

ABSTRAK

Siti Listiana Tinnafiah, 2015, Skripsi. Judul: “Perbandingan Kinerja Reksadana saham Konvensional dan Reksadana Syariah di Indonesia dengan Metode *Sharpe, Treynor, Jensen*, Rasio Informasi dan *Roy Safety First Ratio*”.

Pembimbing : Drs. AgusSucipto, MM.

Kata Kunci : Kinerja Reksadana, Reksadana Saham Konvensional, Reksadana Saham Syariah

Reksadana adalah wadah yang dipergunakan menghimpun dana dari masyarakat pemodal untuk selanjutnya diinvestasi kedalam portofolio Efek oleh manajer investasi. Penelitian ini bertujuan untuk menganalisis perbandingan kinerja reksadana syariah dan konvensional menggunakan *metode sharpe, treynor, jensen, rasio informasi* dan *roy safety first ratio*.

Penelitian ini, menggunakan jenis penelitian kuantitatif. Dengan menggunakan populasi 151 reksadana saham konvensional dan 14 reksadana saham syariah. Sedangkan pengambilan sample berjumlah 21 reksadana konvensional dan 7 reksadana syariah yang dilakukan dengan *purposive sampling*. Metode pengumpulan data dalam penelitian ini adalah dokumentasi dan studi pustaka. Analisis data menggunakan metode *sharpe, treynor, jensen, rasio informasi* dan *roy safety first ratio*.

Hasil analisis perhitungan *Sharpe, Treynor, Jensen, Rasio Informasi dan Roy Safety First* menunjukkan bahwa reksadana saham konvensional lebih baik dari reksadana saham syariah. Setelah diuji dengan *statistic independent sample test*, menggunakan metode *sharpe* dan rasio informasi menyatakan bahwa tidak ada perbedaan antara kinerja reksadana saham konvensional dan saham syariah. Sedangkan dengan metode *treynor, jensen* dan *roy safety first ratio* menyatakan hal yang berbeda yaitu adanya perbedaan antara kinerja reksadana saham konvensional dan reksadana saham syariah.