

DAFTAR PUSTAKA

- Altay, Erdinç. 2003. *The Effect of Macroeconomics Factors on Asset Returns : A Comparative Analysis of The German and The Turkish Stocks Markets In An APT Framework*. Martin-Luther_Universität Halle-Wittenberg.
- Ardiansyah, Firman. 2005. *Analisis Pengaruh Perubahan Variabel Makro Ekonomi, Return Pasar dan Indeks Harga Konsumen Obat Terhadap Kinerja Saham Sektor Farmasi (Studi Empiris BEJ Januari 2000-Juni 2005)*. Tesis. Universitas Indonesia.
- Bodie, Kane, dan Marcus. *Investments*. 7th Edition. McGraw-Hill International Edition. 2008.
- Chen, Roll and Ross. 1998. *Economic Forces and Stock Market*. Journal of Business, vol.59,3.
- Dewi, Andam. 2006. *Analisis Penggunaan Capital Asset Pricing Model dan Arbitrage Pricing Theory Dalam Memprediksi Return Saham Kelompok Jakarta Islamic Index*. Tesis. Institut Pertanian Bogor.
- Dermoredjo,S.K. 2003. *Analisis Kebijakan Hubungan Antarsektor Perekonomian Nasional*. Analis Kebijakan Pertanian, Pusat Penelitian dan Pengembangan Pertanian, Bogor.345-362
- Energy Information. http://tonto.eia.doe.gov/dna/pet/pet_pri_spt_s1d.htm/
- Febrian dan Herwany. 2007. *CAPM and APT Validation Test Before, During, and After Financial Crisis in Emerging Market :Evidence From Indonesia*. The Second Singapore International Conference on Finance, Singapore on 19 and 20 July.
- Gruber, Elton. 1995. *Modern Portfolio Theory and Investment Analysis*. 5th Edition. John Wiley & Sons, Inc. Canada.
- Halim, Abdul. 2003. *Analisis Investasi*. Penerbit Salemba Empat. Jakarta.
- Hidayat, Eko Prasetyo. 2009. *Analisis Faktor-Faktor Eksternal Yang Mempengaruhi Harga Saham Pada Sektor Perbankan di Pasar Modal*. Surabaya.
- H.M, Jogiyanto. 2000. *Teori Portfolio dan Analisis Investasi*. 2th Edition. BPFE. Yogyakarta.

- Kardiman. 2002. *Analisis Pengaruh Gejolak Politik dan Regulasi Terhadap Gejolak Ekonomi Moneter di Indonesia*. Disertasi. Institut Pertanian Bogor.
- Krisdjoko, Dewiyanti. 2000. *Pengujian Model APT Dalam Mengatur Pengaruh Faktor Makroekonomi Terhadap Return Saham Sektor Berbasis Sumberdaya Alam, Kasus Bursa Efek Jakarta*. Tesis. Universitas Indonesia.
- Moerdinafitrasari, Donna. 2003. *Analisis Pengaruh IHSG, SBI dan Kurs Terhadap Return Saham-Saham Sektor Consumer Goods di Bursa Efek Jakarta*. Tesis. Universitas Indonesia.
- Nachrowi dan Usman. 2006. *Ekonometrika Untuk Analisis Ekonomi dan Keuangan*. Lembaga Penerbit Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia.
- Nawatmi, Sri. 2001. *Penentuan Nilai Tukar Melalui Model Hybrid*. Jurnal Bisnis Ekonomi.
- Nurfirman, Panji. 2001. *Analisis Pergerakan Nilai Tukar Rupiah Terhadap US Dollar*. Tesis. Universitas Indonesia.
- Paavola, Mauri. 2006. *Test of The Arbitrage Pricing Theory Using Macroeconomic Variabels in The Russian Equity Market*. Bachelor's thesis. Lappeenranta University of Technology.
- Palupi, Dyah Santi. 2007. *Dampak Pelaporan Rugi Selisih Kurs Terhadap Harga Saham Pada Perusahaan Publik di Indonesia*. Universitas Brawijaya.
- Panutur, Sonny Sintong. 2004. *Pengaruh Variabel Makro, Return Pasar, dan Karakteristik Industri Terhadap Kinerja Saham Industri Restoran, Hotel, Pariwisata, Printing, Advertising dan Media (Penelitian Empiris di BEJ Periode 1998 sampai 2003)*. Tesis. Universitas Indonesia.
- Premananto dan Madyan. 2005. *Perbandingan Keakuratan Capital Asset Pricing Model dan Arbitrage Pricing Theory Dalam Memprediksi Tingkat Pendapatan Saham Industri Manufaktur Sebelum dan Semasa Krisis Ekonomi*. Universitas Airlangga.
- Putri, Nellia. 2003. *Analisa Faktor yang Mempengaruhi Indeks Harga Saham Consumer Goods di Bursa Efek Jakarta*. Tesis. Universitas Indonesia.

- Prihantono, Boedi Prasetyo. 2006. *Analisa Pengaruh Variabel Makro, Return Pasar, dan Karakteristik Industri Terhadap Return Saham Perbankan di Bursa Efek Jakarta (Penelitian Empiris di BEJ tahun 2002-2006)*. Tesis. Universitas Indonesia.
- Purwanta dan Fakhrudin. 2006. *Mengenal Pasar Modal*. Salemba Empat. Jakarta.
- Riyatno, M.Y Dedi Haryanto. 2007. *Pengaruh Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia dan Nilai Kurs Terhadap Risiko Sistematis Saham Perusahaan di BEJ*. Jurnal Keuangan dan Bisnis, vol 5, no.1, 24-40.
- Sampora, Wahyuni. 2006. *Faktor-Faktor Ekonomi Makro yang Mempengaruhi Tingkat Imbal Hasil Saham di Bursa Efek Jakarta Suatu Model Penilaian Dengan Pendekatan Arbitrage Pricing Theory (APT)*. Tesis. Universitas Lampung.
- Sihaloho, Tommi Efendi Patuluan. *Analisis Nilai Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG), Indeks LQ 45 dan Indeks Saham Sektor Keuangan Akibat Kenaikan Harga Bahan Bakar Minyak (BBM) di Bursa Efek Jakarta*. Tesis. Universitas Lampung.
- Simatupang P,S.Mardianto,K.Kariyasa dan M.Maulana. 2005. *Fluktuasi Pelaksanaan Dan Harga Pembelian Pemerintah (HPP) Gabah Tahun 2005 Dan Perspektif Penyesuaian Tahun 2006*. Analis Kebijakan Pertanian (AKP) Volume 3 Nomor 3, September 2005.
- Siringoringo, Hotniar. 2003. *Pemodelan Jumlah Uang Beredar*. Jurnal Ekonomi dan Bisnis No.3.
- Sitinjak, Elyzabeth Lucky Maretha dan Widuri Kurniasari. 2003. *Indikator-Indikator Pasar Saham Dan Pasar Uang yang Saling Berkaitan Ditinjau Dari Pasar Saham Sedang Bullish dan Bearish*. Jurnal Riset Ekonomi dan Manajemen, vol.3 no.3.
- Sitorus, Maurin. 2004. *Pengaruh Variabel Makroekonomi Terhadap Kinerja Saham Pertambangan Minyak dan Gas Bumi Sebagai Emiten di Bursa Efek Indonesia*. Jakarta.
- Tandelilin, Edwardus. 1997. *Determinants of Systematic Risk, The Experience of Some Indonesia Common Stock*. Kelola, no.16/IV.Hal 101-114.
- Yudanto, Noor dan Santoso, M. Setyawan. 1998. *Dampak Krisis Moneter Terhadap Sektor Riil*. Jakarta.

W. Cahyuttu Maully. 2006. *Analisis Rasio Keuangan Dan Pengaruhnya Terhadap Return Saham Pada Industri Farmasi yang Terdaftar di Bursa Efek Jakarta*. Skripsi.

Wahyudi, Sugeng. 2005. *Perubahan APBN dan Kinerja Bursa 2005*. Jakarta.

