

DAFTAR PUSTAKA

1. Anastasia, Njo, Gunawan, Yanny Widiastuty dan Wijiyanti, Imelda, 2003, Analisis Faktor Fundamental dan Risiko Sistematis Terhadap Harga Saham Properti di Bursa Efek Jakarta, *Jurnal Akuntansi dan Keuangan Universitas Kristen Petra* Volume 5 No. 2, November 2003, 123-132.
2. Asyah, Siti, *Analisis Pengaruh Beberapa Faktor Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan Pada Perusahaan Go Public di Indonesia 1983-1987*, Fakultas Pascasarjana Universitas Gajah Mada Yogyakarta, 1990.
3. Daniel Pena, George C. Tiao, Ruey S. Tsay., *A Course in Time Series Analysis*, Canada, Jhon Wiley & Sons, Inc., 2001.
4. Fama, E.F., *Efficient Capital Market: A Review of Theory and Empirical Works*, New York, McGraw-Hill/Irwin, 1970.
5. Foster, *Financial Statement Analysis*, New Jersey, Princeton Hall, Inc., 1986.
6. Frank R. Giordano, Maurice D. Weir, *A First Course in Mathematical Modeling*, USA, Brooks/Cole Publishing Company, 1997.
7. George, E.P. Box., Gwilym M. Jenkins, *Time Series Analysis, forecasting and control*, third Edition, USA, Printice Hall, Inc., 1994.
8. Gujarati, D., *Basic Econometrics*, 4th edition, New York, McGraw-Hill/Irwin, 2003.
9. Hartono, Jogiyanto, *Pasar Efisien Secara Keputusan*, Jakarta, Gramedia Pustaka Utama, 2005.
10. Husnan, Suad, *Dasar-Dasar Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas* Edisi Ketiga Cetakan Ketiga, Yogyakarta, Unit Penerbit dan Percetakan AMP YKPN, 2003.
11. James D. Hamilton., *Time Series Analysis*, New Jersey, Princeton University Press, 1994.
12. Jonathan D. Cryer., *Time Series Analysis*, Boston, PWS-KENT Publishing Company, 1996.
13. Jusuf Anwar., *Pasar Modal Sebagai Sarana Pembiayaan Dan Investasi*, Bandung, P.T. ALUMNI, 2005.

14. Kamaruddin Ahmad., *Dasar Dasar Manajemen Investasi dan Portofolio*, Jakarta, Rineka Cipta, 2004.
15. Katz, David A., *Econometric Theory and Applications*, Englewood Cliffs, N.J., Prentice Hall Inc., 1982.
16. Koutsoyiannis, A., *Theory of Econometrics*, London & Basingstoke, The Macmillan Press Ltd., 1978.
17. Lains, Alfian, *Ekonometrika Teori dan Aplikasi*, Jilid I, Jakarta, Pustaka LP3ES Indonesia, 2003.
18. Lains, Alfian, *Ekonometrika Teori dan Aplikasi*, Jilid II, Jakarta, Pustaka LP3ES Indonesia, 2006.
19. Manurung, Jonni J., Manurung, Adler Haymans dan Saragih, Ferdinand Dehoutman, *Ekonometrika, Teori dan Aplikasi*, Jakarta, Elex Media Komputindo, 2005.
20. Muslim, Noor, *Analisis Struktur Dinamis Indeks LQ45 di Bursa Efek Jakarta 1994-2004 : Pendekatan VAR*, Fakultas Pascasarjana Universitas Borobudur, 2005.
21. Nachrowi D Nachrowi., *Pendekatan Populer dan Praktis EKONOMETRIKA Untuk Analisa Ekonomi dan Keuangan*, Jakarta, Lembaga Penerbit Fakultas Ekonomi Universitas Indonesia, 2006.
22. Saadah, Siti, Estimasi Pergerakan Harga Saham Indosat Menggunakan Model ARIMA, *Jurnal Ekonomi Universitas Borobudur*, Volume 20, Februari 2006, 97-105.
23. Setiawan, Doddy dan Hartono, Jogiyanto, *Pengujian Efisiensi Pasar Bentuk Setengah Kuat secara Keputusan: Analisis Pengumuman Dividen Meningkat*, Semarang, Simposium Nasional Akuntansi V, 2002.
24. Steven, Sisilia, *Analisis Beberapa Faktor Yang Mempengaruhi Harga Saham Kelompok Perusahaan Yang Go Public Di Pasar Modal Indonesia Sebelum dan Sesudah Paket Kebijakan Deregulasi 1987-1990*, Fakultas Pascasarjana Universitas Gajah Mada Yogyakarta, 1991.
25. Subiyantoro, Edi dan Andreani, Fransisca, Analisis Faktor-Faktor yang Mempengaruhi harga saham (Kasus Perusahaan Jasa Perhotelan yang Terdaftar di Pasar Modal Indonesia), *Jurnal Manajemen dan Kewirausahaan, Universitas Kristen Petra* Volume 5 No. 2 September 2003, 171-180.

26. Sugiyono, *Statistika untuk Penelitian*, Cetakan Kedelapan, Bandung, Penerbit CV Alfabeta, 2005.
27. Supranto, *Proposal Penelitian dengan Contoh*, Jakarta, Penerbit Universitas Indonesia, 2004.
28. Surya, Yohanes dan Hariadi Yun, GARCH (2,1) Pada LQ45, *Available from: <http://www.ekonofisika.com>*.
29. Suryanto, *Analisis Pengaruh Faktor Ekonomi dan Politik Terhadap Harga Saham Gabungan Pada Bursa Efek Jakarta*, Fakultas Pascasarjana Universitas Borobudur, 2004.
30. Tjiptono Darmadji, Hendy M. Fakhruddin., *Pasar Modal di Indonesia, Pendekatan Tanya Jawab*, Jakarta, Salemba Empat, 2006.
31. Walter Enders., *Applied Econometric Time Series*, USA, Jhon Wiley & Sons, Inc., 1995.
32. Wulan, *Pengaruh Variabel-variabel Fundamental dan Teknikal Terhadap Harga Saham*, Jurusan Ekonomi Pembangunan Fakultas Ekonomi Universitas Negeri Malang, Malang, 2005, *Available from: <http://www.ekofeum.or.id>*.

