

5.2 SARAN

1. Untuk peneliti selanjutnya agar mencoba untuk menilai perbedaan kinerja indeks konvensional lain, selain LQ45 sebagai proksi indeks konvensional, seperti indeks BISNIS-27, indeks PAPAN UTAMA, indeks SRI KEHATI dan indeks konvensional lainnya.
2. Untuk peneliti selanjutnya agar menggunakan metode pengukuran *risk adjusted performance* secara lengkap, yaitu menggunakan metode *Sharpe*, *Jensen*, dan *Treynor*. Agar dapat lebih terlihat perbandingan kinerja antar indeks yang akan diuji.
3. Untuk peneliti selanjutnya agar memperkuat pengujian kinerja indeks yang diujinya dengan memilih periode penelitian yang sekiranya pada saat itu terdapat peristiwa yang dapat mempengaruhi kinerja indeks harga saham, seperti peristiwa pemilihan presiden, perubahan kebijakan moneter, inflasi, ataupun kebijakan ekonomi lainnya.

DAFTAR PUSTAKA

- Anwar Prabu Mangkunegara, (2002), *Manajemen Sumber Daya Manusia*, PT. Remaja Rosda Karya, Bandung.
- Dessler, Gary.(2000). *Manajemen Sumber Daya Manusia*, Edisi Terjemahan, Penerbit PT. Prenhallindo, Jakarta.
- Hasanah, Uswatun. (2011). “*Perbandingan Kinerja Harga Saham Syari’ah Periode 2007-2009*”. Skripsi. Program Studi Muamalat (Ekonomi Islam), Fakultas Syari’ah dan Hukum, UIN Syarif Hidayatullah Jakarta.
- IDX. (2010). Indonesia Stock Exchange. 2017, from <http://www.idx.co.id>.

- Kayo, Edison Sutan, dan Karismawati, Nesya. (2014). “Daftar Saham LQ45 dan Jakarta Islamic Index (JII)”. From : <https://www.sahamok.com/>.
- Kompas. (2016). Ekonomi Kompas. 2017. From : <http://bisniskeuangan.kompas.com/>. Diakses pada: Rabu 19 Juli 2017 pukul 2:57.
- Kurniawan, Rizki Dwi dan Nadia Asandimitra. (2014). “Analisis Perbandingan Kinerja Indeks Saham Syari’ah dan Kinerja Indeks Saham Konvensional”. Jurnal Ilmu Manajemen (Volume 2 Nomor 4 Oktober 2014).
- Laila, Nur Himmatul. (2014). “Evaluasi Perbandingan Kinerja Saham-saham Syari’ah di Indonesia dan Malaysia Periode Januari 2011-Desember 2013”. Jurnal Ilmu Manajemen. Universitas Islam Negeri Maulana Malik Ibrahim Malang.
- Luthans, Fred.(2005). *Perilaku Organisasi*, Edisi Sepuluh, Diterjemahkan oleh : Vivin Andhika Yuwono; Shekar Purwanti; Th.Arie Prabawati; dan Winong Rosari. Penerbit Andi, Yogyakarta.
- Naftali, Yohan. Capital Asset Pricing Model (CAPM). Yohan Naftali. 2 November 2007, Revisi 6 Agustus 2009. Yohan Naftali. <http://yohanli.com/2007/11/capital-asset-pricing-model-capm>. Diakses pada: 1 Agustus 2017 pada 22:21.
- Putry, Galishia, Sugema I, dan Lubis D. “Analisis Perbandingan Ecess Return Jakarta Islamic Index (JII) dan Indeks Harga Saham Gabungan”. Jurnal Al-Muzara’ah (Vol.2, No.2).
- Rahmawati, Septi M. (2013). “Studi Empirik Perbandingan Kinerja Antara Jakarta Islamic Index (JII) dan Indeks LQ45 di Bursa Efek Indonesia Pada Saat, Sebelum, dan Setelah Krisis Keuangan Global”. Artikel Publikasi Twinning Program. Fakultas Ekonomi dan Bisnis dan Fakultas Agama Islam, Universitas Muhammadiyah Surakarta.
- Saepul Islam, Asep M.. (2014). “Daftar Saham JII Periode Desember 2016-Mei2017”. From: <http://www.syariahsaham.com/2016/11/daftar-saham->

jii-periode-desember-2016.html. Diakses pada : Jumat, 14 Juli 2017 pukul 21:54.

- Simatupang, Firdaus. (2010). *“Analisis Kinerja Saham Syari’ah Terhadap Saham Konvensional yang Diperdagangkan di BEI Pada Masa Krisis (Studi Perbandingan Menggunakan Metode Risk Adjusted Performance)”*. Skripsi. Program Studi Muamalat (Ekonomi Islam), Fakultas Syari’ah dan Hukum, UIN Syarif Hidayatullah Jakarta.
- Sulistyorini, Agustin. (2009). *“Analisis Kinerja Portofolio Saham Dengan Metode Sharpe, Treynor, dan Jensen (Saham LQ45 di Bursa Efek Indonesia Tahun 2003 sampai 2007)”*. Tesis. Program Studi Magister Manajemen, Universitas Diponegoro Semarang.
- Tandelilin, Eduardus. (2010). *Portofolio dan Investasi Teori dan Aplikasi*. Edisi pertama. Yogyakarta : Kanisius.
- Veitzal, Rivai dan Ahmad Fawzi Moh. Basri. (2005). *Performance Appraisal*: PT. Raja Grafindo Persada.
- Yahoo! Finance. (2017). Yahoo! Finance. 2017. From : <https://finance.yahoo.com>
- Yulianto. (2017). “Cara Menghitung Beta Saham”. From : <https://www.carajadikaya.com/cara-menghitung-beta-saham/>. Diakses pada : Selasa, 1 Agustus 2017 pukul 1:14.

