

## ABSTRAK

Tujuan dari penelitian ini yaitu untuk mengetahui analisis perbandingan antara kinerja reksadana saham syariah dan reksadana saham konvensional di Bursa Efek Indonesia. Metode sampel yang penulis lakukan dengan menggunakan *purposive sampling* yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia selama periode dari tahun 2011 sampai tahun 2015. Diperoleh sampel 23 reksadana saham terdiri dari 6 reksadana saham syariah dan 17 reksadana saham konvensional. Teknik analisis data yang penulis lakukan dalam penelitian ini yaitu menggunakan uji normalitas untuk mengetahui tingkat distribusi data yang penulis ambil selanjutnya data dianalisis dengan *uji independent sample t test*. Berdasarkan hasil analisis data yang penulis lakukan bahwa terdapat dua metode perhitungan yang berbeda kinerja yaitu metode Sharpe dan metode Jensen Alpha dan satu metode kinerja reksadana saham syariah dan reksadana saham konvensional sama yaitu metode Treynor. Berdasarkan hasil *uji Independent sampel t test* metode sharpe nilai signifikansi perbandingan kinerja reksadana saham syariah dan konvensional dari metode Sharpe yaitu 0,014, nilai tersebut lebih kecil dari  $\alpha = 0,05$ , yaitu  $0,014 < 0,05$ , artinya terdapat perbedaan secara signifikan kinerja reksadana saham syariah dan reksadana saham konvensional. Hasil *uji independent sampel t test* metode Treynor nilai signifikansi perbandingan kinerja reksadana saham syariah dan reksadana saham konvensional yaitu 0,386 yang berarti lebih besar nilainya dari  $(\alpha) = 0,05$ ,  $0,386 > 0,05$ , artinya bahwa tidak terdapat perbedaan secara signifikan kinerja reksadana saham syariah dan reksadana saham konvensional. Hasil perhitungan metode Jensen Alpha menggunakan *uji independent sampel t test*, nilai signifikannya yaitu  $0,023 < 0,05$ , artinya terdapat perbedaan signifikan antara kinerja Reksadana saham syariah dan reksadana saham konvensional.

**Kata Kunci:** Reksadana Saham Syariah, Reksadana Saham Konvensional, Index Syariah (JII), Index Konvensional (IHSG)