

INTISARI

Pelitan ini bertujuan untuk menguji Pengaruh *Earning Per Share* (EPS), *Return On Equity* (ROE), *Debt Equity Ratio* (DER), *Net Profit Margin* (NPM) Terhadap Return Saham. Penelitian ini menggunakan data sekunder dan populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan yang terdaftar di *Jakarta Islamic Index* (JII) pada periode 2006 samapi dengan 2011.

Uji asumsi klasik dalam penelitian ini meliputi uji Normalitas, Uji Multikolonieritas, heteroskedastisitas dan autokorelasi. Analisis data menggunakan analisis regresi linier berganda, uji F, uji T dan koefisien determinasi analisis data dengan menggunakan analisis regresi linier berganda dengan bantuan *software* SPSS 16.

Hasil analisis terhadap *Earning Per Share* (EPS) tidak berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham. Hasil analisis terhadap *Return On Equity* (ROE) menunjukan bahwa *Return On Equity* (ROE) berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham. Hasil analisis terhadap *Debt Equity Ratio* (DER) tidak berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham. Hasil analisis terhadap *Net Profit Margin* (NPM) tidak berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham. Hasil analisis regresi linier berganda diperoleh variabel *Return On Equity* (ROE) berpengaruh positif dan signifikan terhadap *return* saham dengan keyakinan 5 %. Hasil penelitian ini diperoleh nilai adjusted R square sebesar 21,120 yang berarti 21,120% variasi return saham dijelaskan oleh variasi dari variabel EPS, DER, NPM sedangkan sisanya sebesar 23,685 % dijelaskan oleh variabel lain yang tidak ikut terobservasi.

Kata Kunci : Return Saham, *Earning Per Share* (EPS), *Return On Equity* (ROE), *Debt Equity Ratio* (DER) , *Net Profi Margin* (NPM).