

## DAFTAR PUSTAKA

- Andritzky, Jochen R, *et .all.* 2005. *The Impact of Macroeconomic Announcement on Emerging Market Bonds*. International Monetary Fund (IMF) Working Paper April 2005
- Aswin, Idris. 2006. *Analisis Volatilitas dan Hubungan antara Indeks Obligasi Negara (ION) dan Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG)*. Master Tesis Universitas Indonesia. Jakarta.
- Bodie, Z. Kane, A, Marcus. AK. 2005. *Investments. Fifth Edition*, Mc Graw Hill, New York.
- Cahyana, Jaka E. 2004. *Langkah Taktis Metodis Berinvestasi di Obligasi*. Penerbit PT. Elex Media Komputindo Kelompok Gramedia. Jakarta.
- Cheng, Hsiao. 2006. *Panel Data Analysis-Advantages and Challenges*. IEPR Working Paper 06.49. University of Southern California. California
- Cheng, Hsiao. 2006. *Why Data Panel?*. IEPR Working Paper 05.33. University of Southern California. California
- Douglas, Livingstone G, 1998, *Yield Curve Analysis. New York Institute of Finance*. New York.
- Ditjen Pengelolaan Utang-Depkeu RI. 2006 . Laporan Pertanggungjawaban Pengelolaan Surat Utang Negara Tahun 2006. Jakarta.
- Eun, Cheol S and Resnick, Bruce G.2004. *International Financial Management*. The McGraw-Hill Companies Inc. New York.
- Fabozzi, Frank J, 1989, *Bond Markets, Analysis and Strategis*, Fourth Edition, Prentice Hall International Inc. New York.
- Fabozzi, Frank J. 1999. *Investment Management, second edition*. Prentice Hall International Incorporation. New Jersey.
- Flannery, Mark J. and Protopapadakis, Aris A.2002. *Macroeconomics Factors do Influence Agregate Stock Returns*. The Review of Financial Studies volume 15 No.3. Oxford University Press.
- Greene, William H. 2002. *Economics Analysis: Fifth Edition*. New York University. New York.

- Gujarati, Damodar. N, 2003, *Basics Econometrics, fourth edition*, McGraw-Hill International Edition.
- Gujarati, Damodar. N, dan Sumarno Zain.2003, *Ekonometrika Dasar*, Penerbit Erlangga. Jakarta.
- Haugen, Robert A. 1997. *Modern Investment Theory*, fourth edition. Prentice-Hall Incorporation. New Jersey.
- Hisan, Nailul. 2005. *Analisis Pengaruh Nilai Tukar Rupiah dan Suku Bunga Sertifikat Bank Indonesia terhadap Penjualan Obligasi Negara*. Master Tesis Universitas Borobudur. Jakarta
- Husnan, S., 2003. *Dasar-Dasar Teori Portfolio dan Analisis Sekuritas*, AMP YKPN, Yogyakarta.
- Manurung, MS. Joni J. dkk.2005. *Ekonometrika : Teori dan Aplikasi*. PT. Elex Medi Kompetindo. Jakarta.
- Manurung, Adler Haymans, 2002. *Pengelolaan Portofolio Obligasi..* PT. Elex Medi Kompetindo. Jakarta
- Munzir, Erman, 2006. *Tinjauan Teori Investasi Keuangan dan Kaitannya dengan Sektor Keuangan Indonesia : Teori Portfolio (Portfolio Theory) dan Model Penetapan Harga Asset Finansial (Capital Assets Pricing Model)*. Jurnal Ekonomi Media Ilmiah Indonusa Vol.11, bulan Mei 2006. Jakarta.
- Munzir, Erman, 2006. *Tinjauan Teori Kapan Beli Kapan Jual Securities (Securities Valuation)*. Jurnal Ekonomi Media Ilmiah Indonusa Vol.11, bulan Mei 2006. Jakarta.
- Nachrowi, N.D, dan Usman, H.2006. *Pendekatan Populer dan Praktis Ekonometrika untuk Analisis Ekonomi dan Keuangan*, Lembaga Penerbit FEUI, Jakarta.
- Nuruddin,KM. 2007. *Analisis Pengaruh Tingkat Bunga SBI, Suku Bunga Deposito dan Nilai Tukar Rupiah Terhadap Yield Obligasi Negara*. Master Tesis IPWIJA. Jakarta.
- Peters, David. W, 2005. *The Behaviour of Government of Canada Real Return Bond Return : An Empirical Study*. Faculty of Social Sciences University of Western Ontario. Canada
- Rahardjo, Sapto, 2003, *Panduan Investasi Obligasi*, Gramedia, Jakarta

Ridwan, Ali, *Membangun Pasar Obligasi yang Robust dan Vibrant*, Warta Bapepam, November 2003. Jakarta.

Susanto, Budi. 2007, *Kita Butuh Investor yang Lebih Aktif*, Harian Kompas, 26 November 2007. Jakarta.

Ulfa, Almizan dan Heru Subiyantoro.2004. Apakah Harga Obligasi Global Indonesia Terlalu Murah?. Jurnal Keuangan dan Moneter Volume 7 Nomor 1. Jakarta.

Uma sekaran, 2003, *Research Methods for Business*, 4 ed, John Wiley and Sons, New York.

Undang-undang Nomor 24 Tahun 2002 tanggal 22 Oktober 2002 tentang *Surat Utang Negara*. Jakarta

Widarjono, Agus., 2007, *Ekonometrika : Teori dan Aplikasi untuk Ekonomi dan Bisnis*, Ekonisia, Yogyakarta.

Winarno, Wing Wahyu. 2007. *Analisis Ekonometrika dan Statistika dengan Eviews*. UPP STIM YKPN. Yogyakarta.

Yuwono, Prapto. 2004. *Pengantar Ekonometri*. Penerbit ANDI Yogyakarta.

[www.bi.go.id](http://www.bi.go.id) Website Bank Indonesia

[www.bps.go.id](http://www.bps.go.id) Website Badan Pusat Statistik

[www.dmo.or.id](http://www.dmo.or.id) Website Ditjen Pengelolaan Utang, Depkeu-RI

[www.idx.co.id](http://www.idx.co.id) Website Bursa Efek Indonesia (BEI)

[www.esdm.go.id](http://www.esdm.go.id) Website Departemen Energi dan Sumber Daya Mineral RI