

## DAFTAR PUSTAKA

- Aarstol, Michael P. 2000. *Inflation and Debt Maturity*, Quarterly Review of Financial Analysis, Vol. 40, p. 139-153.
- Abdul, H. Ahmad, R. Titi, Dewi N., & Edi Hidayat. 2006. *Analisis Durasi dan Convexity Untuk Mengukur Sensitivitas Harga Obligasi Korporasi Terhadap Perubahan Tingkat Suku Bunga (Studi Empiris Pada Obligasi-Obligasi di Indonesia)*, Jurnal Maksi, Vol. 6 No. 2, p 117-142.
- Achmad, N. & Setiawan, G. 2007. *Pengaruh Rating Obligasi dan Kupon Terhadap Harga Obligasi*, Jurnal Ilmiah Ranggagading.
- Damena, H. Safitri, E. Aprilia, R. 2013. *Analisis Pengaruh Coupon (Bunga Obligasi), Jangka Waktu Jatuh Tempo, Dan Liquiditas Obligasi Terhadap Tingkat Perubahan Harga Obligasi yang Terdaftar di Bursa Efek Indonesia*, Jurnal
- Ekak, V. & Abdanti, A. 2013. *Pengaruh Likuiditas, Waktu Jatuh Tempo, dan Kupon Obligasi Terhadap Perubahan Harga Obligasi Korporasi Berperingkat Rendah dan Berperingkat Tinggi*
- Elton, E.J., dan Green, T.C. 1998. *Tax and Liquidity Effects in Pricing Government Bonds*, The Journal of Finance
- Fabozzi, J. Frank. 2000. *Manajemen Investasi*. Buku 2. Jakarta: Salemba Empat. Jacky Kale Lena dan Apriani Dorkas R.A. (2003), "Pengukuran Durasi Obligasi Untuk Mengetahui Sensitivitas Harga Obligasi Terhadap Perubahan Tingkat Suku Bunga Di Indonesia", Jurnal Ekonomi dan Bisnis (Dian Ekonomi), Vol. XI No. 1 Maret, p. 1-14.
- Husnan, Suad. 1998. *Teori Portofolio dan Analisis Sekuritas*, UPP AMP YKPN: Yogyakarta.
- Jogiyanto, Hartono. 2010. *Teori Portofolio dan Analisis Ivestasi*. Edisi Kedua. Yogyakarta : BPFE.
- Kellerhals, B.P. & Schobel, R. 2001. *Risk Attitudes of Bond Investors*, Working Paper, didownload dari [www.papers.ssrn.com](http://www.papers.ssrn.com)
- Kempf, A. & Uhrig-Homburg, M. 2000. *Liquidity and its Impact on Bond Prices*, Schmalenbach Business Review
- Kempf, Marlises Uhrig. 2000. *Liquidity and Its Impact on Bond Prices*. Journal of Schmalenbach Business, Vol. 5, No. 1, pp: 26-44.

- Kusuma, Hadri. 2005. *Pengaruh Durasi dan Konveksitas Terhadap Sensitivitas Harga Obligasi*. Kajian Bisnis dan Manajemen, Vol. 7 No. 2, 2005 Hal. 35 – 52.
- Lusi, Kesumawati. 2003. *Pengaruh Peringkat Utang dan Berbagai Faktor Yang Turut Mempengaruhi Harga Obligasi Sebagai Variabel Kontrol Terhadap Yield Premium Obligasi*, Tesis, Magister Manajemen UKSW, Salatiga.
- Merton, Robert C. 1973. *On The Pricing OF Corporate Debt: The Risk Structure Of Interest Rates*.
- May, Anthony D. 2010. *The Impact of Bond Rating Changes on Corporate Bond Prices; New Evidence From The Over-the-counter Market*. Journal of Banking and Finance, Vol 34, Issue 11, November 2010, pp 2822-2836.
- Nurfauziah, dan Setyarini. 2004. *Analisis Faktor-Faktor Yang Mempengaruhi Yield Obligasi Perusahaan (Studi Kasus Pada Industri Perbankan dan Industri Finansial)*. Jurnal Siasat Bisnis, Vol. 9, No. 2, pp: 241-256.
- Rahardjo, Supto. 2003. *Panduan Investasi Obligasi*, Penerbit PT. Gramedia Pustaka Utama, Jakarta.
- Rutoto, Sabar. 2007. *Pengantar Metodologi Penelitian*. FKIP: Universitas Muria Kudus
- Satoto, Shinta Heru. 2011. *Analisis Faktor-faktor yang Mempengaruhi Bond Rating*. Karisma, Vol.5(2): 104-115, 2011
- Sitorus, Tarmiden. 2015. *Pasar Obligasi Indonesia*, PT. Rajagrafindo Persada, Jakarta.
- Sugiyono. 2011. *Metode Penelitian Kuantitatif, Kualitatif, dan R&D*. Bandung: AFABETA, cv.
- Sukanto, Eman. 2009. *Pengaruh Suku Bunga Deposito, Kurs Rupiah-USD, Tingkat Inflasi, IHSG dan Volume Transaksi Terhadap Harga Obligasi Pemerintah RI (SUN)*. Jurnal Fokus Ekonomi Vol. 4 No. 2 Desember 2009 : 9 - 23
- W, Gulo. 2002. *Metodelogo penelitian*, Penerbit Gramedia Widiasarana Indonesia, Jakarta.
- Yuan, Kathy. 2001. *The Liquidity Service of Sovereign Bonds, Working Paper*, didownload dari [www.papers.ssrn.com](http://www.papers.ssrn.com)
- [http://www.ksei.co.id/isin\\_codes/government\\_bonds](http://www.ksei.co.id/isin_codes/government_bonds), diakses pada tanggal 8 Oktober 2015
- [www.bi.go.id](http://www.bi.go.id) , diakses tanggal 8 Oktober 2015