

ABSTRACT

Penelitian ini dilakukan untuk menguji pengaruh Return On Equity (ROE), Debt to Equity Ratio (DER), dan Earning Per Share (EPS) terhadap return saham pada perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index (JII).

Populasi yang digunakan dalam penelitian ini adalah perusahaan-perusahaan yang terdaftar di Jakarta Islamic Index selama triwulan 1, 2011 – triwulan 3, 2016. Pengambilan sampel perusahaan dalam penelitian ini dilakukan dengan Purposive Sampling yaitu dengan didasarkan pada perusahaan-perusahaan yang menerbitkan laporan keuangan resmi dan informasi harga saham selama periode pengamatan. Data tersebut diperoleh dari Indonesia Stock Exchange (IDX), Yahoo Finance, dan situs resmi perusahaan. Alat analisa data dalam penelitian ini menggunakan program spss 16.0. selanjutnya untuk menguji variabel dependen menggunakan analisis regresi linier berganda. Jumlah sampel yang digunakan dalam penelitian ini sebanyak 7 perusahaan dalam jangka waktu triwulan 1, 2011 – triwulan 3, 2016.

Dari hasil penelitian ini dapat ditarik kesimpulan bahwa variabel rasio keuangan yang menggunakan ROE, DER, dan EPS secara bersama-sama tidak berpengaruh terhadap return saham syariah. Hasil pengujian secara parsial pada variabel ROE yang memiliki pengaruh positif terhadap return saham syariah. Sedangkan pada variabel DER dan EPS tidak memiliki pengaruh terhadap return saham syariah.

Kata Kunci: Return On Equity, Debt to Equity Ratio, Earning Per Share, dan return saham.