

ABSTRAK

ANALISIS PENGARUH *EARNING PER SHARE* (EPS), *RETURN ON EQUITY* (ROE), DAN *DEBT TO EQUITY RATIO* (DER) TERHADAP *RETURN SAHAM* PERUSAHAAN-PERUSAHAAN PADA *JAKARTA ISLAMIC INDEX* (JII) PERIODE TAHUN 2016-2018

Istiqomah. NPM 16610194. 2020. Penelitian ini bertujuan untuk menguji pengaruh variabel kinerja keuangan yaitu *Earning Per Share* (EPS), *Return on Equity* (ROE), dan *Debt to Equity Ratio* (DER) terhadap *return* saham pada perusahaan-perusahaan yang masuk dalam *Jakarta Islamic Index* (JII) pada periode 2016 hingga 2018. Saham syariah merupakan saham-saham perusahaan yang dalam operasionalnya tidak bertentangan dengan syariat Islam, baik mengenai produk maupun manajemennya.

Sampel penelitian ini terdiri dari 30 perusahaan dengan jumlah data pengamatan sebanyak 90 data pengamatan. Metode pengambilan sampel dilakukan dengan menggunakan *puposive sampling*. Metode pengujian hipotesis yang digunakan adalah analisis regresi berganda.

Hasil penelitian ini secara parsial menunjukkan bahwa variabel *Earning Per Share* (EPS), *Return on Equity* (ROE), dan *Debt to Equity Ratio* (DER) tidak berpengaruh terhadap *Return* saham. Hasil penelitian secara simultan menunjukkan bahwa *Earning Per Share* (EPS), *Return on Equity* (ROE), dan *Debt to Equity Ratio* (DER) berpengaruh positif terhadap *Return* saham.

Kata Kunci : *Return Saham, Earning Per Share* (EPS), *Return on Equity* (ROE), dan *Debt to Equity Ratio* (DER).