Rate, Dan Kurs Rupiah Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) (Studi Pada Bursa Efek Indonesia Periode 2008-2015). *Jurnal Administrasi Bisnis (JAB) Vol. 33 No. 2 April 2016*.
- Yusuf, M. (2017). Analisis Kausalitas Perdagangan Internasional Dengan 3 Kebijakan Nilai Tukar (Studi Kasus 10 Negara). *Skripsi*. Fakultas Ekonomi Dan Bisnis Universitas Brawijaya, Malang.