

DAFTAR PUSTAKA

- Accounting for Foreign Currency Transactions*, (online) (<http://financial.education.com/2007/09/19/accounting-for-foreign-currency-transactions/>, diakses tanggal 12 November 2010)
- Agus. 2005. Validitas Penggunaan CAPM di dalam Memprediksi Return Saham di BEJ dengan Data 3 Tahunan, Jurnal FE-UM Online
- Ajayi, R.A and M. Mougoue. 1996. *On The Dynamic Relation Between Stock Prices and Exchange Rate*. Journal of Finance Research. 19:193-207
- Antara, Made dan Lestari, Putu Indah. 2007. Faktor-faktor yang mempengaruhi Kinerja saham perusahaan agribisnis di bursa efek jakarta: Pendekatan *structural equation modeling* (laporan penelitian). Universitas Udayana: Bali
- Arianto, Efendi. 2007. Pengujian Standard CAPM di Bursa Efek Jakarta, Pengamatan Selama Periode 1994-1995, (online) (<http://www.strategika.wordpress.com>, diakses tanggal 29 Juni 2010)
- Arixs. 2008. Beta Saham, (online) (<http://arixsthecoolest.blogspot.com>, diakses tanggal 29 Juni 2010)
- Athanasoglou, P.p., Brissimis, S.N. & M.D. Delis. 2005. *Bank Specific, Industry Specific and Macroeconomic Determinants of Bank Profitability*. Bank of Greece Working Paper 25, June
- Brigham, F. Brigham and Michael C. Ehrhardt. 2008. *Financial Management 12e: Return, Risk and The CAPM*. Thomson Higher Education: USA
- Bursa Efek Indonesia. 2007. *IDX Monthly Statistics December 2007, Vol. 16 No.12*. Indonesia Stock Exchange Research & Development Division. Jakarta
- _____. 2008. *IDX Monthly Statistics December 2008, Vol. 17, No.12*. Indonesia Stock Exchange Research & Development Division. Jakarta

- _____. 2009. *IDX Monthly Statistics December 2009, Vol. 18, No.12. Indonesia Stock Exchange Research & Development Division.* Jakarta
- Fabozzi, E.J and Francis, J.C. 1996. *Capital Markets and Institution and Instrument.* Upper Saddle River New Jersey
- Fitriyanto, Dwi. 2008. Analisis Faktor-faktor Yang Mempengaruhi ROE Perbankan Swasta di Indonesia tahun 2005, 2006, 2007 (tesis). Universitas Muhammadiyah Surakarta: Surakarta
- Frensidy, Budi. 2009. *Ada Apa Dengan Hipotesis Pasar Efisien.* INAplis: Jakarta
- Ghozali, Imam.2005. Aplikasi Analisis Multivariat Dengan Program SPSS. Semarang: Badan Penerbit Universitas Diponegoro Semarang
- Gujarati, Damodar. 2005, *Basic Econometrics 3th Edition.* Mc-Graw Hill, Inc: New York
- Gupta, Jyoti P., Alain Chevalier and Fran Sayekt. 2000. *The Causality Between Interst Rate, Exchange Rate and Stock Price in Emerging Market: The Case of The Firm Jakarta Stock Exchange. Working Paper Series.* EFMA 2000: Athens
- Hernendiastoro. 2005. Pengaruh Kinerja Perusahaan dan Kondisi Ekonomi Terhadap Return Saham Dengan Metode Intervalling (Tesis). Program Pasca Sarjana Universitas Diponegoro: Semarang
- HS, Johny. 2009. *Bentuk Pasar Efisien dan Pengujiannya.* Jurnal
- Ichsan, Fauzi. 2008. Menakar Dampak Krisis Finansial Global. Kumpulan artikel : Jakarta
- Junaidi. 2010. Tabel *Durbin-Watson* (DW), $\alpha = 5\%$, (online) (<http://www.junaidichaniago.wordpress.com>, diakses tanggal 12 November 2010)
- Junaidi. 2010. Titik Persentase Distribusi F: Probabilitas 0,05, (online) (<http://www.junaidichaniago.wordpress.com>, diakses tanggal 12 November 2010)

- Junaidi. 2010. Titik Persentase Distribusi $t: d.f = 1-200$, (online) (<http://www.junaidichaniago.wordpress.com>, diakses tanggal 12 November 2010)
- Kurs Uang Kertas Asing Mata Uang USD, (online) (<http://www.bi.go.id>, diakses tanggal 29 Juni 2010)
- Kuncoro, Mudrajad. 2000. Metode Kuantitatif Edisi Pertama. AMP YKPN: Yogyakarta
- Kusneri, Uung. 2002. Beta Saham LQ45: Suatu Perbandingan Pada Periode Bullish dan Periode Bearish untuk Saham-saham yang tercatat di Bursa Efek Jakarta (Tesis). Program Pasca Srajana, Universitas Diponegoro: Semarang
- Laporan Inflasi, (online) (<http://www.bi.go.id>, diakses tanggal 29 Juni 2010)
- Indonesia Stock Exchange. 2010. Buku Panduan Indeks Harga Saham Bursa Efek Indonesia: Indeks Sektorial hal.5. Bursa Efek Indonesia: Jakarta
- _____. 2010. Buku Panduan Indeks Harga Saham Bursa Efek Indonesia: Metodologi Perhitungan Indeks hal.22. Bursa Efek Indonesia: Jakarta
- Lee, SB. 1992. *Causal Relations Among Stock Return, Interest Rate, Real Activity, and Inflation*. *Journal of Finance*, 47:1591-1603
- Magistra Media Maya. 2008. Lebih Dalam Dengan ROE (online) (<http://www.m3option.com>), diakses tanggal 15 Oktober 2010
- Martani, Dwi. 2010. Multiple Regresi di dalam presentasi Statistik untuk Bisnis 8
- Martani dan Munaiseche. 2009. *Factors Affecting Profitability of Multifinance Company in Indonesia*. Accounting Department, University of Indonesia
- Mawardi, Wisnu. 2004. Analisis Faktor-faktor Yang Mempengaruhi Kinerja Keuangan Bank Umum di Indonesia (Studi Kasus Pada Bank Umum Dengan Total Asset Kurang Dari 1 trilyun (tesis). Program Pascasarjana Universitas Diponegoro: Semarang
- Metode Analisis Du-Pont, (online) (<http://www.itittelkom.ac.id/library>, diakses tanggal 17 Juli 2010)

- Nasrudin, Rus'an dan Rizal, Husnul. 2009. Cakupan Teori Ekonomi Makro, Output, Inflasi, Pengangguran dan Variabel ekonomi Makro lainnya. Di dalam supplementary notes kuliah
- Ocktavia, Anna. 2007. Analisis Pengaruh Nilai Tukar Rupiah/US\$ dan Tingkat Suku Bunga SBI Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan di Bursa Efek Jakarta (Skripsi). Fakultas Ekonomi Universitas Negeri Semarang: Semarang
- Ponco, Budi. 2008. Analisis Pengaruh CAR, NPL, BOPO, NIM dan LDR Terhadap ROA (Tesis). Program Pasca Sarjana, Universitas Diponegoro: Semarang
- Reily, Frank K. 1997. *The Impact of Inflation on ROE, Growth and Stock Prices. Financial Services Review*, 6 (1): 1-17
- Return On Assets-ROA, (online) (<http://www.investopedia.com>, diakses tanggal 29 Juni 2010)
- Return On Equity-ROE, (online) (<http://www.investopedia.com>, diakses tanggal 29 Juni 2010)
- Santos, Singgih. 2000. Buku Latihan SPSS Statistik Parametri. PT Elex Media Komputindo: Jakarta
- Sudjono. 2002. Analisis Keseimbangan dan Hubungan Simultan Antara Ekonomi Makro Terhadap Indeks Harga Saham Gabungan di BEJ dengan Metode VAR (Vector Autoregression) dan ECM (Error Correction Model). *Jurnal Riset Ekonomi dan Manajemen*. Vol. 2. no.3
- Supriyanti, Neni. 2008. Analisis Pengaruh Inflasi dan Suku Bunga BI Terhadap Kinerja Keuangan PT Bank Mandiri, Tbk Berdasarkan Rasio Keuangan. Universitas Gunadarma
- Sugiarto. 2006. *Good Corporate Governance*, mampukah meningkatkan kinerja perusahaan? (Vol. 6; No.1). STIE IBII: Jakarta
- 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

- Suku Bunga SBI, (online) (<http://www.bi.go.id>, diakses tanggal 29 Juni 2010)
- Tim Studi BAPEPAM LK. 2008. Studi Analisis Pengaruh Faktor-Faktor Ekonomi Terhadap Kinerja Perusahaan Pembiayaan. BAPEPAM LK Departemen Keuangan: Jakarta
- Uli, Annisa Yunita. Analisis Pengaruh Faktor Fundamental dan Risiko Sistemik Terhadap Harga Saham Pada Perusahaan Sektor Industri Barang Konsumsi di BEI (laporan penelitian). Jurusan Akuntansi Fakultas Ekonomi Universitas Gunadarma: Depok
- Utomo, Novianto Satrio. 2008. Analisis Pengaruh Inflasi dan Suku Bunga BI Terhadap Kinerja Keuangan PT Bank Muamalat, Tbk Berdasarkan Rasio Keuangan. Universitas Gunadarma
- Zubaidah, Siti. Analisis Pengaruh Tingkat Inflasi, Perubahan Nilai Kurs Terhadap Beta Saham Syariah Pada Perusahaan yang Terdaftar di *Jakarta Islamic Index* (laporan penelitian). Program Studi Akuntansi FE UMM: Yogyakarta.