

2. Penelitian terkait obligasi negara Republik Indonesia masih cukup sedikit dilakukan sebelumnya sehingga rujukan penelitian terdahulu berasal dari penelitian terhadap obligasi korporasi di Indonesia serta obligasi negara lain yang dimungkinkan memiliki karakteristik unik yang berbeda.

DAFTAR PUSTAKA

- Acharya, Viral V. *et al.* 2010. *Liquidity Risk of Corporate Bond Returns*. New York STERN School of Business: Working Paper Series.
- Amihud, Yakov dan Haim Mendelson. 2006. *Liquidity, Maturity, and the Yields on U.S. Treasury Securities*. The Journal of Finance, Vol. 66 No. 4.
- Creswell, John W. 2013. *Research Design: Qualitative, Quantitative, and Mixed Methods Approaches*. Edisi Keempat. Sage. California, Amerika Serikat.
- Ekak, Vikaria dan Nyoman Abundanti. 2011. *Pengaruh Likuiditas, Waktu Jatuh Tempo, dan Kupon Obligasi Terhadap Perubahan Harga Obligasi Korporasi Berperingkat Rendah dan Berperingkat Tinggi*. Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Udayana, Denpasar.
- Ehrhardt, Michael C. dan Eugene F. Brigham. 2011. *Financial Management: Theory and Practice*. Edisi Ketigabelas. Cengage Learning. Ohio.
- Fabozzi, Frank J.. 2007. *Fixed Income Analysis*. Edisi Kedua. John Wiley and Sons, Inc. New Jersey.
- Favero, Carlo *et al.* 2007. *How Does Liquidity Affect Government Bond Yields?*. Centre for Studies in Economics and Finance. Working Paper No. 181.
- Ghozali, Imam. 2009. *Aplikasi Analisis Multivariate dengan Program SPSS*. Edisi Keempat. Badan Penerbit Universitas Diponegoro. Semarang.
- Greenwood, Robin dan Dimitri Vayanos. 2010. *Price Pressure in the Government Bond Market*. American Economic Review, vol. 100, hal. 585-590.
- Gujarati, Damodar N. 2004. *Basic Econometrics*. Edisi Keempat. The McGraw-Hill. Amerika Serikat.
- Horne, James C. Van dan John M. Wachowicz, Jr. 2009. *Fundamental of Financial Management*. Edisi Ketigabelas. Prentice Hall. Essex.
- Huberman, Gur dan Zhenyu Wang. 2005. *Arbitrage Pricing Theory*. Federal Reserve Bank of New York.
- Hyman, Jay *et al.* *Coupon Effects on Corporate Bonds: Pricing, Empirical Duration, and Spread Convexity*. The Journal of Fixed Income, vol. Winter 2015, hal. 52.

- Ikatan Akuntan Indonesia. 2014. *Penyataan Standar Akuntansi Keuangan 50 Instrumen Keuangan: Penyajian*. Jakarta.
- Kempf, Alexander dan Marliese Uhrig-Homburg. 2000. *Liquidity and Its Impact on Bond Prices*. *Schmalenbach Business Review*, Vol. 52, hal. 26 – 44.
- Krisnilasari, Monica. 2007. *Analisis Pengaruh Likuiditas Obligasi, Coupon Dan Jangka Waktu Jatuh Tempo Obligasi Terhadap Perubahan Harga Obligasi Di Bursa Efek Surabaya*. Tesis. Magister Manajemen Universitas Diponegoro. (Tidak Dipublikasikan).
- Maziyya, Putu Ayu *et al.* *Mengatasi Heteroskedastisitas pada Regresi dengan Menggunakan Weighted Least Square*. *E-Jurnal Matematika*, Vol. 4 (1), Januari 2015, hal. 20-25.
- Nayak, Subhankar. 2010. *Investor Sentiment and Corporate Bond Yield Spreads*. *Review of Behavioral Finance*, Vol. 2, hal. 59–80.
- Purba, Dita Afrida. 2016. *Analisis Pengaruh Likuiditas Obligasi, Waktu Jatuh Tempo dan Kupon Obligasi terhadap Harga Obligasi Korporasi di Bursa Efek Indonesia (BEI) (Studi Kasus Pada Perusahaan Korporasi Yang Memiliki Peringkat Minimal “AA”)*. Skripsi. Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas Lampung. (Tidak Dipublikasikan).
- Republik Indonesia. 2002. Undang-Undang Republik Indonesia Nomor 24 Tahun 2002 tentang Surat Utang Negara. Lembaran Negara Republik Indonesia Nomor 4236. Sekretariat Negara.
- Sekaran, Uma dan Roger Bougie. 2010. *Research Methods for Business*. Edisi Kelima. John Wiley and Sons. West Sussex, Inggris.
- Subagia, I Ketut dan Ida Bagus Panji Sedana. 2015. *Analisis Pengaruh Likuiditas, Waktu Jatuh Tempo dan Kupon Obligasi terhadap Perubahan Harga Obligasi Korporasi di Bursa Efek Indonesia*. *E-Jurnal Manajemen Unud*, Vol. 4, No. 5, hal. 1451-1465.
- Sukanto, Eman. 2009. *Pengaruh Suku Bunga Deposito, Kurs Rupiah-USD, Tingkat Inflasi, IHSG dan Volume Transaksi Terhadap Harga Obligasi Pemerintah RI (SUN)*. *Fokus Ekonomi*, Vol. 4, hal 9-23.
- Tarek, Chebby. 2009. *Default, Liquidity and Credit Spread: Empirical Evidence from Structural Model*. Faculty of Economic Sciences and Management of Nabuel. Tunisia.

- Tuysuz, Sukriye. 2013. *Conditional Correlations between Stock Index, Investment Grade Yield, High Yield and Commodities (Gold and Oil) during Stable and Crisis Periods*. International Journal of Economics and Finance, Vol. 5, No. 9.
- Vonhoff, Volker. 2013. *Yield Differences Between Coupon and Principal STRIPS*. Managerial Finance, Vol. 40 No. 4, hal.326-354.
- Wachter, Jessica A. 2003. *Risk Aversion and Allocation to Long-Term Bonds*. Journal of Economic Theory, Vol. 112, hal. 325–333.
- Wijaya, IGN Satria. 2014. *Pengaruh Tingkat Bunga Pasar, Tingkat Bunga Kupon dan Waktu Jatuh Tempo Obligasi terhadap Harga Obligasi di Bursa Efek Indonesia*. Tesis. Magister Manajemen Universitas Udayana. (Tidak Dipublikasikan).