

## DAFTAR PUSTAKA

- Adrian (2011). “Analisis Faktor-faktor yang mempengaruhi Peringkat Obligasi pada Perusahaan Manufaktur yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia”.
- Aizenman, J., M., Hutchison, and T., Jinjark (2013). What is the Risk of European Sovereign Debt Defaults? Fiscal Space, CDS Spreads and Market Pricing of Risk. *Journal of International Money and Finance* 34: 37–59.
- Algifari (1997). “Analisis Statistik untuk Bisnis dengan Regresi, Korelasi dan Non Parametrik”. *Edisi Kesatu, Cetakan Pertama*. Yogyakarta
- Andry (2005). “Analisis Faktor – Faktor yang Mempengaruhi Prediksi Peringkat Obligasi”. *Buletin Ekonomi Moneter dan Perbankan*, September 2005.
- Arif (2012). “Pengaruh Manajemen Laba dan Rasio Keuangan Perusahaan Terhadap Peringkat Obligasi”. *Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro*.
- Asgharian, Chritiansen dan Hou (2015). “Macro – Finance Determinants of the Long Run Stock – Bond Correlation”
- Attinasi, M. G., C., Checherita, and C., Nickel (2011). “What Explains the Surge in Euro Area Sovereign Spreads During the Financial Crisis of 2007-2009?.” *In R.W. Kolb (ed.), Sovereign Debt: From Safety to Default. New Jersey: John Wiley & Sons*.
- Baele, Bekaert dan Inghelbercht (2010). “The Determinants of Stock and Bond Return Co Movement”
- Bikbov, R. and M., Chernov (2010). No-arbitrage Macroeconomic Determinants of the Yield Curve. *Journal of Econometrics* 159: 166–182.
- Boffeli, Skintzi dan Urga (2015). “High- and Low-Frequency Correlations in European Government Bond Spreads and Their Macroeconomic Drivers”
- Brigham dan Houston (2010). “Dasar – Dasar Manajemen Keuangan”. Jakarta
- Bunaidy (2012). “Analisis Deskriptif Likuiditas Obligasi Pemerintah Republik Indonesia”
- Cheng dan Ryan (2002). “Predicting Stock-Bond Correlations”
- Cieslak dan Povala (2015). “Expected Return in Treasury Bonds”

- Demana, Safitri, dan Aprilia (2013). “Analisis Pengaruh Coupon (Bunga Obligasi), Jangka Waktu Jatuh Tempo, dan Liquiditas Obligasi Terhadap Tingkat Perubahan Harga Obligasi yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia”. *Jurusan Manajemen STIE MDP*.
- Dunne, Moore, dan Portes (2003). “Defining Benchmark Status: An Application Using Euro – Area Bonds”. *Working Paper No. 9087, NBER*.
- Hair, Anderson, Tatham dan Black (1998). “Multivariate Data Analysis”. *New Jersey: Prentice Hall*
- Hidaya (2017). “Uji Autokorelasi dengan SPSS – Durbin Watson”.
- Ghazali (2005). “Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS”. *Badan Penerbit Universitas Diponegoro. Semarang*.
- Gunawan Sumodiningrat (1996). “Ekonomitrika Pengantar”. *BPFE UGM. Jogjakarta*.
- Indonesia Bond Pricing Agency (2014 – 2016). “*Laporan Tahunan IBPA 2014 – 2016*”.
- Krisnilasari (2007). “Analisis Pengaruh Likuiditas Obligasi, Coupon dan Jangka Waktu Jatuh Tempo Obligasi Terhadap Perubahan Harga Obligasi di Bursa Efek Surabaya”. *Program Studi Magister Manajemen Program Pascasarjana Universitas Diponegoro Semarang*.
- Kuncoro (2009). “Metode Riset untuk Bisnis & Ekonomi. Penerbit Erlangga Jakarta.
- Kusumawati (2014). “Analisis Pengaruh Pengumuman Perubahan Bond Rating Terhadap Return Saham”. *Fakultas Ekonomika dan Bisnis Universitas Diponegoro, Semarang*.
- Ludvigson dan Ng (2009). “Macro Faktors in Bond Risk Premia”
- Maharti (2011). “Analisis Faktor-faktor yang Mempengaruhi Peringkat Obligasi”.
- Pakarinti (2012). “Analisis Pengaruh Kepemilikan Manajerial, Kepemilikan Institusional, Likuiditas dan Leverage Terhadap Peringkat Obligasi pada Perusahaan Go Public yang terdaftar di BEI”.
- Qoyum (2009). “Analisis Perbandingan Kinerja Kelompok Obligasi Syariah dengan Kelompok Obligasi Konvensional di Indonesia Periode 2004 – 2006”.

*Program Studi Keuangan Islam Jurusan Mu'Amalah Fakultas Syari'ah  
Universitas Islam Negeri Sunan Kalijaga.*

Sari (2007). "Kemampuan Rasio Keuangan Sebagai Alat untuk Memprediksi Peringkat Obligasi (PT Pefindo). *Jurnal Bisnis dan Ekonomi (JBE) Vol 14. No.2, September 2007, Hal 172 – 182.*

Saunders dan Cornett (2008). "Financial Institution Management: A Risk Management Approach 6<sup>th</sup> Edition". *The McGraw – Hill/Irwin Series in Finance, Insurance, and Real Estate. New York*

Schwert, G. W. (1989). "Why Does Stock Market Volatility Change Over Time?". *The Journal of Finance 44: 1207–1239.*

Sugiyono (1999). "Metode Penelitian Bisnis". Jakarta

Yasa (2010). "Pemeringkatan Obligasi Perdana Sebagai Pemicu Manajemen Laba: Bukti Empiris dari Pasar Modal Indonesia"

Yuniati (2012). "Analisis Hubungan Struktur Kepemilikan dan Ukuran Perusahaan dengan Peringkat Obligasi". *Fakultas Ekonomi Program Studi Ekstensi Akutansi Universitas Indonesia.*

Wijaya (2014). "Pengaruh Tingkat Bunga Pasar, Tingkat Bunga Kupon dan Waktu Jatuh Tempo Obligasi Terhadap Harga Obligasi di Bursa Efek Indonesia".

William (2006). "*The Research Methods Knowledge Base, 2<sup>nd</sup> Edition*".

Zuhrohtun dan Baridwan (2006). "The Effect of Ratings Announcement on Bond Performance". *Program Studi Ilmu Akutansi Sekolah Pascasarjana Universitas Gadjah Mada, Yogyakarta*