

## DAFTAR PUSTAKA

- Aristanto, Eko, 2003, “Pengaruh Faktor Fundamental Perusahaan dan Faktor Fundamental Ekonomi Terhadap Risiko Investasi Pada Saham Sektor Perbankan Yang Go-Public Di Bursa Efek Jakarta Periode 1994-1999”, *Jurnal Penelitian Ilmu-ilmu Sosial*, Vol 14 No. 1, p. 497 – 513
- Cooper, DR and Schindler, PS, 2001, “*Business Research Methods*”, International Edition, McGraw Hill Companies, Inc.
- Firmansyah, Erry, 2002, “Peluang Industri telekomunikasi di Indonesia serta Kinerja Saham – Saham Telekomunikasi di BEJ”, seminar Masyarakat Telematika Indonesia
- Ginting, M.A., 1997, “Analisis Beberapa Faktor yang Mempengaruhi Harga Saham Perbankan di BEJ”, Laporan Interenship, Program MM UGM Yogyakarta, Tidak dipublikasikan.
- Groenewold, N and Fraser, P, 1997, “*Share Prices and Macroeconomic Factors*”, *Journal of Business Finance & Accounting*, 24(9) & (10), p. 1367 - 1383
- Gruber, 1995, “*Modern Portofolio Theory And Investment Analysis*”, 5th ed. John Wiley & Sons, Inc.
- Gudono, 1999, ”Penilaian Pasar Modal Terhadap Fluktuasi Bisnis Real Estat,” *Kelola Gadjah Mada University Business Review*, VIII, No. 20, hal. 42-53.
- Gujarati, DN, 2003, “*Basic Econometrics*” 4<sup>th</sup> ed, International Edition, Mc Graw Hill Companies, inc.
- Hermanto, B. 1999, “Pasar modal : Harga tidak mencerminkan informasi” *Usahawan* 27, hal. 53-55.
- Hondroyiannism G and Papapetrou, E, 2001, “*Macroeconomic Influences on the Stock Market*”, *Journal of Economic and Finance*, Vol.25 No.1, p.33 - 49
- Husnan, S, 1994, “Investasi di Pasar Modal Indonesia: Perkembangan, Kecenderungan, Kebutuhan, dan Prospek”, *Kelola MM UGM Yogyakarta*, III, No. 7, hal. 101-113.
- Husnan, S, 1998, “Dasar-dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas” edisi ketiga, Unit Penerbit dan Percetakan AMP YKPN, Yogyakarta.

- Jones, C.P, 2002, “*Investment Analysis and Management*” 8<sup>th</sup> ed, John Wiley & Sons, Inc.
- Lind, D.A, Marchal, W.G and Mason, R.D, 2002, “*Statistical Techniques in Business & Economics*”, 11<sup>th</sup> ed, International Edition, McGraw-Hill Irwin Company, Inc
- Laporan Statistik Bulanan Bursa Efek Jakarta; Januari 1997 s/d September 2003
- Laporan Statistik Bulanan, Statistik Ekonomi dan Keuangan Indonesia; Januari 1997 s/d September 2003, Bank Indonesia.
- Lembaga Penelitian Ekonomi IBII, Jakarta, 2002, “Makro Ekonomi Indonesia”, PT Gramedia Pustaka Utama, Jakarta.
- Purba, Herdianto; 2001; “Analisis faktor – faktor yang mempengaruhi harga saham di industri tekstil dan garmen sebelum dan selama krisis”, Laporan Interenship, Program MM UGM Yogyakarta, Tidak dipublikasikan.
- Putu, Gede A.S., 2000, “*Foundation of Our Capital Market*” Schroy, J ed, Yayasan SAD Satria Bahkti publisher, Jakarta.
- Roll, R and Ross, S.A, 1975-1984, “*The Arbitrage Pricing Theory Approach to Strategic Portfolio Planning*” Financial Analysis Journal, January-February 1995, p.122-131
- Ross, S.A., and Roll, R., 1980, “*An Empirical Investigation of the Arbitrage Pricing Theory*”, *Journal of Finance*, December, pp.1073-1103.
- Sharpe, W.F., Alexander, G.J., Bailey, J.V., 1999, *Investments*, Sixth Edition, Prentice-Hall International, Inc. International Edition, New Jersey.
- Subagyo, 1998, “Pengaruh Beberapa Indikator Ekonomi Makro Terhadap Harga - Harga Saham: *Studi Kasus Pada Pasar Modal di Jakarta, Singapura, Manila dan Kuala Lumpur*”, Laporan Interenship, Program MM UGM Yogyakarta, Tidak dipublikasikan.
- 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 2 No.3, September 2002, p.81-97

- Susanti, Hera; Moh. Ikhsan dan Widyanti 1995, “Indikator-indikator Makroekonomi” Lembaga Penerbit Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia dan Lembaga Penyelidikan Ekonomi dan Masyarakat Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia, Jakarta.
- Tandelilin, E., 2001, *Analisis Investasi dan Manajemen Portofolio*, Edisi Pertama, BPFE Yogyakarta.
- Tambunan, Tulus T.H., 1998, “Krisis Ekonomi Indonesia Penyebab & Penanggulangannya”, LP3E – Kadin Indonesia dan Yayasan Indonesia Forum, Jakarta.
- The Economist Intelligence Unit Limited, 2002, “Country Forecast for Indonesia at a glance: 2003-04”, Patersons Dartford, Questor Trade Park, 151 Avery Way, Dartford, Kent DA1 1JS, United Kingdom.
- Usman, Marzuki 1997, “Langkah-langkah reformasi keuangan dan moneter sebagai jembatan menuju globalisasi” makalah dalam acara Rapat Kerja Nasional (Rakernas) dan Rapat Pimpinan Nasional (Rapimnas) Kadin Indonesia, 10 Desember, Jakarta.