

DAFTAR PUSTAKA

- Arini, Nisa Nur, Rikumahu, Brady. Iradianty, Aldilla. (2016). *Volatility Spillover Between USD-IDR Exchange Rate Changes And Indonesia Stock Index – APIAR. Vol.2 Hlm. 320-327*
- Artharini, Isyana. 2015. Nilai Tukar Rupiah Tembus Rp. 14ribu, Pemerintah didorong siapkan rencana darurat. [Online]. http://www.bbc.com/indonesia/berita_indonesia/2015/08/150824_indonesia_rupiah_anjlok. [akses 06 september 2016, 22:00]
- Bakari, Yuliana et.al. (2013). Analisis Volatilitas Harga, Transmisi Harga, dan Volatility Spillover pada Pasar Dunia Crude Palm Oil (CPO) dengan Pasar Minyak Goreng di Indonesia – AGRISE. Vol. 13 No.3. Hlm 255-265.
- BEI. (2010). *Buku Panduan Indeks Harga Saham Bursa Efek Indonesia*. Jakarta: Bursa Efek Indonesia.
- Bodie *et al.* (2014). *Manajemen Portofolio dan Investasi*, Edisi Kesembilan, Jilid 1. Jakarta: Salemba Empat
- Cooper, Donald R. & Schindler, Pamela S. (2011). *Business Research Methods. Eleventh Edition*. New York. McGraw Hil.
- Darmadji, Tjiptono dan Fakhruddin, Hendy M., 2011. *Pasar Modal di Indonesia Edisi 3*. Jakarta: Salemba Empat
- Dewiyanti, Gitasmara. (2009). *Global Meltdown : Contagion atau Interdependence: Analisis Dampak Kejatuhan Bursa Amerika dan Bursa Hongkong terhadap Bursa Indonesia Tahun 2008 dengan Pendekatan Volatility Spillover*. Universitas Indonesia
- Dornbusch, etc (2000:179-180) = Dornbusch, R., Park, Y. C., & Claessens, S. 2000. *Contagion: Understanding How It Spreads*. The World Bank Research Observer
- Gobel, Fariz. 2016. *Pengaruh Suku Bunga, Inflasi dan Kurs Terhadap IHSG*. [online]. <https://bursanom.com/pengaruh-suku-bunga-inflasi-dan-kurs-terhadap-ihsg/>. [September 07,2016 10.00]

- Hull, Jhon. C. (2015). *Risk Management and Financial Institution: Forth Edition*. Willey Finance Series.
- Kasmir. (2014). *Bank dan Lembaga Keuangan Lainnya*. Jakarta: Rajawali Pers.
- Kementerian PPN/Bappenas. 2013. *Perkembangan Ekonomi Indonesia*, Triwulan II Tahun 2013. Jakarta: Deputi Bidang Ekonomi.
- Keown et al. (2010). *Manajemen Keuangan: Prinsip dan Penerapan*, Edisi Kesepuluh, Jilid . Edisi Bahasa Indonesia: PT INDEKS
- Keown *et.al.* (2011). *Financial Management Principles and Applications: Eleventh Edition*. USA: Pearson
- Laporan Tahunan KSEI. (2015). *Expansion & Integration for Invesment Convenience*. Jakarta: PT. Kustodian Sentral Efek Indonesia.
- Lestano dan Sucito, Julia. (2010). Spillover Volatilitas Pasar Saham Indonesia dan Singapura Periode 2001-2005 – *Jurnal Akuntansi dan Keuangan*. Vol.13. No.1. Hlm 17-25.
- Masson (1998), Wolf (1999), Forbes dan Rigobon (2000), Pritsker (2000) dalam Dornbusch, R. Yung Chul Park, & Claessens, Stijn. (2000). Contagion : Understanding How It Spreads. The World Bank Research Observer, vol 15 (August 2000), pp. 177-197
- Mishra, Alok Kumar., Swain, Niranjan., Malhotra, D.K. (2007). *Volatility Spillover between Stock and Foreign Exchange Markets: Indian Evidence – International Journal Of Business*. Vol. 12 No.3. Hlm. 343-359
- Mozumder, Nurul., Vita, Glauco De., Kyaw, Khine S., and Larkin, Charles. 2015. *Volatility Spillover Between Stock Prices and Exchange Rates: New Evidenve Across the Recent Financial Crisis Period*. Economic Issues, Vol. 20. Part 1. 43-64.
- Nachrowi, Nachrowi dan Usman, Hardius. (2006). Pendekatan Populer dan Praktis EKONOMETRIKA untuk Analisis Ekonomi dan Keuangan. Jakarta: Lembaga Penerbit Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia
- Nawatmi, Sri. (2012). *Volatilitas Nilai Tukar dan Perdagangan Internasional – Dinamika Akuntansi dan Keuangan dan Perbankan*. Vol. 1 No. 1. Hlm 41-56.

- Palakkod, Suhail. (2012). *Integration of Capital, Commodity, and Currency Markets: A Study on Volatility Spillover – The Romanian Economic Journal*. Year XV. No.44. Hlm 87-98.
- Polancik, Gregor. (2009). *Empirical Research Method Poster*. Jakarta:
- Reilly, Frank K. dan Brown, Keith C. 2012. *Investment Analysis & Portofolio Management (10th Edition)*. USA : South-Western Cengage Learning
- Sartono, Agus. (2012). *Manajemen Keuangan Internasional*. Yogyakarta: BPFE.
- Sekaran, U. and Bougie, R. 2010. *Research Method for Business, A Skill Building Approach*. Singapore: Fifth Edition John Wiley & Sons Inc.
- Sugiyono. 2012. *Metode Penelitian Pendidikan (Pendekatan Kuantitatif, Kualitatif, dan R&D)*. Bandung: ALFABETA.
- Sweeting, Paul. (2011). *Financial Enterprise Risk Management*. UK: Cambrige
- The World Bank. 2014. *Laporan Triwulan Perekonomian Indonesia Desember 2014: Membawa Perubahan*. [online]. <http://www.worldbank.org/in/news/feature/2014/12/08/indonesia-economic-quarterly-december-2014> [akses September 07,2016 10.00]
- Trihadmini Nuning. (2011). *Contagion Dan Spillover Effect Pasar Keuangan Global Sebagai Early Warning System*. Finance and Banking Journal, Vol. 13 No. 1 Juni. 47-61
- Undang-undang No. 8 Tahun 1995, tentang Pasar Modal
- User. 2013. *Perkembangan Internasional 2013: III*. [online] <http://macroeconomicdashboard.feb.ugm.ac.id/perkembangan-internasional-2013-iii/> [akses September 07,2016 10.00] Sumber: Badan Pusat Statistik dan CEIC (2013)
- Widoatmodjo. (2015). *Pengetahuan Pasar Modal Untuk Konteks Indonesia*. Jakarta: PT. Elex Media Komputindo.
- Winarno, Wing Wahyu. (2015). *Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan EViews* (edisi keempat). Yogyakarta: UPP STIM YKPN.
- Wira, Desmond. (2011). *Analisis Fundamental Saham*. Jakarta: Exceed.
- Wiryono, Sudarso Kaderi dan Widjonarko, Yohanes Edward. (2009). *Volatility Spillover between Stock Market and Foreign Exchange Market in Indonesia*

–*School of Business and Management* Institut Teknologi Bandung. Vol. 8
No.2.

Zikmund, William G. *et al.* (2010). *Business Research Methods (Eight Edition)*.
Cengage Learning. South-Western.

<http://www.bi.go.id/id/moneter/informasi-kurs/Contents/Default.aspx> [17
September 2016 13:01]

[http://www.idx.co.id/id-
id/beranda/informasi/bagiinvestor/pengantarpasarmodal.aspx](http://www.idx.co.id/id-id/beranda/informasi/bagiinvestor/pengantarpasarmodal.aspx) [17 September
2016 13:10]