

**PERBANDINGAN KINERJA INDEKS SAHAM KONVENSIONAL SRI-
KEHATI DAN INDEKS SAHAM SYARIAH JII PERIODE 2015-2019**

Zain Hafizh Firdaus

NIM : 141160325

zainhafizh27@gmail.com

Mahasiswa Progam Studi Manajemen Fakultas Ekonomi dan Bisnis Universitas
Pembangunan Nasional “Veteran” Yogyakarta

ABSTRAKSI

Penelitian ini menganalisis perbandingan kinerja indeks saham konvensional SRI-KEHATI dan indeks saham syariah JII periode 2015-2019. Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui apakah *return* dan kinerja SRI-KEHATI lebih tinggi dari JII serta perbandingan kinerja SRI-KEHATI dan JII selama tahun 2015 sampai 2019. Analisis dilakukan dengan menghitung *return* dan indeks Sharpe bulanan kemudian hasil perhitungan di uji beda menggunakan *Independent Sample T-test* pada SPSS versi 16.0. Hasil perhitungan menunjukkan *return* dan indeks Sharpe SRI-KEHATI lebih tinggi daripada JII selama tahun 2015 sampai 2019. Namun, dilihat dari hasil uji statistik dengan menggunakan uji beda *Independent Sample T-test* menunjukkan hasil bahwa tidak terdapat perbedaan yang signifikan antara kinerja indeks saham konvensional SRI-KEHATI dan indeks saham syariah JII.

Kata kunci : Indeks SRI-KEHATI, Indeks *Jakarta Islamic Index (JII)*, *return*, Indeks Sharpe, kinerja saham.