

DAFTAR PUSTAKA

- Abidin, Sazali., Reddy, Krishna., & Zhang, Chun. 2015. *Intensity of Price and Volatility Spillover Effects in Asia-Pacific Basin Equity Markets*. Australasian Accounting, Business and Finance Journal Volume 8, no. 5, 2014
- Ariefianto, Moch. Doddy. 2012. *Ekonometrika Esensi dan Aplikasi dengan Menggunakan EVIEWS*. Jakarta: Penerbit Erlangga
- Azis, Dr. Musdalifah, S.E., M.Si., Minarti, Prof. Dr. Sri, M.Si., & Nadir, Maryam, S.E., M.Si. 2015. *Manajemen Investasi*. Yogyakarta: Deepublish
- 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
- Bappeda Kabupaten Malang. 2015. *Kabupaten Malang Menuju MEA 2015*. Malang: Bappeda Kabupaten Malang
- Darmadji, Tjiptono & Fakhrudin, Hendy M. 2011. *Pasar Modal di Indonesia*. Jakarta: Salemba Empat
- Fahmi, Irham, S.E., M.Si. 2012. *Pengantar Pasar Modal*. Bandung: Alfabeta
- Fahmi, Irham & Hadi, Yovi L. 2011. *Teori Portofolio dan Analisis Investasi*. Bandung: Alfabeta
- Fauzi, Andi & Fitria, Arie Jayanthi. 2009. *Transmisi Harga dan Volatilitas Saham-Saham Dunia: Kajian Empiris Sebelum dan Setelah Krisis Subprime Mortgage*. MB-IPB
- Hamdi, Asep Saepul & Bahrudin. E. 2014. *Metode Penelitian Kuantitatif Aplikasi Dalam Pendidikan*. Yogyakarta: Deepublish
- Juliandi, Azuar., Irfan., & Manurung, Saprial. 2014. *Metodologi Penelitian Bisnis, Konsep dan Aplikasi*. Medan: UMSU PRESS
- Lestano & Sucito. 2010. *Spillover Volatilitas Pasar Saham Indonesia dan Singapura Periode 2001-2005*. Jurnal Akuntansi dan Keuangan, Vol. 12, No. 1, Mei 2010: 17-25
- Lusiana, Novita, S.K.M., M.Kes., Andriyani, Rika, S.S.T., M.Kes., & Megasari, Miratu, S.S.T., M. Kes. 2015. *Buku Ajar Metodologi Penelitian Kebidanan*. Yogyakarta: Deepublish.
- Mardiyati, Umi, dkk. (2012). *Analisis Pengaruh Kebijakan Dividen, Kebijakan Hutang dan Profitabilitas Terhadap Nilai Perusahaan Pada Perusahaan*

- Manufaktur Yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia Periode 2005-2010*. Jurnal Riset Manajemen Sains Indonesia (JRMSI), Vol. 3, No. 1
- Martelena & Malinda, Maya. 2011. *Pengantar Pasar Modal*. Edisi Pertama. Yogyakarta: Andi
- Martin & Yunita. 2010. *Volatility Spillover Pada Pasar Saham Indonesia, China, dan India*. Jurnal Akuntansi Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Bina Nusantara. Binus Business Review Vol.1 No.1 Mei 2010: 40-49
- Mulyadi, Martin Surya. 2009. *Volatility Spillover in Indonesia, USA, and Japan Capital Market*. MPRA Paper No. 16914, posted 24. August 2009 12:58 UTC
- Nachrowi, Djalal, & Usman, Hardius. 2006. *Pendekatan Populer dan Praktis Ekonometrika untuk Analisis Ekonomi dan Keuangan*. Jakarta: Lembaga Penerbit Universitas Indonesia
- Natarajan, Vinodh Kesavaraj., Singh, Azariah Robert Raja., & Priya, Nagarajan Chidham. 2014. *Examining mean-volatility spillovers across national stock markets*. V.K. Natarajan et al. / Journal of Economics, Finance and Administrative Science 19 (2014) 55–62
- Nugroho, Puguh Agung. 2010. *Pengujian Taraf Akurasi Model-model Volatilitas Dalam Menduga Nilai Risiko Obligasi (Studi Kasus : Obligasi Indon 14*. Semarang: Universitas Diponegoro
- Purbawati, Ni Luh Krisma & Dana, I Made. 2016. *Perbandingan Volatilitas Indeks Harga Saham Gabungan (IHSG) Sebelum dan Setelah Krisis Subprime Mortgage*. E-Jurnal Manajemen Unud, Vol. 5, No. 2, 2016: 1014-1042
- Rea, Alethea., Rea, William., Reale, Marco., dan Scarrott, Carl. 2013. *A Comparison of Spillover Effects before, during, and after the 2008 Financial Crisis*. Applied Mathematics, 5, pp: 301-314.
- Saadah, Siti. 2015. *Response Asymmetry in Spillover Volatility: An Empirical Study in the Indonesia and Singapore Stock Market*. Indonesian Capital Market Review Vol. V No. 2
- Salim, Joko, S.Kom., S.E., CFP. 2012. *Jangan Coba-Coba Main Saham Sebelum Baca Buku Ini*. Jakarta: Visimedia
- Samsul, Muhammad. 2010. *Pasar Modal dan Manajemen Portofolio*. Jakarta: Erlangga
- Setiawan, Sigit. 2013. *Analisis Sektor Pasar Modal Indonesia Menghadapi Liberalisasi dan Integrasi ASEAN. Policy Paper*. Pusat Kebijakan Regional dan Bilateral, Badan Kebijakan Fiskal-Kementerian Keuangan Indonesia

- Tandelilin, Prof. Dr. Eduardus, MBA, CWM. 2010. *Portofolio dan Investasi*. Yogyakarta: Kanisius.
- 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
- Winarno, Wing Wahyu. 2015. *Analisa Ekonometrika dan Statistika dengan Eviews: Edisi IV*. Yogyakarta: UPP STIM YKPN
- 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
- <https://idx.co.id>. (Online) (10 November 2016)
- <https://set.or.th>. (Online) (10 November 2016)
- <https://economist.com> (Online) (18 Oktober 2016)
- Kamaludin, Arif. (2016). *Pertumbuhan Kapitalisasi Pasar Bursa Indonesia Tertinggi di Asia*. (Online) <http://katadata.co.id/berita/2016/08/11/pertumbuhan-kapitalisasi-pasar-bursa-indonesia-tertinggi-di-asia> (25 Oktober 2016)
- Supriyatna, Iwan. (2016). *Kinerja Pasar Modal Indonesia Salah Satu yang Terbaik di Asia*. (Online) <http://bisniskeuangan.kompas.com/read/2016/08/10/140517326/kinerja.pasarmodal.indonesia.salah.satu.yang.terbaik.di.asia> (27 Oktober 2016)
- <https://finance.yahoo.com/> (Online) (16 Desember 2016)